

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

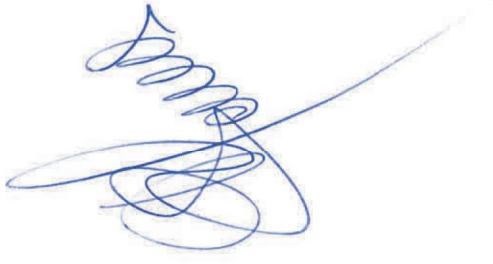
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	91.425.997,71	14,38%	549	1,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	81.464.454,91	12,81%	1.032	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	99.829.549,95	15,70%	787	1,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	12.095.739,83	1,90%	1.126	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	1.656.545,77	0,26%	140	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	20.286.108,22	3,19%	115	4,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.426.089,76	0,22%	165	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	59.942.611,88	9,43%	114	6,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.796.285,96	0,28%	941	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	59.092.171,91	9,29%	583	1,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.322.874,89	3,82%	821	0,78%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	16.612.552,59	2,61%	868	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	498.986,10	0,08%	881	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	8.113.150,14	1,28%	72	1,31%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	12.034.686,21	1,89%	47.255	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	23.097.992,03	3,63%	2.508	2,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB ENERGIA FI AÇÕES	D+3	Não há	16.958.971,70	2,67%	13.339	5,47%	Artigo 8º, Inciso I
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	13.615.307,38	2,14%	27.194	0,91%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL...	D+2 du	Não há	4.939.313,93	0,78%	3.345	5,78%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL...	D+2 du	Não há	7.310.283,39	1,15%	6.188	3,44%	Artigo 9º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	32.075.100,52	5,04%	146	1,53%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	3.034.570,58	0,48%	103	2,56%	Artigo 10º, Inciso I
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	20.114.826,35	3,16%	163.030	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	18.757.538,51	2,95%	49.084	0,82%	Artigo 10º, Inciso I
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	5.435.881,13	0,85%		0,22%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		6.296.156,21	0,99%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			635.937.591,35				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.296.156,21				Artigo 6º
PL Total			642.233.747,56				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

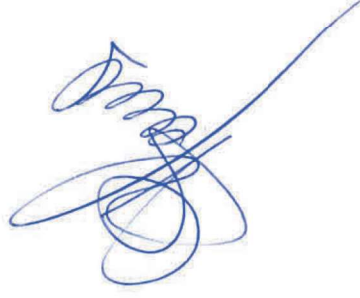


⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de 2022 não está cadastrada !!!



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	628.206.438,16	98,78	0,03
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.435.881,13	0,85	1,58
CAIXA DTVM	2.295.272,06	0,36	-

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 - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,10%	0,10%	2,87%	1,16%	1,16%	5,07%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,04%	2,70%	0,57%	0,19%	4,21%	1,02%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	3,16%	3,11%	4,47%	12,51%	1,06%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	0,61%	2,25%	2,43%	3,24%	6,41%	0,38%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,08%	0,08%	3,33%	3,12%	4,25%	11,85%	1,00%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	-	-	0,00%	-
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	0,79%	2,18%	3,74%	5,25%	7,57%	0,05%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	0,78%	2,23%	3,66%	5,27%	7,60%	0,02%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,03%	0,03%	3,59%	3,50%	4,00%	11,46%	1,11%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	0,39%	3,10%	3,83%	5,71%	12,72%	0,80%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	0,57%	2,91%	4,20%	6,88%	14,88%	0,92%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	0,56%	2,91%	4,19%	6,86%	12,96%	0,92%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	0,19%	2,51%	1,24%	1,20%	-	0,76%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

