

---

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
**PORTO NACIONAL / TO**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL  
DE  
INVESTIMENTOS**

**4º TRIMESTRE  
2021**

29 de janeiro de 2022



## ÍNDICE

<b>1 – INTRODUÇÃO .....</b>	<b>3</b>
<b>2 – POLÍTICA DE INVESTIMENTOS e MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA .....</b>	<b>4</b>
<b>3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO .....</b>	<b>5</b>
<b>4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA .....</b>	<b>12</b>
<b>5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS .....</b>	<b>22</b>
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	24
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	25
<b>6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO .....</b>	<b>26</b>
<b>7 – CONCLUSÃO .....</b>	<b>27</b>
7.1 - Rentabilidade da Carteira Trimestral .....	27
7.2 - Meta Atuarial .....	28
7.3 - Riscos .....	28
7.3.1 - Risco de Mercado .....	28
7.3.2 - Risco de Crédito .....	30
7.3.2.1 - Fundo de Investimento .....	30
7.3.2.2 - Instituição Financeira .....	30
7.3.3 - Risco de Liquidez .....	31
7.4 - Aderência ao PAI .....	32
7.4.1 - Perfil de Risco (Mercado) .....	32
7.4.2 - Risco de Crédito .....	33
7.4.3 - Risco de Liquidez .....	33
7.4.3.1 - Obrigações Previdenciárias - Curto Prazo .....	33
7.4.3.2 - Obrigações Previdenciárias - Médio e Longo Prazo .....	34



## 1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Trimestral dos investimentos, referente ao 4º TRIMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do PREVPORTO.

Este relatório vem atender o **Inciso V, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Trimestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

*Art. 3. V – Elaborar relatórios detalhados, no mínimo, trimestralmente, sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos dos RPPS e a aderência à política anual de investimentos e suas revisões e submetê-las as instâncias superiores de deliberação e controle.*



## 2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2021 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVPOR TO

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.695/2018	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.695/2018	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
<b>RENDA FIXA</b>								
1	Títulos Públicos	Art. 7º, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%		-	-
2	F.I. Refer. 100% em Títulos Públicos	Art. 7º, I, b (100%)	0,0%	77,7%	98,0%	57,9%	40.400.838,95	-
3	F.I. índice Mercado 100% em Títulos Público	Art. 7º, I, c (100%)	0,0%	0,0%	98,0%		-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7º, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
5	F.I. refer. em Indicadores RF	Art. 7º, III, a (60%)	0,0%	0,0%	40,0%		-	-
6	F.I. em índices de RF	Art. 7º, III, b (60%)	0,0%	0,0%	40,0%		-	-
7	F.I. referenciado em Indicadores RF	Art. 7º, IV, a (40%)	0,0%	9,1%	40,0%	12,3%	8.555.067,15	-
8	F.I. em índices de RF	Art. 7º, IV, b (40%)	0,0%	0,0%	40,0%		-	-
9	LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	Art. 7º, V, b (20%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
10	CDB	Art. 7º, VI, a (15%)	0,0%	0,0%	13,0%		-	-
11	Poupança	Art. 7º, VI, b (15%)	0,0%	0,0%	2,0%		-	-
12	FIDC - Cota Sênior	Art. 7º, VII, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
13	F.I. em Crédito Privado	Art. 7º, VII, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
14	F.I. em Debêntures	Art. 7º, VII, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
15	<b>TOTAL - RENDA FIXA</b>					<b>70,1%</b>	<b>48.955.906,10</b>	
<b>RENDA VARIÁVEL</b>								
16	F.I. em índices de RV (mín. 50 ações)	Art. 8º, I, a (30%)	0,0%	3,8%	14,0%	3,0%	2.110.511,25	-
17	F.I. em índices de Mercado RV (m. 50 ações)	Art. 8º, I, b (30%)	0,0%	0,0%	10,0%		-	-
18	F.I. em ações	Art. 8º, II, a (20%)	0,0%	3,2%	13,0%	10,0%	6.982.215,83	-
19	F.I. em índices de Mercado RV	Art. 8º, II, b (20%)	0,0%	0,0%	10,0%		-	-
20	F.I. Multimercados	Art. 8º, III (10%)	0,0%	3,7%	10,0%	8,0%	5.593.407,69	-
21	F.I. em Participações	Art. 8º, IV, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
22	F.I. Imobiliário negociado em bolsa	Art. 8º, IV, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
23	F.I.C Ações - Mercado de Acesso	Art. 8º, IV, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%		-	-
24	<b>TOTAL - RENDA VARIÁVEL</b>	Art. 8º, § 1 (30%)				<b>21,0%</b>	<b>14.686.134,77</b>	
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>								
25	F.I.C em Dívida Externa	Art. 9º A, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%		-	-
26	F.I.C em Investimento no Exterior	Art. 9º A, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	1,5%	1.029.594,42	-
27	F.I. Ações - BDR Nível I	Art. 9º A, III (10%)	0,0%	2,5%	10,0%	7,2%	5.054.563,85	-
28	<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	Art. 9º A (10%)				<b>8,7%</b>	<b>6.084.158,27</b>	
29	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
30	CONTA CORRENTE	-				0,1%	61.362,87	
31	<b>PATRIMÔNIO TOTAL</b>					<b>100,0%</b>	<b>69.787.562,01</b>	<b>4</b>

### 3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI
<b>CNPJ</b>	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	03.543.447/0001-03
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Renda Fixa	Renda Fixa índices	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa Índices
<b>ÍNDICE</b>	CDI	IRF – M 1	IDKA 2	IMA - B 5
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>GESTOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>CUSTODIANTE</b>	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001-91
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
<b>AUDITORIA</b>	KPMG Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	KPMG Auditores independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	17/12/1999
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,10% a.a.	0,20% a.a.	0,20%a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1.000,00	1.000,00	10.000,00	1.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0,01</b>	<b>Qualquer valor</b>	<b>Qualquer valor</b>	<b>0,01</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	2 - Baixo	2 - Baixo	1 - Muito baixo	4 - Alto
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a (40% e 20% por fundo)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)

