

Relatório Analítico dos Investimentos

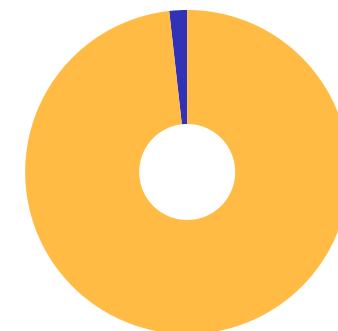
em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

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	1.531.560,74	10,78%	310	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.059.031,07	21,52%	648	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.753.288,19	19,37%	905	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.135.505,99	7,99%	336	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	592.689,66	4,17%	21.251	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.928.272,15	13,57%	903	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.205.941,26	8,48%	126	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	25.176,44	0,18%	755	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.398.680,32	9,84%	271	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	330.945,32	2,33%	586	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	251.841,68	1,77%	13.986	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			14.212.932,82				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			11.259,73	Artigo 6º			
PL Total			14.224.192,55				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA FIXA) - base (Setembro / 2020)

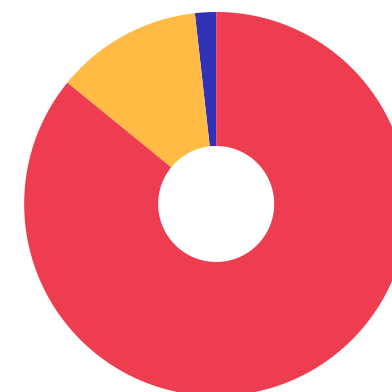
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	14.212.932,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	12.206.289,06	85,88%	0,00%	66,00%	100,00%	2.006.643,76
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	14.212.932,82
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.646,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	8.527.759,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	8.527.759,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	1.754.802,08	12,35%	0,00%	10,00%	40,00%	3.930.371,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	5.685.173,13
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.842.586,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.131.939,92
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.131.939,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.646,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.646,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.646,64
Total Renda Fixa	100,00%	13.961.091,14	98,23%	0,00%	76,00%	570,00%	



REDA FIXA 13.961.091,14
REDA VARIÁVEL 251.841,68

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	12,00%	30,00%	4.263.879,85
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	4.263.879,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	251.841,68	1,77%	0,00%	12,00%	20,00%	2.590.744,88
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.842.586,56
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.421.293,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.646,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.646,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.646,64
Total Renda Variável	30,00%	251.841,68	1,77%	0,00%	24,00%	125,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.421.293,28
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.421.293,28
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.421.293,28
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	

7º I b 7º IV a 8º II a

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Setembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.273.666,04	58,21	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.888.794,18	27,36	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	1.205.941,26	8,48	0,01
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	844.531,34	5,94	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	12.206.289,06	85,88	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.754.802,08	12,35	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	251.841,68	1,77	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	0,01%	0,03%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,60%	-4,56%	0,75%	6,78%	-1,67%	42,42%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,65%	-4,82%	0,59%	6,44%	-1,87%	41,55%	0,06%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,64%	-4,82%	0,65%	6,56%	-2,10%	40,98%	0,06%	0,17%

IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,15%	4,30%	1,18%	4,93%	6,95%	23,16%	0,02%	0,04%