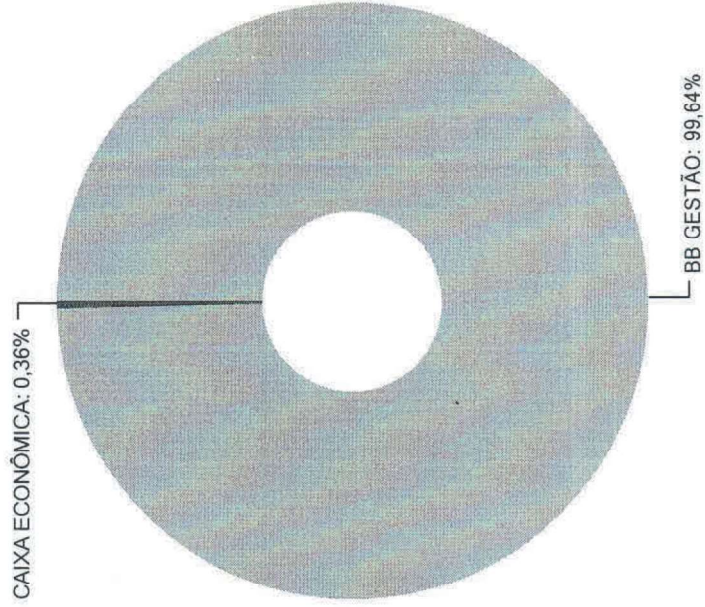
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IEE (Benchmark)	2,65%	2,65%	5,32%	0,23%	-0,76%	0,02%	-	-
BB ENERGIA FI AÇÕES	2,60%	2,60%	4,47%	-1,18%	-3,94%	-9,33%	8,61%	0,15%
S&P 500 (Benchmark)	-5,26%	-5,26%	-1,95%	2,74%	21,57%	39,99%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-5,41%	-5,41%	-0,96%	4,38%	23,74%	-	8,81%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,49%	6,49%	8,64%	-2,97%	5,03%	11,07%	8,38%	0,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,68%	3,68%	6,98%	-3,28%	4,59%	6,18%	6,86%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,32%	1,32%	2,02%	2,41%	3,59%	7,61%	0,62%	0,02%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,73%	0,73%	2,73%	1,75%	1,65%	-	1,13%	0,03%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,71%	0,71%	2,14%	3,45%	4,84%	8,96%	0,06%	0,01%
IFIX (Benchmark)	-0,99%	-0,99%	3,78%	-1,67%	-3,56%	-9,76%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI AC Asia ex Japan (Benchmark)	-6,99%	-6,99%	-10,57%	-2,53%	-14,65%	45,93%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I FIC AÇÕES	-2,28%	-2,28%	-4,47%	-3,26%	-12,45%	-	11,66%	0,12%

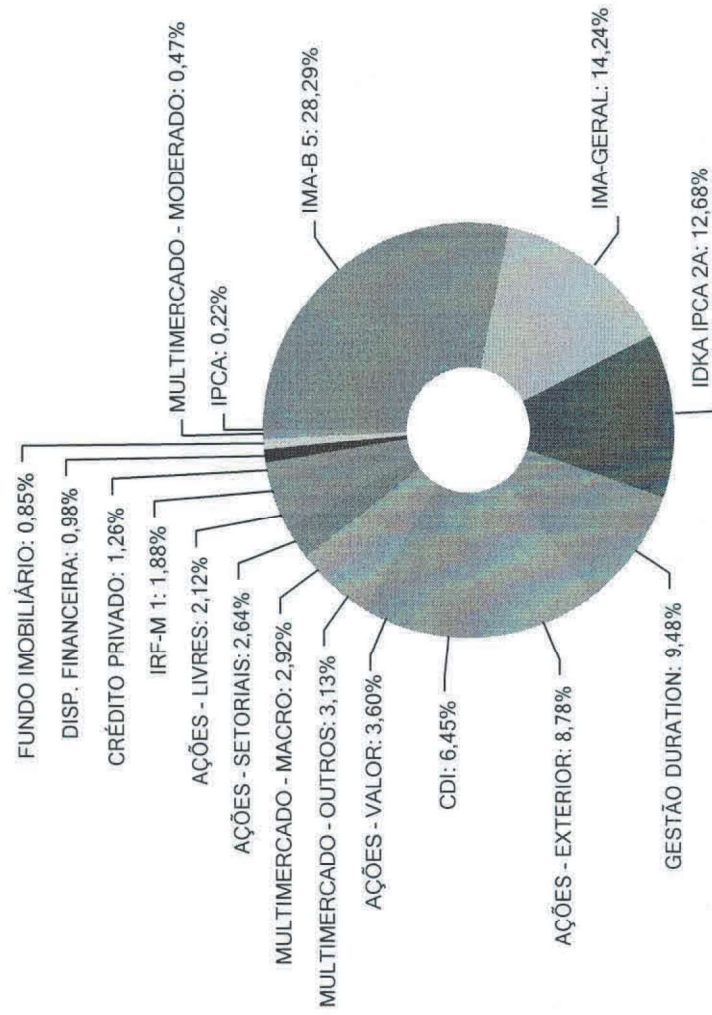
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-10,54%	-10,54%	-9,05%	4,48%	13,64%	72,99%	10,14%	0,18%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,37%	-2,37%	-2,21%	1,33%	14,73%	-	9,23%	0,14%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2022)



