

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	179.579,45	13,80%	294	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.944,28	0,84%	689	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	20.354,97	1,56%	443	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	425.651,42	32,71%	576	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	664.603,52	51,08%	98	0,82%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.301.133,64				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ ATENÇÃO! Limite cumulativo em desacordo com a Resolução!

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2021** não está cadastrada !!!

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Janeiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
PETRA CAPITAL	664.603,52	51,08	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	636.530,12	48,92	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

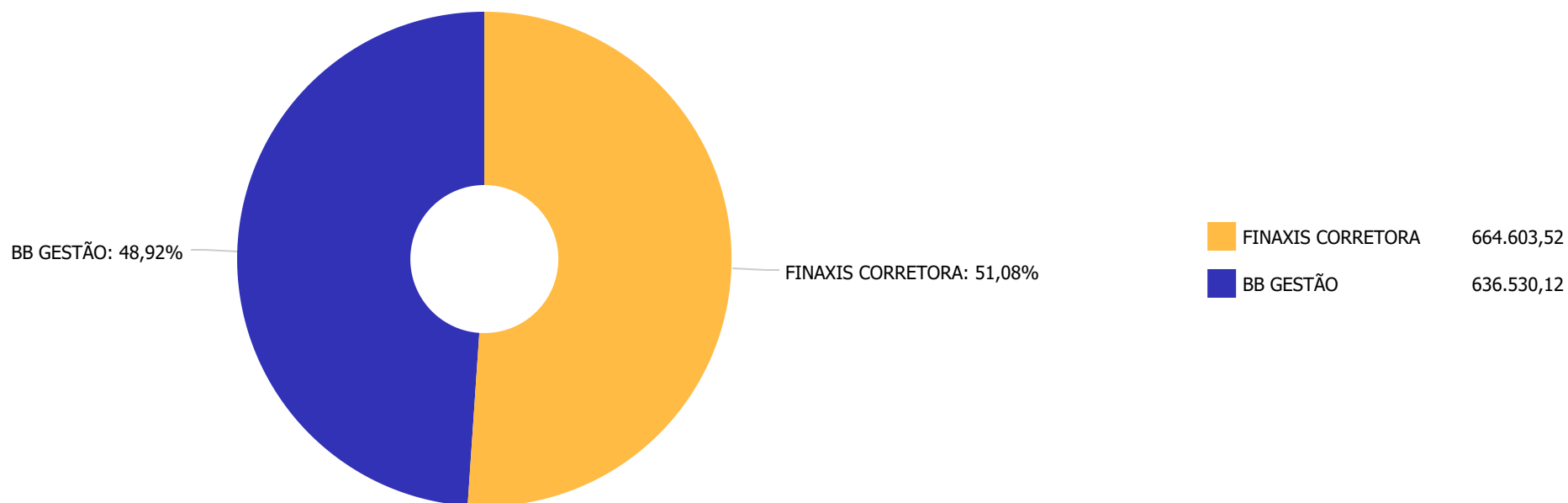
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

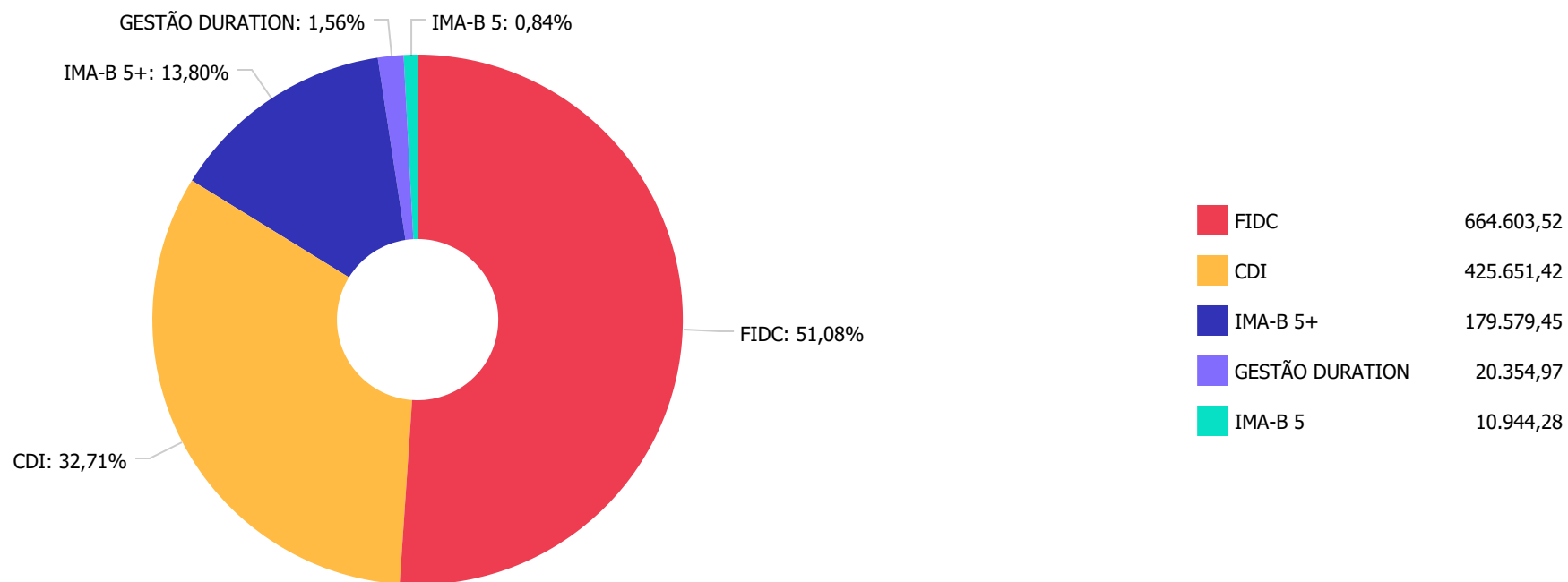
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,69%	-1,69%	8,43%	2,01%	3,68%	26,83%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,70%	-1,70%	8,29%	1,74%	3,23%	26,02%	4,10%	0,17%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	1,04%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,17%	0,17%	0,58%	0,94%	2,21%	7,89%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,47%	-0,47%	3,25%	1,20%	-	-	1,56%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,20%	-0,20%	-0,51%	5,71%	-4,51%	-13,57%	0,05%	0,11%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ ATENÇÃO! Meta Atuarial de **2021** não está cadastrada !!!

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	424.949,67	0,00	0,00	425.651,42	701,75	0,17%	0,17%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.933,74	0,00	0,00	10.944,28	10,54	0,10%	0,10%	1,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	665.965,38	0,00	0,00	664.603,52	-1.361,86	-0,20%	-0,20%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	20.450,30	0,00	0,00	20.354,97	-95,33	-0,47%	-0,47%	1,56%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	182.677,73	0,00	0,00	179.579,45	-3.098,28	-1,70%	-1,70%	4,10%
Total Renda Fixa	1.304.976,82	0,00	0,00	1.301.133,64	-3.843,18	-0,29%		0,63%