Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

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

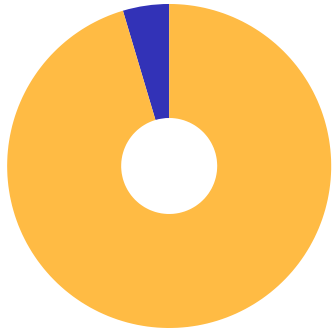
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	461.293,30	14,01%	922	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	440.296,06	13,37%	701	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	361.474,47	10,98%	679	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	489.178,22	14,86%	1.225	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	445.992,99	13,54%	685	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	677.875,78	20,59%	431	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	265.011,51	8,05%	576	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	151.757,46	4,61%	193	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			**3.292.879,79**				

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 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%	3.292.879,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	2.198.235,04	66,76%	40,00%	75,00%	100,00%	1.094.644,75
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	3.292.879,79
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	164.643,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.975.727,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.975.727,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	942.887,29	28,63%	0,00%	10,00%	40,00%	374.264,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	1.317.151,92
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	658.575,96
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	493.931,97
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	493.931,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	164.643,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	164.643,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	164.643,99
Total Renda Fixa	100,00%	3.141.122,33	95,39%	40,00%	89,00%	570,00%	



RENDA FIXA 3.141.122,33

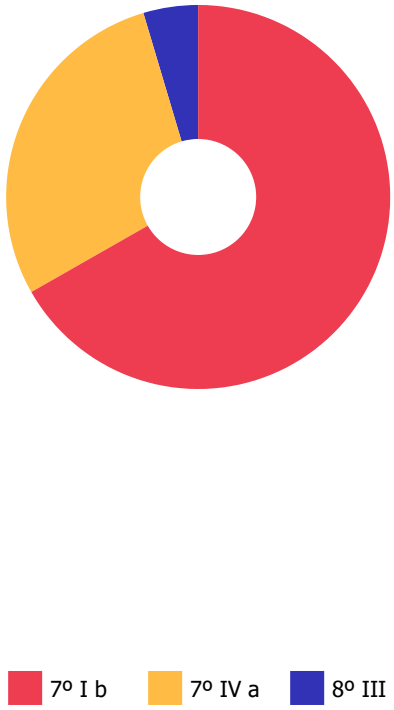
RENDA VARIÁVEL 151.757,46

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 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%	1,00%	30,00%	987.863,94
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	987.863,94
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	658.575,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	151.757,46	4,61%	0,00%	3,00%	10,00%	177.530,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	164.643,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	164.643,99
Total Renda Variável	30,00%	151.757,46	4,61%	0,00%	7,00%	100,00%	

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%	329.287,98
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	329.287,98
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	329.287,98
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	



LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.292.879,79	100,00	0,00

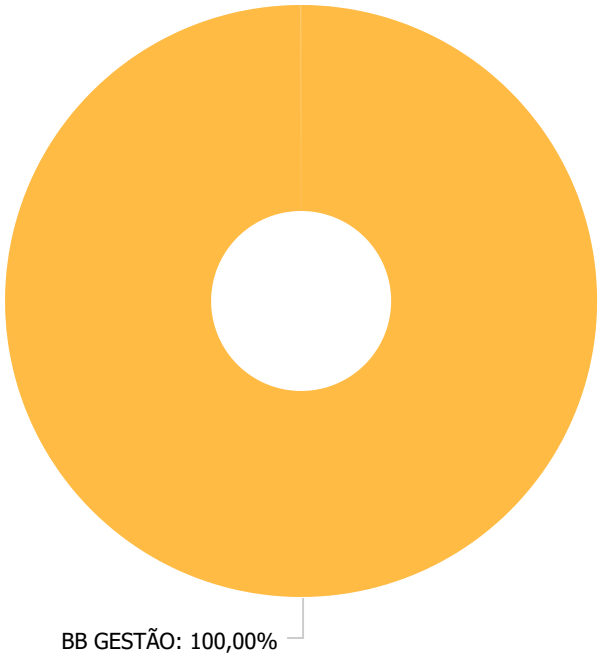
Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico,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