\* Definição de Instituição financeira. Quanto mais próximo de F, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FI LP	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI
<b>CNPJ</b>	35.292.588/0001-89	07.111.384/0001-69	10.418.362/0001-50	09.005.805/0001-00
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Variável</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Renda Fixa índices	Fundo Multimercado	Ações IBOVESPA Ativo
<b>ÍNDICE</b>	IPCA	IRF – M	Multimercado	IBOV
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regime Próprio de Previdência Social	Investidores
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>GESTOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>CUSTODIANTE</b>	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	Banco do Brasil S.A.
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001-91
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
<b>AUDITORIA</b>	KPMG Auditores Independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	16/03/2020	08/12/2004	02/03/2009	02/10/2007
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,50% a.a.	0,20% a.a.	0,60% a.a.	2,00% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	10.000,00	10.000,00	10.000,00	Qualquer valor
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>1.000,00</b>	<b>Qualquer valor</b>	<b>0,00</b>	<b>Qualquer valor</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	1.000,00	Qualquer valor	0,00	Qualquer valor
<b>SALDO MÍNIMO</b>	1.000,00	Qualquer valor	0,00	Qualquer valor
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	3 - Médio	4 - Alto	4 - Alto	5 - Muito Alto
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III (10%)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)

\* Definição de Instituição financeira. Quanto mais próximo de F, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	BB AÇÕES AGRO FIC FI
CNPJ	22.632.237/0001-28	05.100.213/0001-09	39.272.865/0001-42	40.054.357/0001-77
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Variável	Investimento no Exterior	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Ações Livre	Ações Livre	Fundo de Ações	Fundo de Ações
ÍNDICE	IBOV	IBOV	BDRX	IBOV
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas e jurídicas	Pessoas físicas e jurídicas	Pessoas físicas e jurídicas e Regimes Próprios de	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001.91	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	BANCO DO BRASIL S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
CNPJ	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
AUDITORIA	KPMG Auditores independentes	KPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	29/12/2015	22/07/2002	30/11/2020	11/02/2021
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,90% a.a.	3,00% a.a.	0,85% a.a.	1,00% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	20% IBOV
APLICAÇÃO INICIAL	200,00	200,00	0,01	0,01
APLICAÇÕES ADICIONAIS	<b>200,00</b>	<b>200,00</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>
RESGATE MÍNIMO	200,00	200,00	0,01	0,01
SALDO MÍNIMO	200,00	200,00	0,01	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto	4 - Alto	4 - Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º A, III (10%)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º A, III (10%)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)

\* Definição de Instituição financeira. Quanto mais próximo de 5, maior o risco de mercado.



INFORMAÇÕES	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP
<b>CNPJ</b>	06.015.368/0001-00	03.737.206/0001-97	10.740.670/0001-06	14.386.926/0001-71
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Multimercados Juros e Moedas	Referenciado – DI	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices
<b>ÍNDICE</b>	CDI	CDI	IRF – M 1	IDKA 2
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	VITER-Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>CUSTODIANTE</b>	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	KPMG Auditores Independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes	kPMG Auditores independentes	kPMG Auditores independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	29/06/2006	05/07/2006	28/05/2010	16/08/2012
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,50% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	20% DI	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	0,01	50.000,00	1.000,00	1.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0,01</b>	<b>1.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,01	1.000,00	0,00	0,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,01	1.000,00	0,00	0,00
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	3 - Médio	2 - Baixo	2 - Baixo	3 - Médio
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III (10%)	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a (40% e 20% por fundo)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)

\* Definição de Instituição financeira. Quanto mais próximo de F, maior o risco de mercado.



INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP
<b>CNPJ</b>	11.060.913/0001-10	23.215.097/0001-55	14.508.605/0001-00	10.577.503/0001-88
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Duração Livre Soberano	Renda Fixa Índices	Renda Fixa Índices
<b>ÍNDICE</b>	IMA - B 5	IPCA	IRF – M	IMA – B 5 +
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Investidores Qualificados
<b>ADMINISTRADOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>CUSTODIANTE</b>	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	kPMG Auditores independentes	PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes S/S	Ernst & Young Terco Auditores Independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	09/07/2010	04/11/2016	16/08/2012	18/04/2012
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,40% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1.000,00	R\$ 1.000,00	1.000,00	1.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>Qualquer valor</b>	<b>Qualquer valor</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,00	0,00	Qualquer valor	Qualquer valor
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,00	0,00	Qualquer valor	Qualquer valor
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	2 - Baixo	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	Fi Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	Fi Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	Fi Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	Fi Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)

\* Definição de Instituição financeira. Quanto mais próximo de F, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO
<b>CNPJ</b>	10.740.658/0001-93	30.036.235/0001-02	15.154.236/0001-50	30.068.169/0001-44
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Variável</b>	<b>Renda Variável</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Renda Fixa Índices	Multimercados Dinâmico	Ações	Ações
<b>ÍNDICE</b>	IMA – B	S&P500	IBOV	IBOV
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Público em Geral	Regime Próprio de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>CUSTODIANTE</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	kPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	08/03/2010	16/10/2018	27/11/2012	31/07/2019
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,80% a.a.	0,50% a.a.	2,00% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1.000,00	10.000,00	10.000,00	50.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0,00</b>	<b>1.000,00</b>	<b>1.000,00</b>	<b>25.000,00</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,00	1.000,00	1.000,00	25.000,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,00	5.000,00	5.000,00	50.000,00
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+13 (Treze dias úteis após a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	3 - Médio	4 - Alto	5 - Muito Alto	4 - Alto
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III (10%)	FI em índices de RV - Art. 8º, I, a (30%, 20% por fundo)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)

\* Definição de Instituição financeira. Quanto mais próximo de 5, maior o risco de mercado.



INFORMAÇÕES	FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	
<b>CNPJ</b>	30.068.224/0001-04	39.528.038/0001-77	17.502.937/0001-68	
<b>SEGMENTO</b>	Renda Variável	Renda Variável	Investimento no Exterior	
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	AÇÕES LIVRE	Multimercado Investimento no Exterior	Ações Livre	
<b>ÍNDICE</b>	IBOV	Multimercado	BDR	
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Investidores em Geral	Regimes Próprio de Previdência Social	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de	
<b>ADMINISTRADOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	
<b>GESTOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	
<b>CUSTODIANTE</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	
<b>AUDITORIA</b>	KPMG Auditores Independentes	0	KPMG Auditores Independentes	
<b>DATA DE INÍCIO</b>	25/06/2019	11/11/2020	24/06/2013	
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	1,50% a.a.	1,00% a.a.	0,70% a.a.	
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	50.000,00	25.000,00	1.000,00	
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>1.000,00</b>	<b>0</b>	<b>100,00</b>	
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	1.000,00	0,00	100,00	
<b>SALDO MÍNIMO</b>	1.000,00	0	500,00	
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não se aplica	Não possui	
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+25 (Vinte e cinco dias úteis após a solicitação)	D+7 (Sete dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	4 - Alto	Não Disponibilizado pela Instituição	4 - Alto	
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	FIC - Aberto - Investimento no Exterior, Art. 9º A, II (10%)	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º A, III	

\* Definição de Instituição financeira. Quanto mais próximo de F, maior o risco de mercado.

