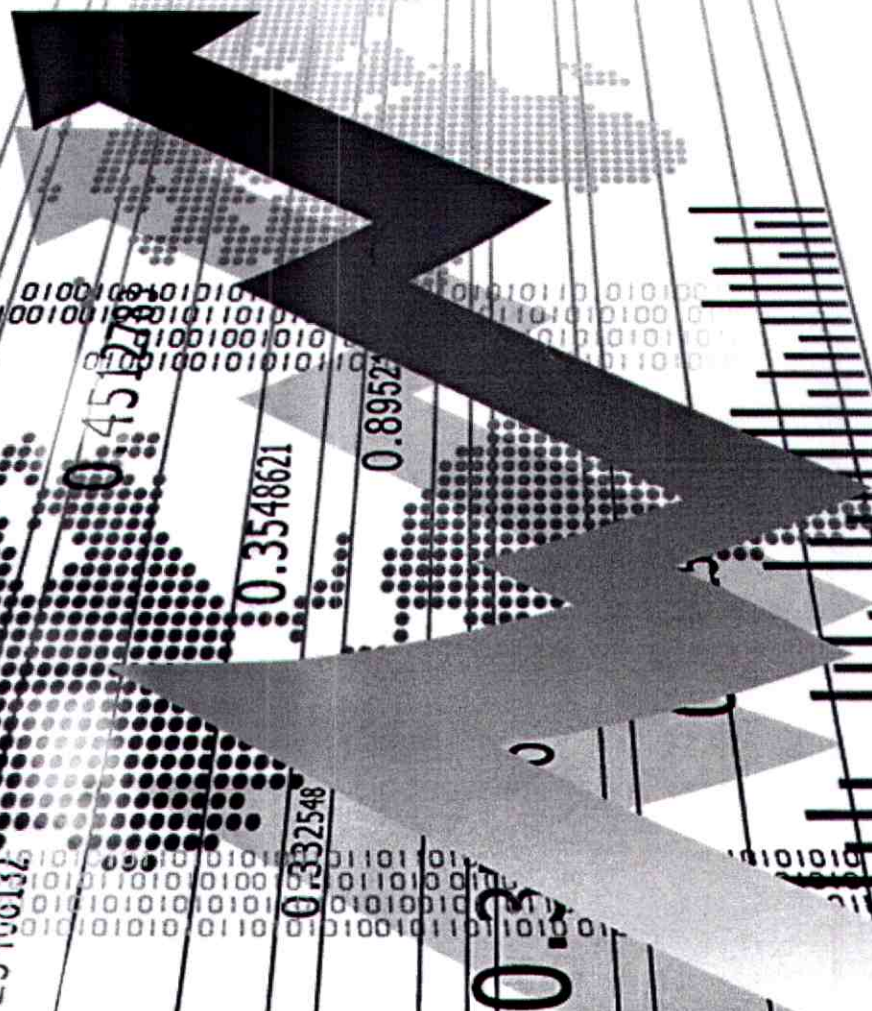


CREDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2021



0.25468132

0.451778

0.3548621

0.332548

0.8952

0.3

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

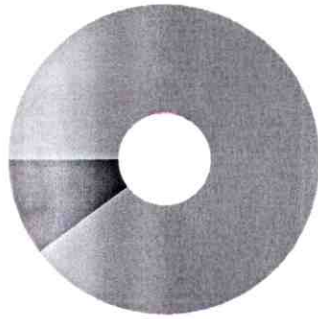
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDCA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	25.367.573,97	9,78%	946	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	226.889,61	0,09%	129	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.997.252,00	2,70%	677	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	9.008.878,88	3,47%	1.205	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	46.278.043,54	17,84%	917	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDCA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	40.146.604,76	15,48%	1.017	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	7.723.622,61	2,98%	217	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.148.693,53	5,84%	991	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	910.330,99	0,35%	315	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	15.863.515,23	6,11%	890	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.580.473,56	8,32%	1.345	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.168.738,37	0,45%	301	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	14.680.541,55	5,66%	526	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.864.284,12	0,72%	593	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.858.357,08	1,87%	111	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	21.022.554,79	8,10%	630	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	10.630.809,86	4,10%	2.011	0,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	8.736.412,96	3,37%	123	1,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	304.482,25	0,12%	43.573	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.902.668,55	2,66%	17.655	0,15%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução							
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			259.420.728,21				
			27.596,89				Artigo 6º
PL Total			259.448.325,10				

Política de Investimentos (RENTABILIDADE) e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Março / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	189.251.878,68	72,95%	11,00%	54,00%	90,00%	44.226.776,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	1.168.738,37	0,45%	0,00%	0,49%	1,00%	1.425.468,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	42.425.737,54	16,35%	4,00%	20,51%	40,00%	61.342.553,74
Total Renda Fixa	100,00%	232.846.354,59	89,76%	15,00%	75,00%	131,00%	

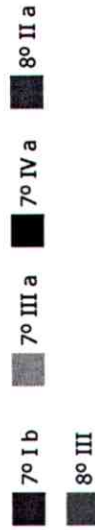
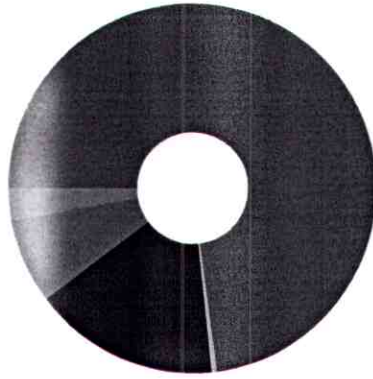


RENTA FIXA 232.846.354,59

RENTA VARIÁVEL 26.574.373,62

Resumo da Estratégia de Alocação - Base (Março / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	25.942.072,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	19.367.222,82	7,47%	4,00%	15,00%	20,00%	32.516.922,82
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.207.150,80	2,78%	2,00%	5,00%	10,00%	18.734.922,02
Total Renda Variável	30,00%	26.574.373,62	10,24%	6,00%	25,00%	40,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.971.036,41
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.971.036,41
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	

Investimentos em Ações - por Gestores - Base (Março / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	181.603.603,01	70,00	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	69.080.712,24	26,63	0,00
VINCI PARTNERS	8.736.412,96	3,37	0,01

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 %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	189.251.878,68	72,95	11,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	1.168.738,37	0,45	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'	42.425.737,54	16,35	4,00	40,00
Artigo 8º, Inciso I, Alinea 'a'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'a'	19.367.222,82	7,47	4,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	7.207.150,80	2,78	2,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00