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

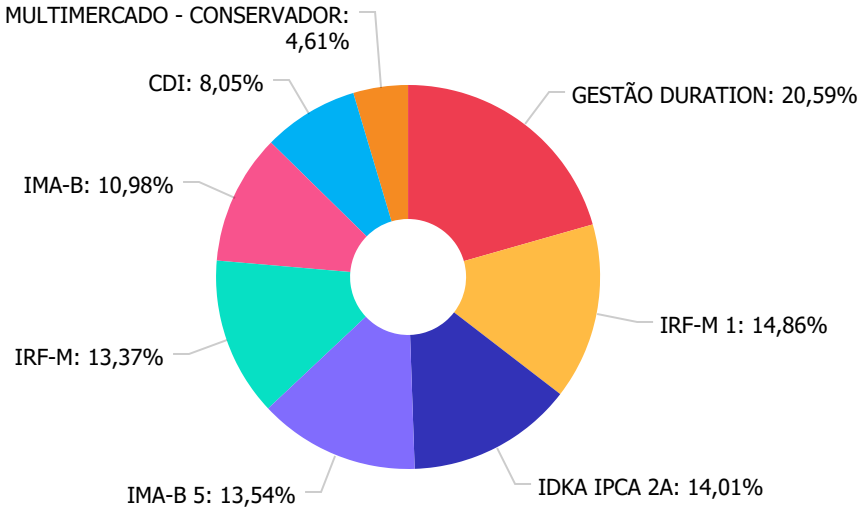
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)



BB GESTÃO	3.292.879,79

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

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

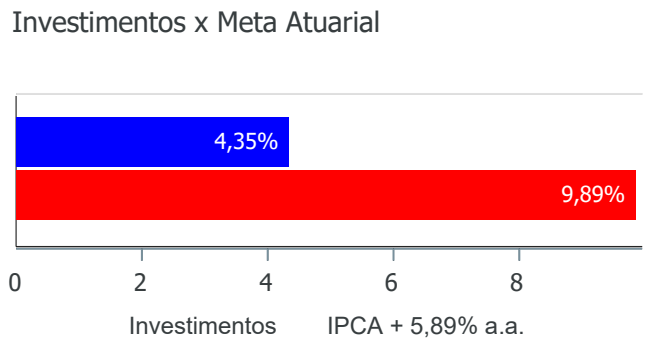


GESTÃO DURATION	677.875,78
IRF-M 1	489.178,22
IDKA IPCA 2A	461.293,30
IMA-B 5	445.992,99
IRF-M	440.296,06
IMA-B	361.474,47
CDI	265.011,51
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	151.757,46