#### 4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	4.667.497,19	-	-	23.469,76	4.690.966,95	0,500%
NOVEMBRO	4.690.966,95	-	-	29.194,30	4.720.161,25	0,619%
DEZEMBRO	4.720.161,25	-	-	35.613,21	4.755.774,46	0,749%

FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	4.124.577,04	-	-	27.272,94	4.097.304,10	-0,666%
NOVEMBRO	4.097.304,10	-	-	37.118,98	4.134.423,08	0,898%
DEZEMBRO	4.134.423,08	-	-	34.137,35	4.168.560,43	0,819%

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	8.519.753,25	-	-	110.096,54	8.409.656,71	-1,309%
NOVEMBRO	8.409.656,71	-	-	203.192,09	8.612.848,80	2,359%
DEZEMBRO	8.612.848,80	-	-	61.987,63	8.674.836,43	0,715%



FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP							
4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
OUTUBRO	4.849.247,18	-	-	124.220,19	4.725.026,99	-2,629%	
NOVEMBRO	4.725.026,99	-	-	162.506,72	4.887.533,71	3,325%	
DEZEMBRO	4.887.533,71	-	-	10.231,73	4.897.765,44	0,209%	

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP							
5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
OUTUBRO	7.922.138,60	-	-	98.554,67	7.823.583,93	-1,260%	
NOVEMBRO	7.823.583,93	-	-	193.070,34	8.016.654,27	2,408%	
DEZEMBRO	8.016.654,27	-	-	61.522,66	8.078.176,93	0,762%	

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP							
6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
OUTUBRO	1.998.665,89	-	-	79.550,48	1.919.115,41	-4,145%	
NOVEMBRO	1.919.115,41	-	-	83.548,36	2.002.663,77	4,172%	
DEZEMBRO	2.002.663,77	-	-	6.846,30	1.995.817,47	-0,343%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP							
7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
OUTUBRO	1.024.965,17	-	-	27.066,74	997.898,43	-2,712%	
NOVEMBRO	997.898,43	-	-	18.013,20	1.015.911,63	1,773%	
DEZEMBRO	1.015.911,63	-	-	19.010,06	1.034.921,69	1,837%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF							
8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
OUTUBRO	223.701,31	-	220.000,00	947,03	2.754,28	-34,384%	
NOVEMBRO	2.754,28	-	-	21,49	2.775,77	0,774%	
DEZEMBRO	2.775,77	-	-	23,55	2.799,32	0,841%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF							
9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
OUTUBRO	55.836,97	-	40.000,00	253,42	15.583,55	-1,626%	
NOVEMBRO	15.583,55	-	13.000,00	99,07	2.682,62	3,693%	
DEZEMBRO	2.682,62	541.041,31	52.000,00	2.797,64	494.521,57	0,566%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF						
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	26,82	-	-	0,14	26,68	-0,525%
NOVEMBRO	26,68	-	-	0,21	26,89	0,781%
DEZEMBRO	26,89	660.388,56	250.000,00	3.709,93	414.125,38	0,896%





## 4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI						
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	3.960.039,56	-	-	50.481,03	3.909.558,53	-1,291%
NOVEMBRO	3.909.558,53	-	-	96.691,59	4.006.250,12	2,414%
DEZEMBRO	4.006.250,12	385.918,80	-	30.536,32	4.422.705,24	0,690%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	940.213,61	-	-	25.178,18	915.035,43	-2,752%
NOVEMBRO	915.035,43	-	-	16.484,32	931.519,75	1,770%
DEZEMBRO	931.519,75	-	-	17.481,93	949.001,68	1,842%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI						
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	2.094.067,52	-	-	10.862,81	2.083.204,71	-0,521%
NOVEMBRO	2.083.204,71	20.000,00	-	16.099,70	2.079.304,41	0,774%
DEZEMBRO	2.079.304,41	-	10.000,00	17.478,84	2.086.783,25	0,838%



**BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI**

14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	2.248.744,31	-	-	28.171,35	2.220.572,96	-1,269%
NOVEMBRO	2.220.572,96	-	-	53.941,74	2.274.514,70	2,372%
DEZEMBRO	2.274.514,70	-	-	16.062,67	2.290.577,37	0,701%

**BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI**

15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	877.980,14	-	-	7.869,00	870.111,14	-0,904%
NOVEMBRO	870.111,14	-	-	13.410,82	883.521,96	1,518%
DEZEMBRO	883.521,96	-	-	6.724,79	890.246,75	0,755%

**BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI**

16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	1.793.018,94	500.000,00	-	9.247,23	2.302.266,17	0,402%
NOVEMBRO	2.302.266,17	159.950,00	-	15.167,83	2.477.384,00	0,612%
DEZEMBRO	2.477.384,00	1.300.000,00	-	21.908,69	3.799.292,69	0,577%

### 4.3 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - RENDA VARIÁVEL

#### BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI

17	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	1.616.508,19	-	-	94.254,57	1.522.253,62	-5,831%
NOVEMBRO	1.522.253,62	-	-	79.974,83	1.442.278,79	-5,254%
DEZEMBRO	1.442.278,79	-	-	117.538,98	1.559.817,77	8,150%

#### BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I

18	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	3.129.855,13	-	-	330.612,19	3.460.467,32	10,563%
NOVEMBRO	3.460.467,32	-	-	47.159,17	3.413.308,15	-1,363%
DEZEMBRO	3.413.308,15	-	500.000,00	104.272,48	3.017.580,63	-26,242%

#### FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA

19	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	2.231.054,36	-	-	150.082,11	2.080.972,25	-6,727%
NOVEMBRO	2.080.972,25	-	-	30.075,80	2.050.896,45	-1,445%
DEZEMBRO	2.050.896,45	-	-	59.614,80	2.110.511,25	2,907%

### FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO

20	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	2.058.366,97	-	-	124.015,42	1.934.351,55	-6,025%
NOVEMBRO	1.934.351,55	-	-	10.123,83	1.924.227,72	-0,523%
DEZEMBRO	1.924.227,72	-	-	111.239,95	2.035.467,67	5,781%

### FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP

21	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	3.911.261,37	450.000,00	-	303.549,11	4.664.810,48	7,761%
NOVEMBRO	4.664.810,48	-	-	22.856,37	4.641.954,11	-0,490%
DEZEMBRO	4.641.954,11	-	-	258.162,79	4.900.116,90	5,562%

### FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR

22	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	574.772,66	-	-	58.226,29	516.546,37	-10,130%
NOVEMBRO	516.546,37	-	-	12.242,59	504.303,78	-2,370%
DEZEMBRO	504.303,78	-	-	11.045,49	515.349,27	2,190%

### BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I

23	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	877.139,11	-	-	23.046,46	900.185,57	2,627%
NOVEMBRO	900.185,57	-	-	35.495,26	864.690,31	-3,943%
DEZEMBRO	864.690,31	-	-	15.367,71	880.058,02	1,777%

### FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR

24	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	989.209,70	-	-	74.771,60	1.063.981,30	7,559%
NOVEMBRO	1.063.981,30	-	-	19.187,77	1.044.793,53	-1,803%
DEZEMBRO	1.044.793,53	-	-	15.199,11	1.029.594,42	-1,455%

### BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI

25	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	1.666.440,25	-	-	141.604,66	1.524.835,59	-8,497%
NOVEMBRO	1.524.835,59	-	-	49.664,78	1.475.170,81	-3,257%
DEZEMBRO	1.475.170,81	-	-	22.179,44	1.497.350,25	1,504%

### FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

26	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	1.034.713,04	-	-	113.082,17	1.147.795,21	10,929%
NOVEMBRO	1.147.795,21	-	-	10.239,07	1.137.556,14	-0,892%
DEZEMBRO	1.137.556,14	-	-	19.369,06	1.156.925,20	1,703%

### BB AÇÕES AGRO FIC FI

27	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
OUTUBRO	664.349,05	-	-	34.385,80	629.963,25	-5,176%
NOVEMBRO	629.963,25	-	-	13.054,17	616.909,08	-2,072%
DEZEMBRO	616.909,08	700.000,00	-	57.321,79	1.374.230,87	9,292%