BB GESTÃO	633.642.319,29
CAIXA ECONÔMICA	2.295.272,06

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2022)

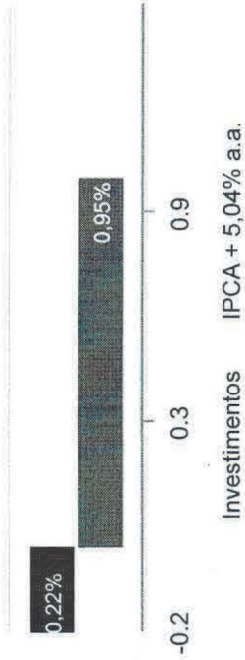


Sub-Segment	Value
IMA-B 5	181.714.815,82
IMA-GERAL	91.425.997,71
IDKA IPCA 2A	81.464.454,91
GESTÃO DURATION	60.888.457,87
AÇÕES - EXTERIOR	56.359.384,05
CDI	41.434.413,58
AÇÕES - VALOR	23.097.992,03
MULTIMERCADO - OUTROS	20.114.826,35
MULTIMERCADO - MACRO	18.757.538,51
AÇÕES - SETORIAIS	16.958.971,70
AÇÕES - LIVRES	13.615.307,38
IRF-M 1	12.095.739,83
CRÉDITO PRIVADO	8.113.150,14
DISP. FINANCEIRA	6.296.156,21
FUNDO IMOBILIÁRIO	5.435.881,13
MULTIMERCADO - MODERADO	3.034.570,58
IPCA	1.426.089,76

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

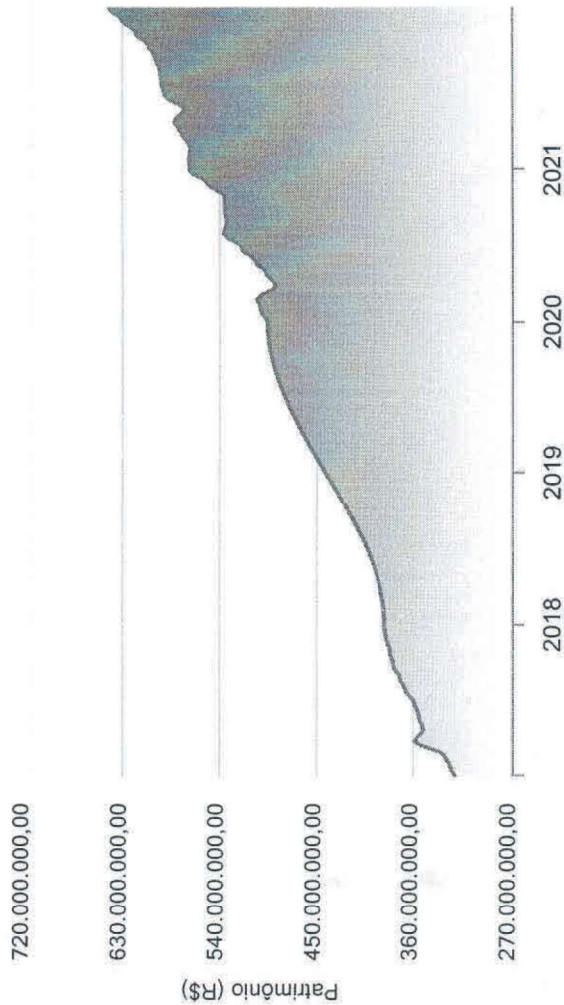
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	618.995.163,06	59.980.446,43	41.611.870,01	635.937.591,35	-1.426.148,13	-1.426.148,13	-0,22%	-0,22%	0,95%	0,95%	-23,48%	2,14%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