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

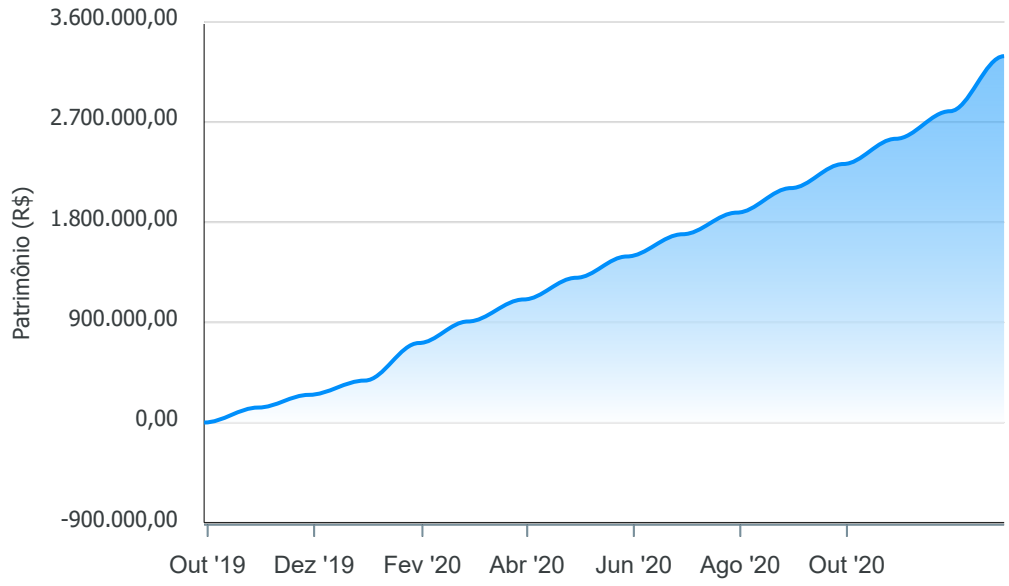
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	0,00	694.864,60	0,00	696.048,44	1.183,84	1.183,84	0,17%	0,17%	0,71%	0,71%	23,93%	0,09%
Fevereiro	696.048,44	0,00	0,00	698.505,08	2.456,64	3.640,48	0,35%	0,52%	0,66%	1,38%	38,04%	0,07%
Março	698.505,08	373.586,26	0,00	1.077.148,88	5.057,54	8.698,02	0,47%	1,00%	0,57%	1,96%	51,02%	0,62%
Abril	1.077.148,88	211.442,49	0,00	1.293.102,92	4.511,55	13.209,57	0,35%	1,35%	0,14%	2,10%	64,28%	0,49%
Maio	1.293.102,92	185.809,07	0,00	1.484.357,70	5.445,71	18.655,28	0,37%	1,72%	0,07%	2,18%	79,19%	0,20%
Junho	1.484.357,70	188.337,46	0,00	1.676.708,38	4.013,22	22.668,50	0,24%	1,97%	0,74%	2,93%	67,12%	0,05%
Julho	1.676.708,38	195.298,84	0,00	1.876.309,35	4.302,13	26.970,63	0,23%	2,20%	0,89%	3,85%	57,30%	0,15%
Agosto	1.876.309,35	221.968,23	0,00	2.099.974,77	1.697,19	28.667,82	0,08%	2,29%	0,72%	4,59%	49,78%	0,15%
Setembro	2.099.974,77	1.875.000,00	1.650.000,00	2.316.426,82	-8.547,95	20.119,87	-0,37%	1,91%	1,12%	5,76%	33,13%	1,23%
Outubro	2.316.426,82	226.000,01	0,00	2.543.216,46	789,63	20.909,50	0,03%	1,94%	1,34%	7,18%	27,03%	0,98%
Novembro	2.543.216,46	227.671,90	0,00	2.792.743,67	21.855,31	42.764,81	0,79%	2,75%	1,35%	8,63%	31,81%	0,87%
Dezembro	2.792.743,67	449.664,09	0,01	3.292.879,79	50.472,04	93.236,85	1,56%	4,35%	1,16%	9,89%	43,91%	0,82%



LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

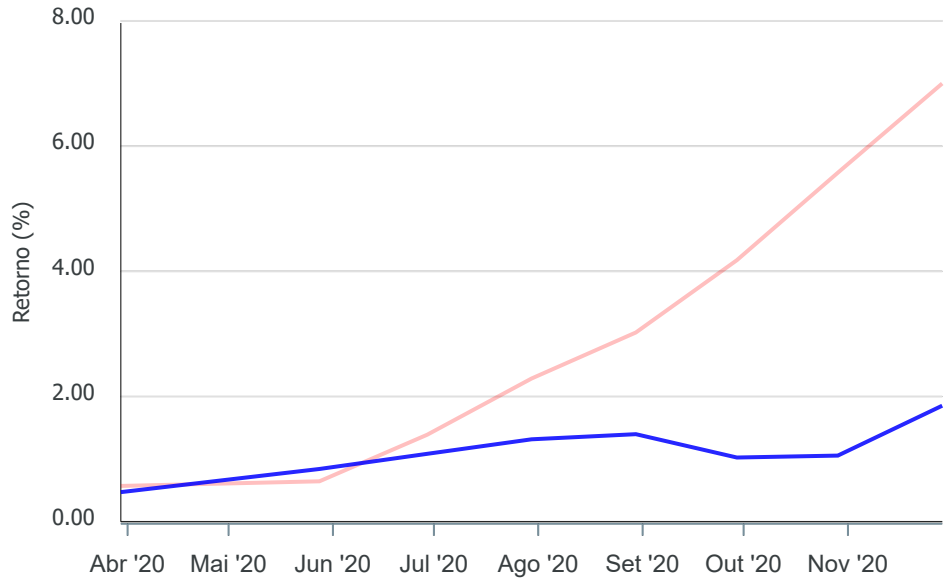
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	195.020,77	155.479,91	0,00	361.474,47	10.973,79	3,13%	4,84%	2,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	431.813,39	0,00	0,00	440.296,06	8.482,67	1,96%	1,96%	1,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	375.049,67	290.479,93	0,00	677.875,78	12.346,18	1,86%	2,70%	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	438.077,41	0,00	0,00	445.992,99	7.915,58	1,81%	1,81%	0,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	450.677,54	3.704,25	0,00	461.293,30	6.911,51	1,52%	1,53%	0,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	487.652,16	0,00	0,01	489.178,22	1.526,07	0,31%	0,31%	0,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	264.346,41	0,00	0,00	265.011,51	665,10	0,25%	0,25%	0,02%
Total Renda Fixa	**2.642.637,35**	**449.664,09**	**0,01**	**3.141.122,33**	**48.820,90**	**1,58%**		**0,84%**

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	150.106,32	0,00	0,00	151.757,46	1.651,14	1,10%	1,10%	0,47%
Total Renda Variável	**150.106,32**	**0,00**	**0,00**	**151.757,46**	**1.651,14**	**1,10%**		**0,47%**

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	371.575,58	290.479,93	0,00	677.875,78	15.820,27	2,39%	3,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	368.169,81	63.666,67	0,00	445.992,99	14.156,51	3,28%	3,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	373.768,44	73.704,25	0,00	461.293,30	13.820,61	3,09%	3,22%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	348.151,81	0,00	361.474,47	13.322,66	3,83%	7,13%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	367.932,45	63.666,67	0,00	440.296,06	8.696,94	2,02%	1,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	486.139,71	0,00	0,01	489.178,22	3.038,52	0,63%	0,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	199.931,48	63.666,67	0,00	265.011,51	1.413,36	0,54%	0,57%
			Total Renda Fixa		**70.268,87**	**2,29%**	

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	148.909,35	0,00	0,00	151.757,46	2.848,11	1,91%	1,91%
			Total Renda Variável		**2.848,11**	**1,91%**	

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	2.106.306,95	1.650.000,01	489.178,22	32.871,28	1,56%	3,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	348.151,81	0,00	361.474,47	13.322,66	3,83%	6,14%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	448.704,25	0,00	461.293,30	12.589,05	2,81%	7,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	665.479,93	0,00	677.875,78	12.395,85	1,86%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	433.666,67	0,00	445.992,99	12.326,32	2,84%	7,78%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	433.666,67	0,00	440.296,06	6.629,39	1,53%	6,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	263.666,67	0,00	265.011,51	1.344,84	0,51%	2,40%
			Total Renda Fixa		**91.479,39**	**3,00%**	

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	150.000,00	0,00	151.757,46	1.757,46	1,17%	2,01%
			Total Renda Variável		**1.757,46**	**1,17%**	

LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886