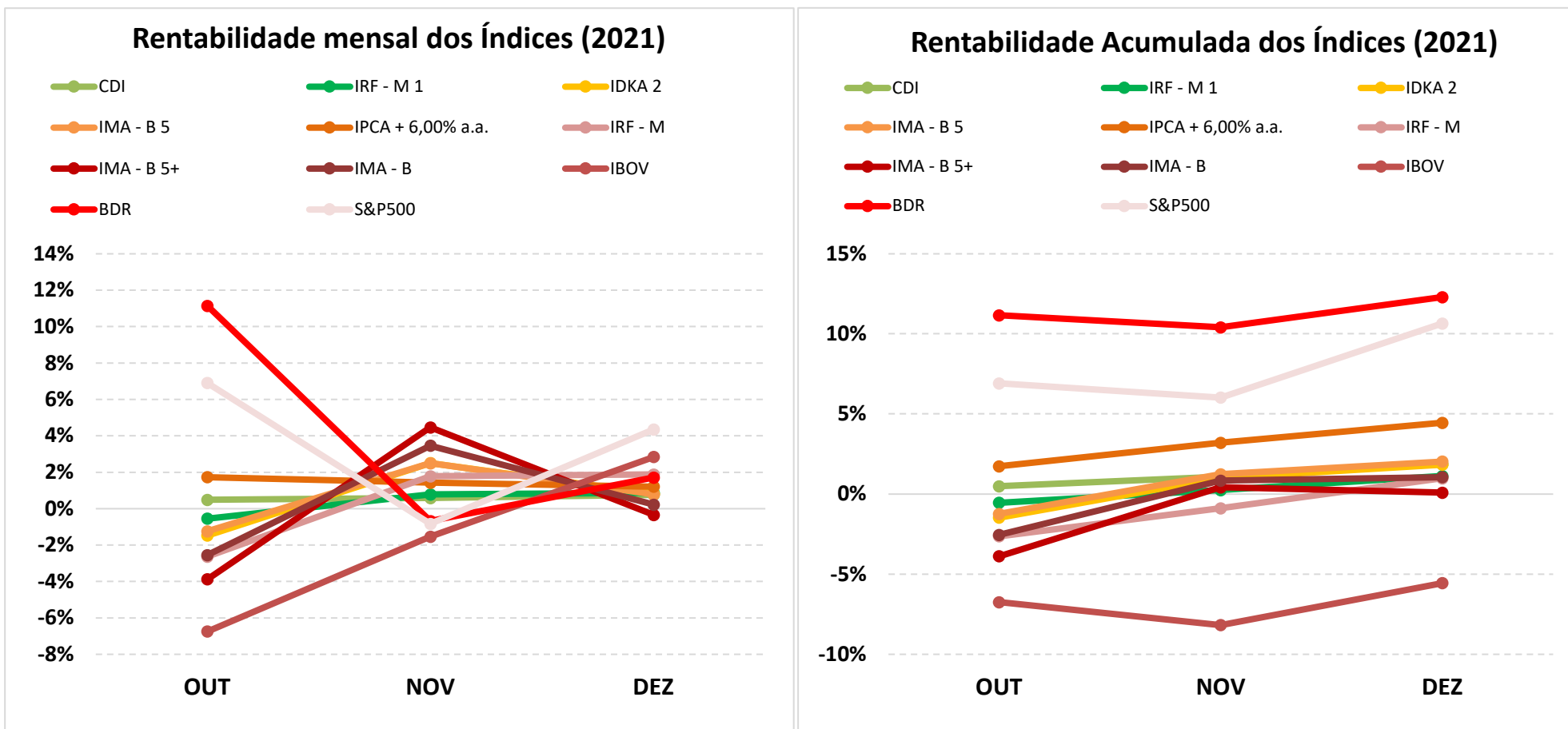
## 5-TABELA DE RENTABILIDADE

INVESTIMENTOS	OUT	NOV	DEZ	ACUMULADO
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,49%	0,63%	0,80%	<b>1,93%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	-0,52%	0,77%	0,84%	<b>1,09%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	-1,25%	2,43%	0,71%	<b>1,87%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	-1,27%	2,47%	0,76%	<b>1,94%</b>
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	-0,90%	1,54%	0,76%	<b>1,39%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	-2,68%	1,80%	1,88%	<b>0,93%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FI LP	0,20%	0,54%	1,17%	<b>1,92%</b>
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	-8,50%	-3,26%	1,50%	<b>-10,15%</b>
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	10,56%	-1,36%	2,90%	<b>12,22%</b>
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-5,83%	-5,25%	8,15%	<b>-3,50%</b>
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	2,63%	-3,94%	1,78%	<b>0,34%</b>
BB AÇÕES AGRO FIC FI	-5,18%	-2,07%	7,23%	<b>-0,43%</b>
BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	0,38%	0,69%	0,73%	<b>1,81%</b>
FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	0,50%	0,62%	0,75%	<b>1,88%</b>
FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	-0,54%	0,78%	0,85%	<b>1,09%</b>
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	-1,29%	2,42%	0,72%	<b>1,83%</b>
FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	-1,24%	2,47%	0,77%	<b>1,98%</b>
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	-0,66%	0,91%	0,83%	<b>1,07%</b>
FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	-2,64%	1,81%	1,87%	<b>0,98%</b>
FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	-3,98%	4,35%	-0,34%	<b>-0,14%</b>
FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	-2,56%	3,44%	0,21%	<b>1,00%</b>
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	7,64%	-0,49%	5,56%	<b>13,07%</b>
FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-6,73%	-1,45%	2,91%	<b>-5,41%</b>
FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	-6,02%	-0,52%	5,78%	<b>-1,10%</b>
FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	-10,13%	-2,37%	2,19%	<b>-10,34%</b>
FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR	7,56%	-1,80%	-1,45%	<b>0,00%</b>
<b>CDI</b>	<b>0,49%</b>	<b>0,59%</b>	<b>0,77%</b>	<b>1,86%</b>
<b>IRF - M 1</b>	<b>-0,54%</b>	<b>0,79%</b>	<b>0,88%</b>	<b>1,13%</b>
<b>IDKA 2</b>	<b>-1,47%</b>	<b>2,51%</b>	<b>0,83%</b>	<b>1,84%</b>
<b>IMA - B 5</b>	<b>-1,24%</b>	<b>2,50%</b>	<b>0,79%</b>	<b>2,03%</b>
<b>IPCA + 6.00% a.a.</b>	<b>1,74%</b>	<b>1,44%</b>	<b>1,22%</b>	<b>4,45%</b>
<b>IRF - M</b>	<b>-2,63%</b>	<b>1,79%</b>	<b>1,89%</b>	<b>0,98%</b>
<b>IMA - B 5+</b>	<b>-3,87%</b>	<b>4,47%</b>	<b>-0,34%</b>	<b>0,09%</b>
<b>IMA - B</b>	<b>-2,54%</b>	<b>3,47%</b>	<b>0,22%</b>	<b>1,06%</b>
<b>IBOV</b>	<b>-6,74%</b>	<b>-1,53%</b>	<b>2,85%</b>	<b>-5,55%</b>
<b>BDR</b>	<b>11,15%</b>	<b>-0,67%</b>	<b>1,71%</b>	<b>12,29%</b>
<b>S&amp;P500</b>	<b>6,91%</b>	<b>-0,83%</b>	<b>4,36%</b>	<b>10,65%</b>





## GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES



## 5.1-MELHOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	OUT	NOV	DEZ
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	7,64%	-0,49%	5,56%

### COMPORTAMENTO ACUMULADO

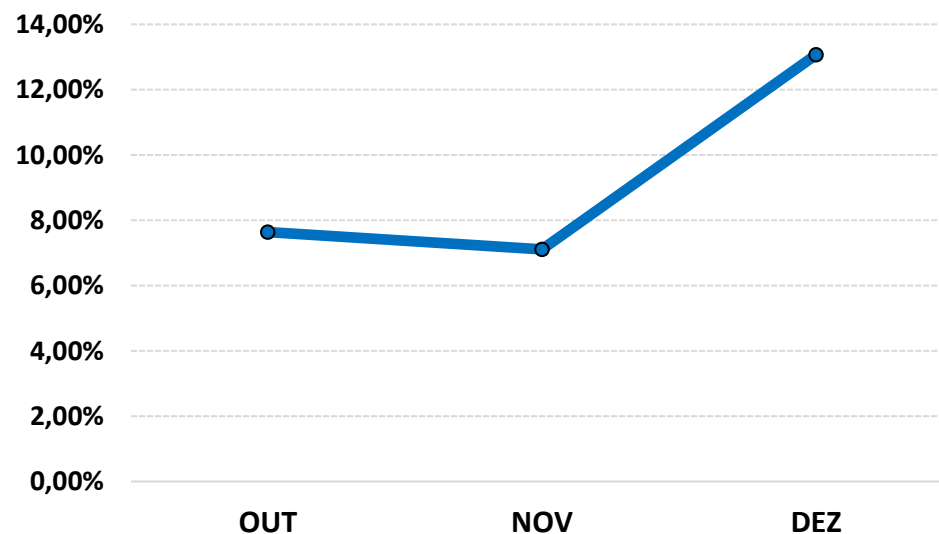
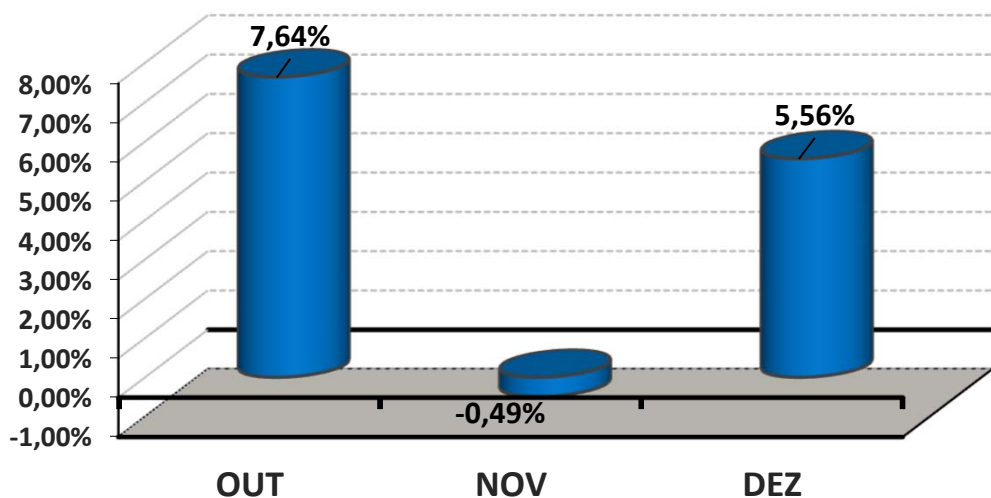
FUNDO DE INVESTIMENTO	OUT	NOV	DEZ
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	7,64%	7,11%	13,07%

