Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2020

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

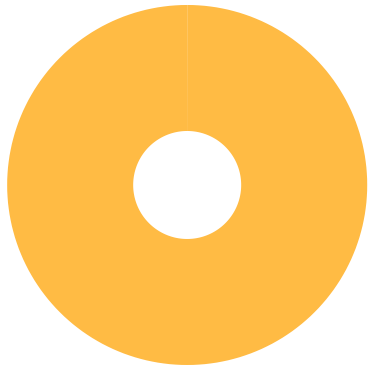
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.099.974,77	100,00%	1.244	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			**2.099.974,77**				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			**7.148,24**				Artigo 6º
PL Total			**2.107.123,01**				

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 (Agosto / 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%	2.099.974,77
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	2.099.974,77	100,00%	40,00%	75,00%	100,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	2.099.974,77
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	104.998,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	1.259.984,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.259.984,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	839.989,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	839.989,91
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	419.994,95
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	314.996,22
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	314.996,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	104.998,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	104.998,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	104.998,74
Total Renda Fixa	100,00%	2.099.974,77	100,00%	40,00%	89,00%	570,00%	



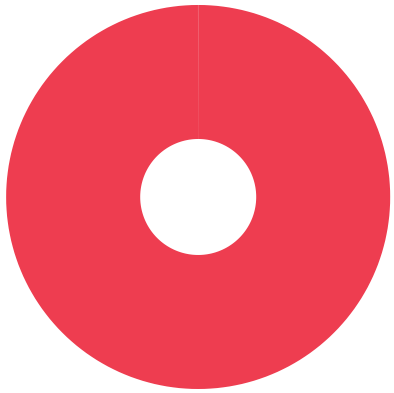
RENDA FIXA 2.099.974,77

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 (Agosto / 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%	629.992,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	629.992,43
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	419.994,95
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	209.997,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	104.998,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	104.998,74
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	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%	209.997,48
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	209.997,48
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	209.997,48
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	



7º I b

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 (Agosto / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.099.974,77	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 %		

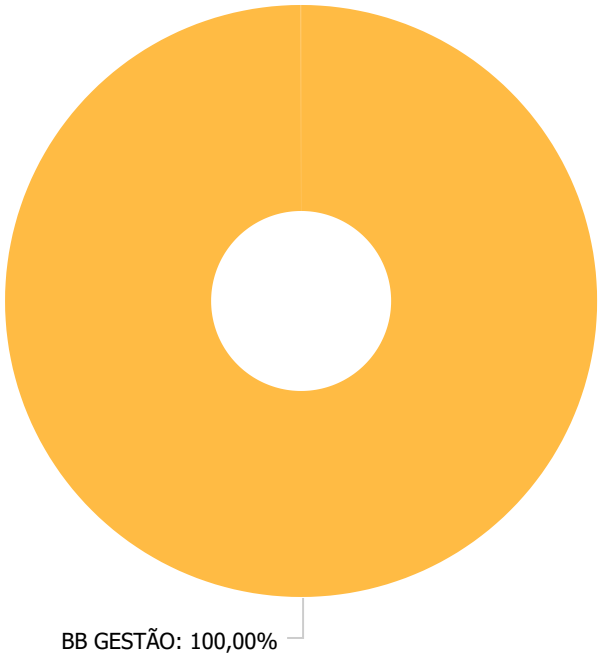
LEMA Economia & Finanças
Av. Santos Dumont, 3060 Sala 721, Ed. Casablanca, Aldeota - Fortaleza - CE
CEP: 60150-162 - Telefone: (85) 3085-8886

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	2,78%	0,58%	1,99%	4,77%	12,31%	0,00%	0,01%

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

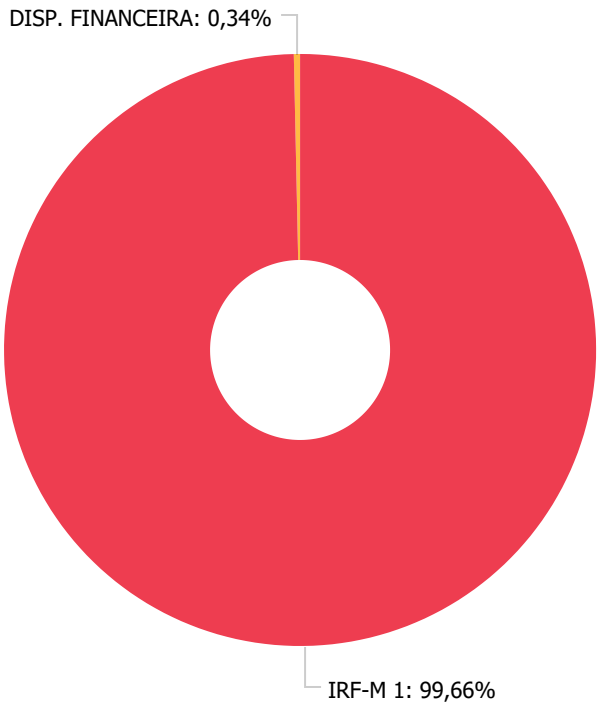
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2020)



BB GESTÃO	2.099.974,77

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 (Agosto / 2020)