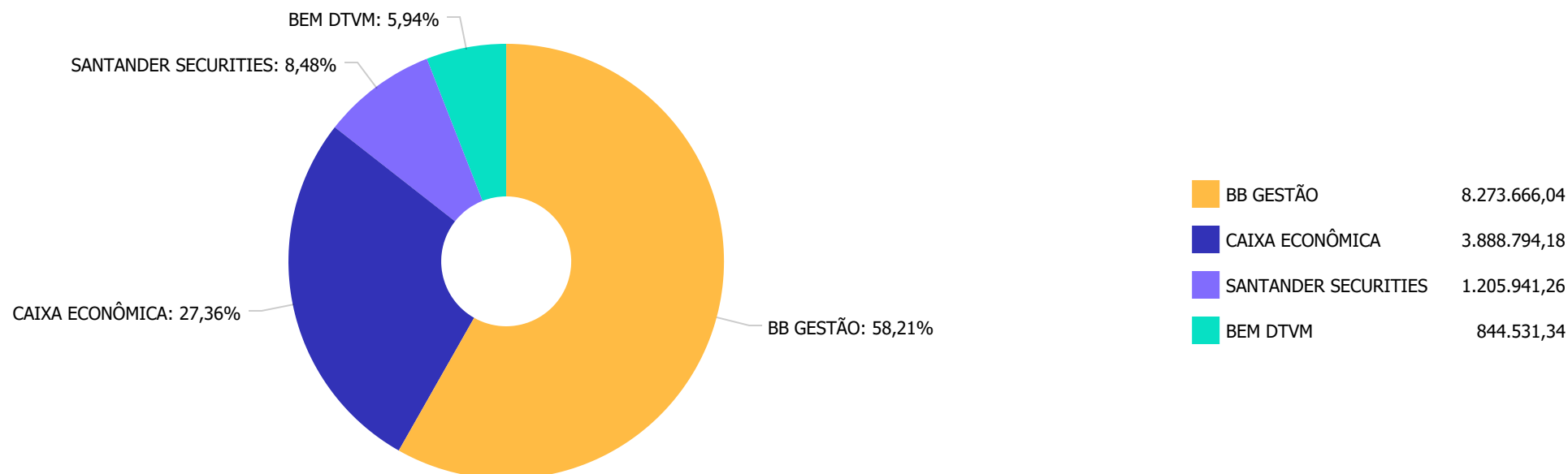
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,57%	-1,05%	0,91%	5,82%	1,71%	33,16%	0,04%	0,11%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-1,29%	-0,96%	0,76%	5,36%	1,80%	29,72%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,53%	-1,00%	0,89%	5,84%	1,68%	33,36%	0,04%	0,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-1,26%	-1,90%	1,07%	5,91%	1,30%	31,89%	0,04%	0,10%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	1,82%	0,44%	1,22%	2,98%	9,27%	0,00%	0,00%

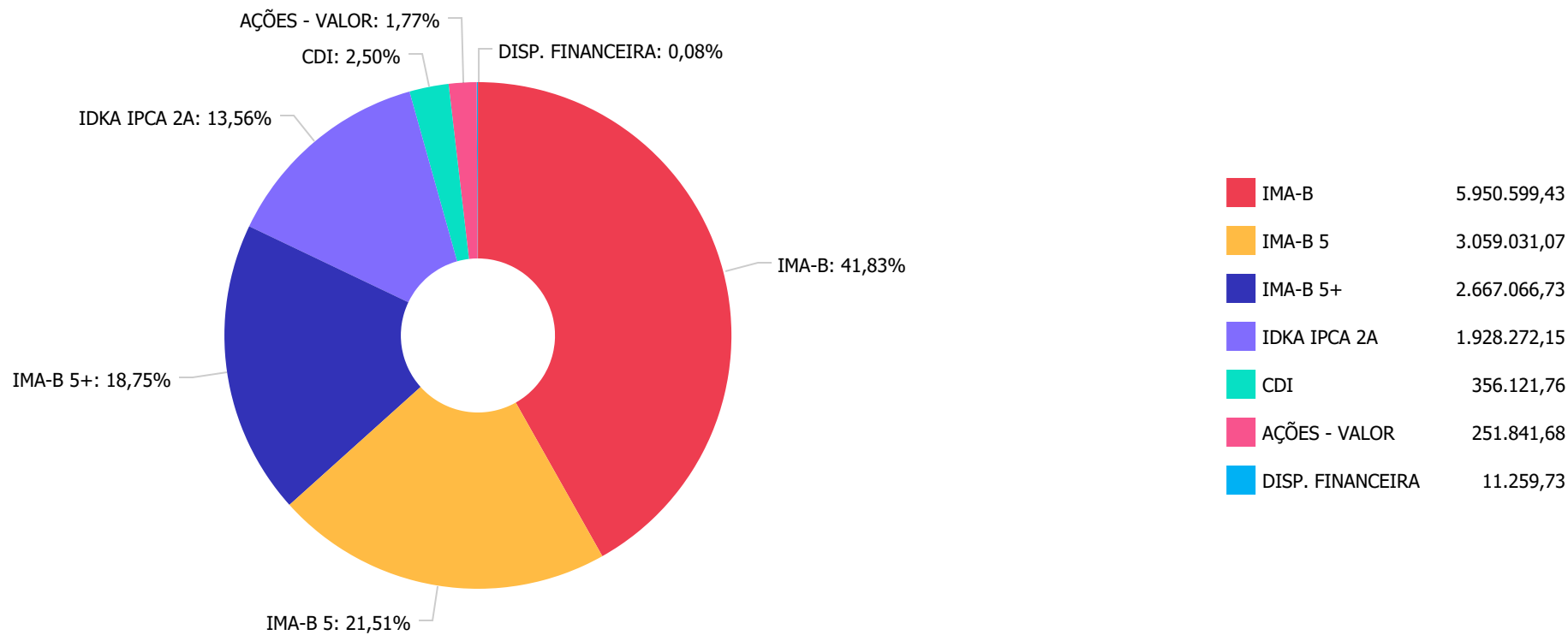
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-7,94%	-25,44%	-0,15%	30,62%	-15,48%	24,09%	0,11%	0,48%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2020)