Comportamento MENSAL no Trimestre

Comportamento ACUMULADO no Trimestre

■ FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP

● FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP



## 5.2-PIOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

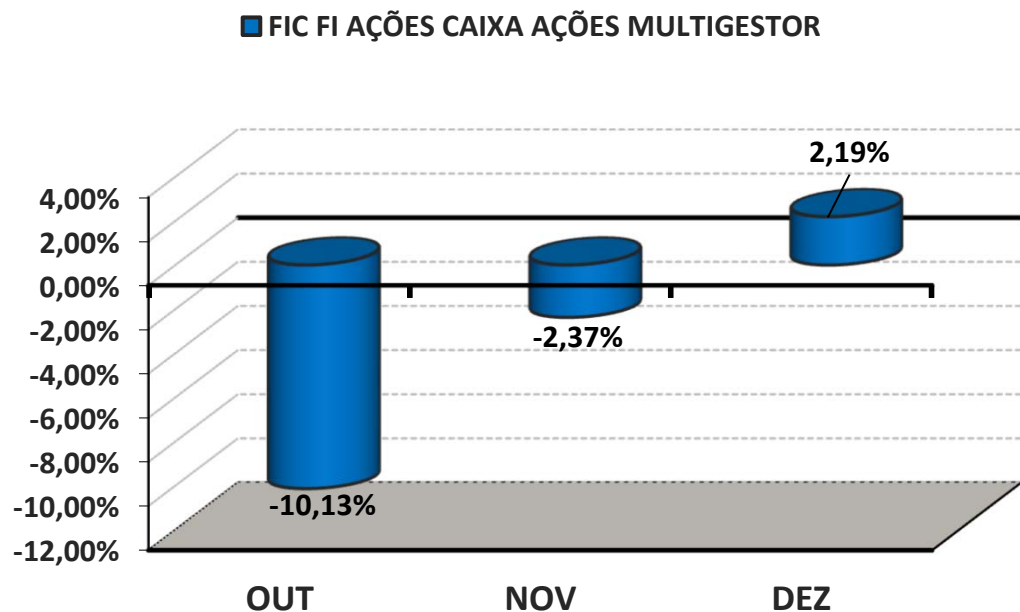
### COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	OUT	NOV	DEZ
FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	-10,13%	-2,37%	2,19%

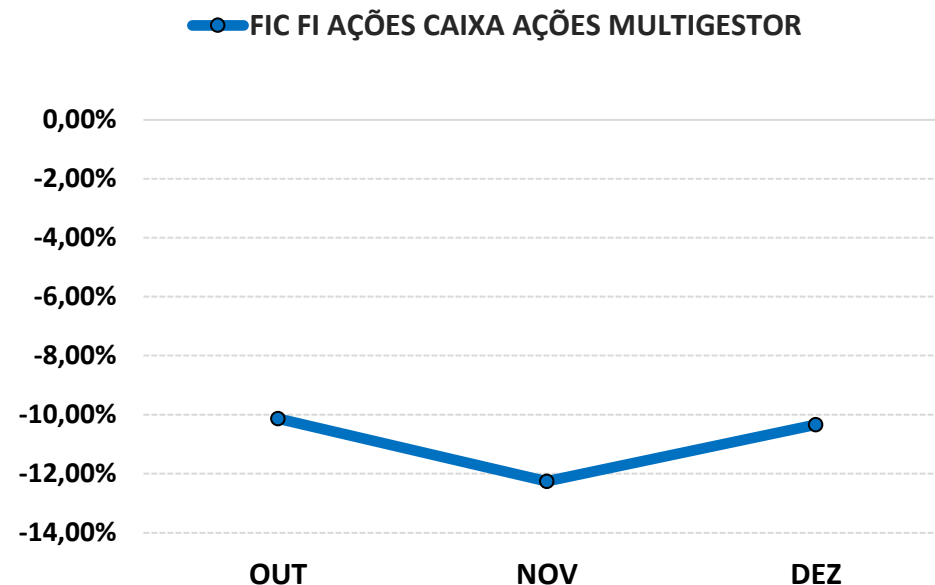
### COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	OUT	NOV	DEZ
FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	-10,13%	-12,26%	-10,34%

Comportamento MENSAL no Trimestre



Comportamento ACUMULADO no Trimestre



## 6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 4º TRIMESTRE - 2021

	OUT	NOV	DEZ
MENSAL	-0,49%	0,94%	1,67%
CDI	0,49%	0,59%	0,77%
IBOVESPA	-6,74%	-1,53%	2,85%
META ATUARIAL	1,69%	1,39%	1,17%

	OUT	NOV	DEZ
ACUMULADO DO TRIMESTRE	-0,49%	0,45%	2,12%
CDI	0,49%	1,08%	1,86%
IBOVESPA	-6,74%	-8,17%	-5,55%
META ATUARIAL	1,69%	3,11%	4,32%

RENTABILIDADE ACUMULADA DO TRIMESTRE DO PREVPOR TO: R\$ 1.393.838,34

META ATUARIAL ACUMULADA DO TRIMESTRE: R\$ 2.758.031,28

DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ (1.364.192,94)