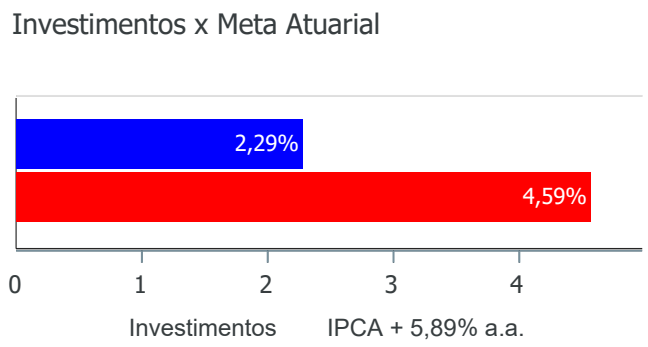


IRF-M 1	2.099.974,77
DISP. FINANCEIRA	7.148,24

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)

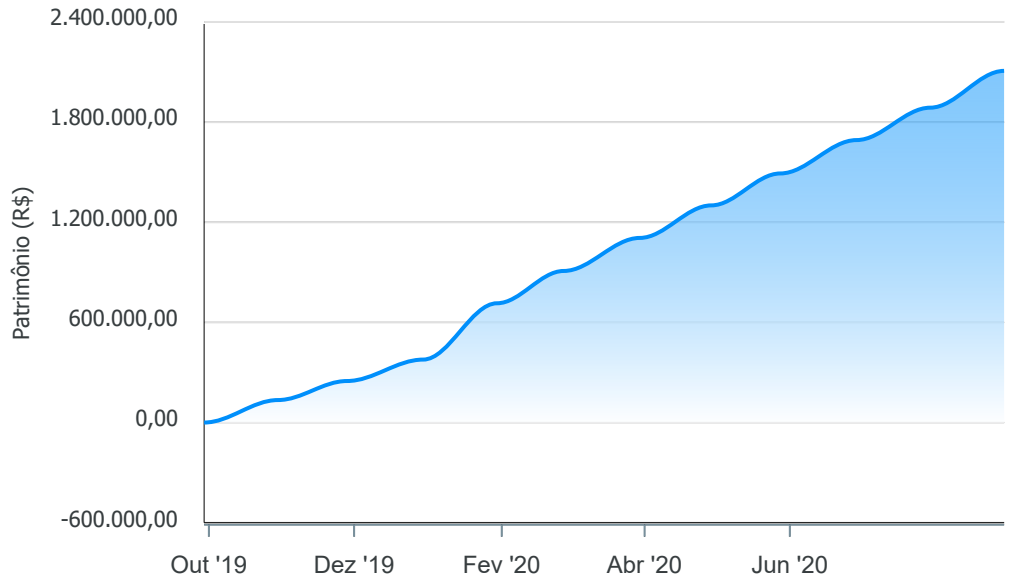
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	0,00	694.864,60	0,00	696.048,44	1.183,84	1.183,84	0,17%	0,17%	0,71%	0,71%	23,93%	0,09%
Fevereiro	696.048,44	0,00	0,00	698.505,08	2.456,64	3.640,48	0,35%	0,52%	0,66%	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%



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

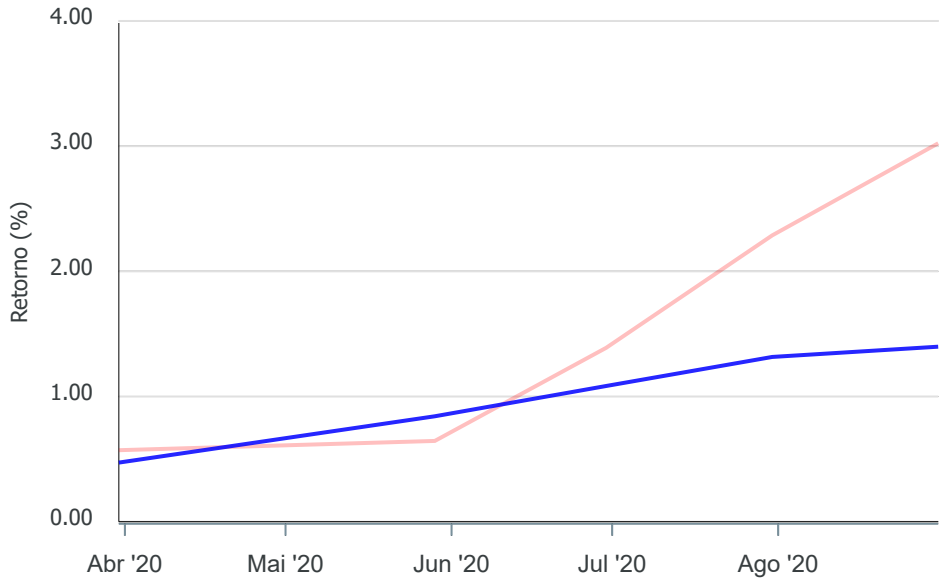
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.876.309,35	221.968,23	0,00	2.099.974,77	1.697,19	0,08%	0,09%	0,15%
Total Renda Fixa	**1.876.309,35**	**221.968,23**	**0,00**	**2.099.974,77**	**1.697,19**	**0,08%**		**0,15%**

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