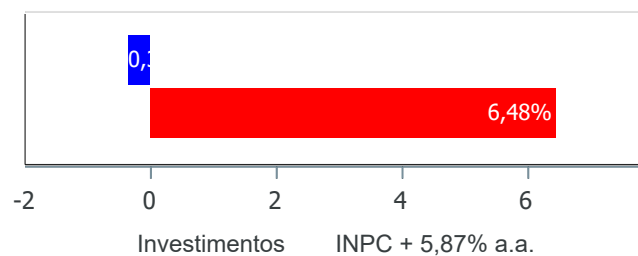
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

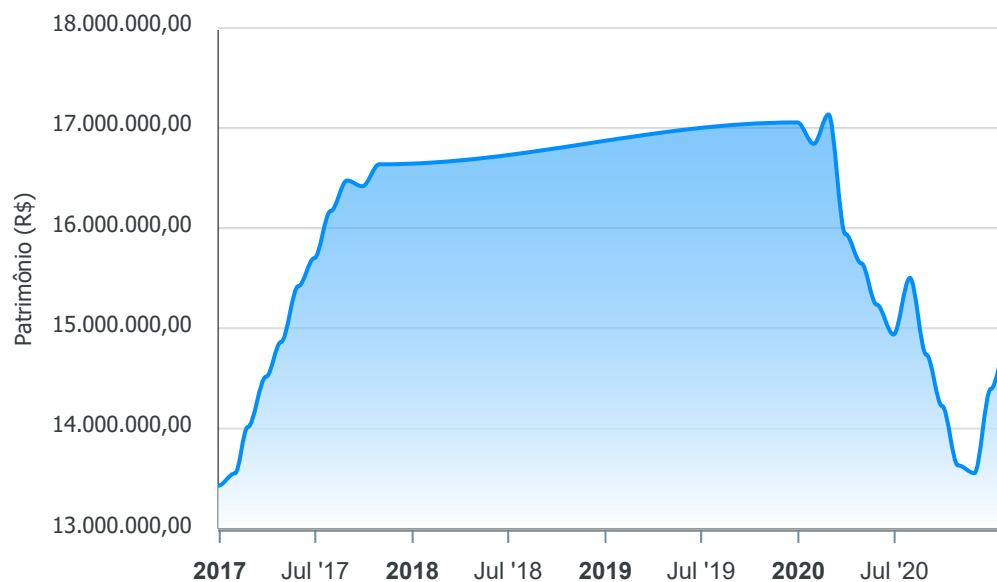
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	17.057.044,93	641.818,44	896.199,95	16.843.591,48	40.928,06	40.928,06	0,24%	0,24%	0,69%	0,69%	34,77%	1,56%
Fevereiro	16.843.591,48	620.987,80	372.613,82	17.136.320,55	44.355,09	85.283,15	0,26%	0,50%	0,58%	1,27%	39,28%	2,17%
Março	17.136.320,55	462.703,65	618.327,76	15.942.240,87	-1.038.455,57	-953.172,42	-6,06%	-5,59%	0,68%	1,96%	-284,94%	13,98%
Abril	15.942.240,87	45.176,88	516.883,31	15.650.190,24	179.655,80	-773.516,62	1,13%	-4,53%	0,22%	2,19%	-206,78%	7,54%
Maiο	15.650.190,24	207.661,04	872.861,10	15.238.424,65	253.434,47	-520.082,15	1,62%	-2,98%	0,20%	2,40%	-124,38%	3,11%
Junho	15.238.424,65	22.370,27	597.309,84	14.939.043,07	275.557,99	-244.524,16	1,81%	-1,23%	0,78%	3,19%	-38,39%	2,56%
Julho	14.939.043,07	538.179,77	495.011,43	15.503.582,54	521.371,13	276.846,97	3,48%	2,21%	0,96%	4,19%	52,81%	2,02%
Agosto	15.503.582,54	13.929,34	585.303,35	14.738.218,35	-193.990,18	82.856,79	-1,25%	0,93%	0,84%	5,06%	18,43%	2,07%
Setembro	14.738.218,35	303.030,43	640.414,83	14.212.932,82	-187.901,13	-105.044,34	-1,27%	-0,35%	1,35%	6,48%	-5,47%	3,58%