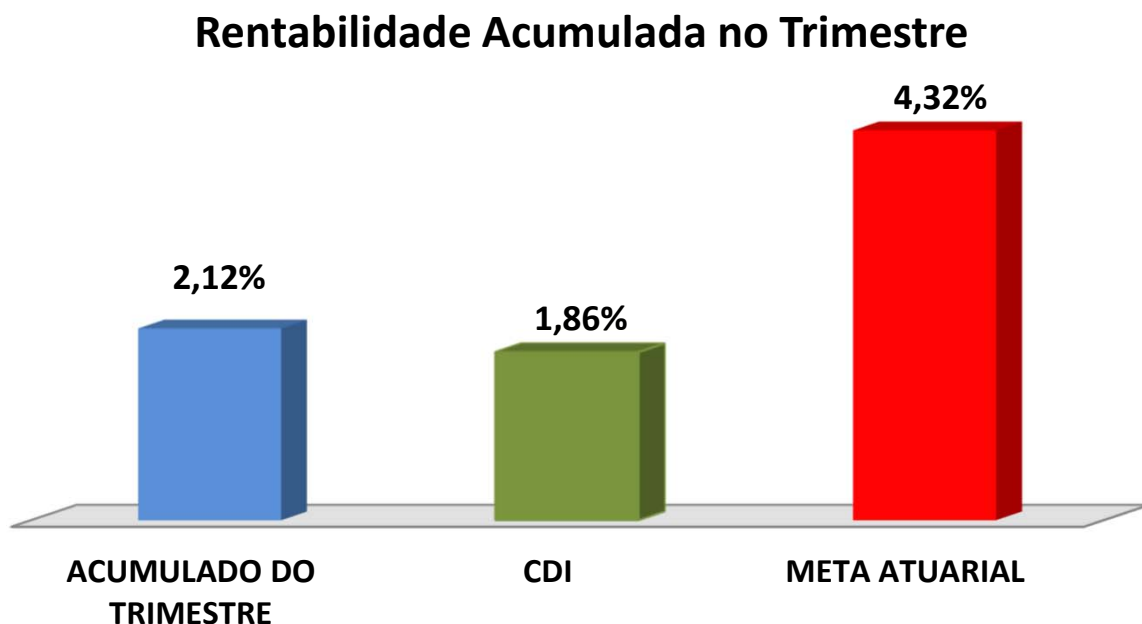
## 7-CONCLUSÃO

Atendendo o Art. 3, V, da Portaria MPS 519, detalhado na página 3 deste relatório, segue abaixo uma análise da Carteira de Investimento do PREVPORTO, no 4º Trimestre/2021, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2021.

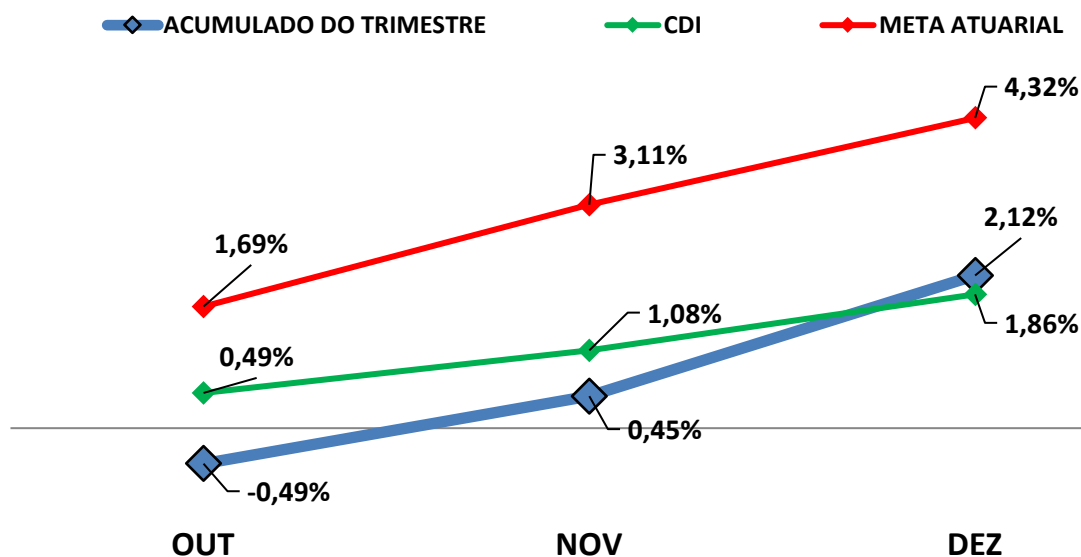
### 7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA TRIMESTRAL

A Carteira de Investimentos do PREVPORTO, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no trimestre de 2,12% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no trimestre de 1,86% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de 114,11% sobre o índice de referência do mercado.

#### GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL



## Rentabilidade Acumulada no Trimestre



### 7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no trimestre do PREVPORTO é de 2,12% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 4,32%, representando 49,20% sobre a Meta Atuarial.

### 7.3-RISCOS

#### 7.3.1-RISCO DE MERCADO

É o risco de oscilações de preços dos ativos conforme o cenário macroeconômico. Este risco é voltado para a volatilidade dos papéis, sobretudo de Renda Fixa (Títulos Públicos e fundos atrelados à inflação) e Renda Variável (ações, dólar e etc..)."



Conforme a tabela abaixo, PREVPOR TO aplica em alguns Fundos de Investimentos sensíveis às oscilações de mercado, conforme a classificação de Risco de Mercado, disponibilizado nas Lâminas de Informações Essenciais dos Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDOS DE INVESTIMENTO	RISCO DE MERCADO*
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2 - Baixo
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	2 - Baixo
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	1 - Muito baixo
4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	4 - Alto
5	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3 - Médio
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	4 - Alto
7	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FI LP	4 - Alto
8	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	5 - Muito Alto
9	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5 - Muito Alto
10	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	5 - Muito Alto
11	BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	4 - Alto
12	BB AÇÕES AGRO FIC FI	4 - Alto
13	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	3 - Médio
14	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	2 - Baixo
15	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	2 - Baixo
16	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	3 - Médio
17	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	2 - Baixo
18	FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3 - Médio
19	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	3 - Médio
20	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	3 - Médio
21	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	3 - Médio
22	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	4 - Alto
23	FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	5 - Muito Alto
24	FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	4 - Alto
25	FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	4 - Alto
26	FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR	Não Disponibilizado pela Instituição
27	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4 - Alto

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.



### 7.3.2-RISCO DE CRÉDITO

É a possibilidade do devedor não honrar seus compromissos. Nesse caso, investimentos que possuem risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating.

#### 7.3.2.1-FUNDO DE INVESTIMENTO

A maioria dos Fundos de Investimentos em Renda Fixa e Renda Variável que o PREVPORTO aplica, não necessitam de Análise de Rating. Entretanto, alguns fundos de Renda Variável possuem certa concentração de papéis privados em sua carteira de investimento que, por possuir risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating destes Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDO DE INVESTIMENTO	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	Não Precisa	Não Precisa
4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
5	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	Não Precisa	Não Precisa
7	BB PREVIDENCIÁRIO MULTIMERCADO FI LP	Não Precisa	Não Precisa
8	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
9	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Não Precisa	Não Precisa
10	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
11	AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	Não há	Não há
12	BB AÇÕES AGRO FIC FI	Não há	Não há
13	BB MULTIMERCADO LP JUROS E MOEDAS FIC FI	Não há	Não há
14	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	Não Precisa	Não Precisa
15	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	Fitch Rating	Forte
16	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	Fitch Rating	Forte
17	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	Fitch Rating	Forte
18	FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Fitch Rating	Forte
19	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	Fitch Rating	Forte
20	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	Fitch Rating	Forte
21	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	Fitch Rating	Forte
22	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	Não Precisa	Não Precisa
23	FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	Não há	Não há
24	FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	Não Precisa	Não Precisa
25	FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	Não Precisa	Não Precisa
26	FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIORES	Não Precisa	Não Precisa
27	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Fitch Rating	"Forte"

### 7.3.2.2-*INSTITUIÇÃO FINANCEIRA*

Todos os envolvidos na gestão do Fundo de Investimento, incluindo as Instituições Financeiras, o Administrador, o Gestor e o Distribuidor necessitam de Análise de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating dos envolvidos na gestão e distribuição dos Fundos de Investimentos.

Nº	INSTITUIÇÃO FINANCEIRA / ADMINISTRADOR / GESTOR / DISTRIBUIDOR	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	Fitch Ratings	AA(bra)
2	Caixa Econômica Federal	Fitch Ratings	AA(bra)

### 7.3.3-*RISCO DE LIQUIDEZ*

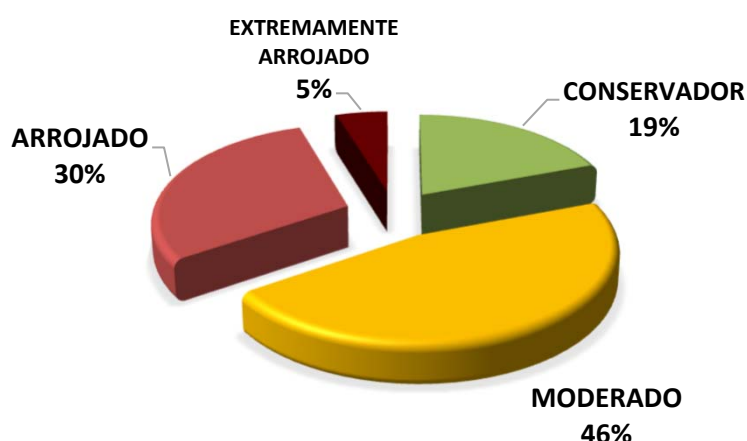
É o risco de o investidor não conseguir dar liquidez ao ativo financeiro (vender) ou conseguir liquidez abaixo do preço de mercado ou abaixo do preço de aquisição (compra).

O PREVPORTE não aplica em Fundos de Investimento Fechado e/ou Aberto com Carência, portanto, possui 100% de Disponibilidade Financeira (Resgate diário) não possuindo Risco de Liquidez no Curto Prazo.

## 7.4-ADERÊNCIA AO PAI

### 7.4.1-PERFIL DE RISCO (MERCADO)

#### PERFIL DOS INVESTIMENTOS



## PERFIL 6

MODERADO COM TENDÊNCIA  
ARROJADA

#### Descrição do Perfil de Investidor

##### Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

##### Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

#### Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO

O atual perfil de risco do PREVPORTO (PERFIL 6 - MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA), se encontra aderente ao Perfil de Risco proposto na Política Anual de Investimentos/2021.

#### *7.4.2-RISCO DE CRÉDITO*

A Política Anual de Investimentos/2021 do PREVPORTO, determina que fundos de investimentos e Instituições Financeiras que necessitem de Análise de Rating, só receberão recursos do PREVPORTO, caso sejam classificados, no mínimo, como BAIXO RISCO DE CRÉDITO (BBB).

As Análises de Ratings encontradas dos Fundos de Investimentos, assim como das Instituições Financeiras, dos Administradores, dos Gestores e dos Distribuidores dos fundos, se encontram aderentes à Política Anual de Investimentos/2021 do PREVPORTO.

#### *7.4.3-RISCO DE LIQUIDEZ*

##### *7.4.3.1-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - CURTO PRAZO*

Para resguardar o PREVPORTO e minimizar o risco de liquidez no Curto Prazo foi definido na Política de Investimentos/2021, uma Separação de Recursos Financeiros, no intuito de formalizar uma Provisão de Caixa.

Na Política Anual de Investimentos/2021 do PREVPORTO foi definido um valor de Provisão de Caixa de R\$ 3.980.011,51 Milhões de reais. Atualmente, a necessidade de Provisão de Caixa do PREVPORTO é de R\$ 306.154,73 e o Saldo financeiro da Provisão de Caixa do PREVPORTO está em R\$ 7.754.003,98 Milhões de reais.

As Obrigações Previdenciárias no Curto Prazo, ou seja, a necessidade financeira do PREVPORTO estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2021 e a sua capacidade financeira no Curto Prazo.

#### 7.4.3.2-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - MÉDIO e LONGO PRAZO

O PREVPORTO não possui Fundos de Investimento Aberto com Carência e Fundos de Investimentos de Condomínio Fechados na sua carteira de investimento, possuindo liquidez à qualquer momento de seus recursos financeiros.

De acordo com o Estudo de Duration do Fluxo de Caixa do Plano Previdenciário, informado na Política Anual de Investimentos/2021, o RPPS irá começar a consumir os seus recursos, à partir do ano de 2032.

As Obrigações Previdenciárias a Médio e Longo Prazo do PREVPORTO estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2021 e a sua capacidade e necessidade financeira a Médio e Longo prazo.

As análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 3.922/10**, alterada pela **Resolução CMN 4.695/2018**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

**É o Relatório.**



**Igor França Garcia**

Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA

Consultor de Investimentos credenciado pela CVM