Investimentos x Meta Atuarial



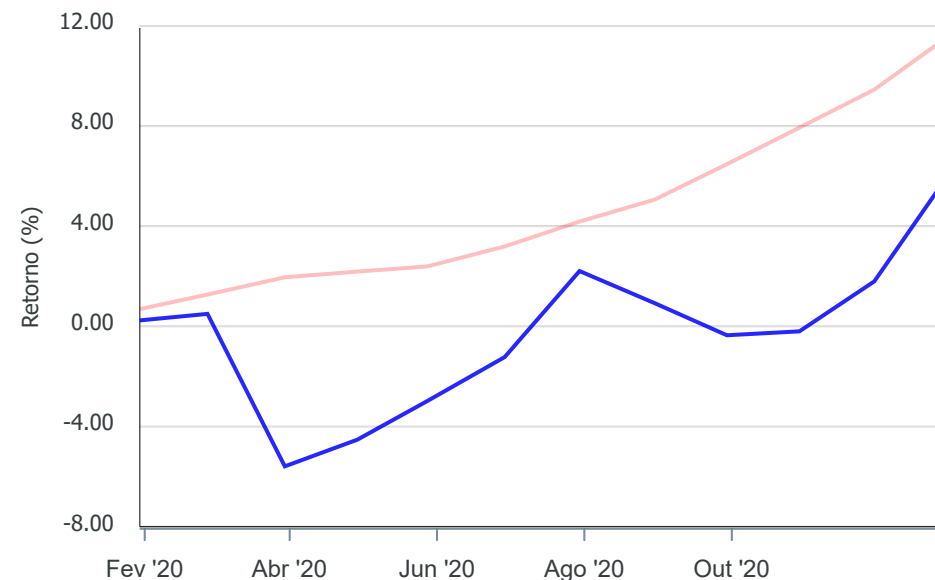
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial ☐ CDI ☐ IMA-B ☐ IMA-B 5
- ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1 ☐ IRF-M 1+
- ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.926.074,30	0,00	0,00	1.928.272,15	2.197,85	0,11%	0,11%	1,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	218.083,56	0,00	218.318,23	0,00	234,67	0,11%	0,13%	0,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	330.865,85	0,00	0,00	330.945,32	79,47	0,02%	0,02%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.274,30	303.030,43	279.096,60	25.176,44	-31,69	-0,01%	0,00%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.063.738,31	0,00	0,00	3.059.031,07	-4.707,24	-0,15%	-0,15%	1,65%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	600.274,31	0,00	0,00	592.689,66	-7.584,65	-1,26%	-1,26%	3,87%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.221.684,14	0,00	0,00	1.205.941,26	-15.742,88	-1,29%	-1,29%	3,51%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.942.188,11	0,00	143.000,00	2.753.288,19	-45.899,92	-1,56%	-1,53%	4,14%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.420.944,08	0,00	0,00	1.398.680,32	-22.263,76	-1,57%	-1,57%	4,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.166.332,17	0,00	0,00	1.135.505,99	-30.826,18	-2,64%	-2,64%	6,30%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.573.196,60	0,00	0,00	1.531.560,74	-41.635,86	-2,65%	-2,65%	6,28%
Total Renda Fixa	14.464.655,73	303.030,43	640.414,83	13.961.091,14	-166.180,19	-1,13%		3,45%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	273.562,62	0,00	0,00	251.841,68	-21.720,94	-7,94%	-7,94%	10,55%
Total Renda Variável	273.562,62	0,00	0,00	251.841,68	-21.720,94	-7,94%		10,55%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.023.301,47	0,00	0,00	3.059.031,07	35.729,60	1,18%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.897.641,78	0,00	0,00	1.928.272,15	30.630,37	1,61%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.871.420,70	0,00	143.000,00	2.753.288,19	24.867,49	0,87%	0,89%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.386.101,86	0,00	0,00	1.398.680,32	12.578,46	0,91%	0,91%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1.196.868,85	0,00	0,00	1.205.941,26	9.072,41	0,76%	0,76%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.522.623,79	0,00	0,00	1.531.560,74	8.936,95	0,59%	0,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.128.168,36	0,00	0,00	1.135.505,99	7.337,63	0,65%	0,65%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	586.424,64	0,00	0,00	592.689,66	6.265,02	1,07%	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	740.828,62	0,00	743.448,23	0,00	2.619,61	0,35%	0,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	329.489,62	0,00	0,00	330.945,32	1.455,70	0,44%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.955,25	855.139,54	834.281,38	25.176,44	363,03	0,04%	0,18%
			Total Renda Fixa		139.856,27	0,90%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	252.218,13	0,00	0,00	251.841,68	-376,45	-0,15%	-0,15%
Total Renda Variável					-376,45	-0,15%	