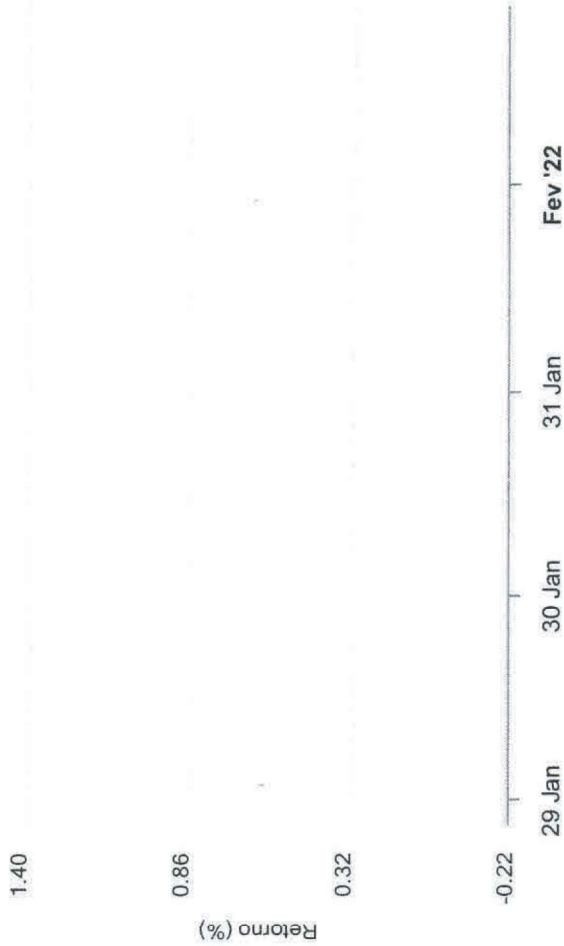


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instít	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	495.090,07	0,00	0,00	498.986,10	3.896,03	0,79%	0,79%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	16.483.428,37	0,00	0,00	16.612.552,59	129.124,22	0,78%	0,78%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.784.373,35	0,00	0,00	1.796.285,96	11.912,60	0,67%	0,67%	0,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	24.727.916,92	0,00	564.455,39	24.322.874,89	159.413,36	0,64%	0,65%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	20.172.118,09	0,00	0,00	20.286.108,22	113.990,13	0,57%	0,57%	0,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	50.340.566,72	0,00	38.528.931,19	12.095.739,83	284.104,30	0,56%	0,61%	0,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.418.087,23	0,00	0,00	1.426.089,76	8.002,53	0,56%	0,56%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.650.187,22	0,00	0,00	1.656.545,77	6.358,55	0,39%	0,39%	0,80%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	58.979.644,33	0,00	0,00	59.092.171,91	112.527,58	0,19%	0,19%	0,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	102.267.337,79	0,00	2.518.483,43	99.829.549,95	80.695,59	0,08%	0,08%	1,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	91.391.280,06	0,00	0,00	91.425.997,71	34.717,65	0,04%	0,04%	1,02%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	8.111.035,79	0,00	0,00	8.113.150,14	2.114,35	0,03%	0,03%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	81.456.609,38	0,00	0,00	81.464.454,91	7.845,53	0,01%	0,01%	1,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	59.980.446,43	0,00	59.942.611,88	-37.834,55	-0,06%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	459.277.675,33	59.980.446,43	41.611.870,01	478.563.119,62	916.867,87	0,19%		0,75%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instít	Var - Mês
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	12.786.073,73	0,00	0,00	13.615.307,38	829.233,65	6,49%	6,49%	8,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	22.277.251,73	0,00	0,00	23.097.992,03	820.740,30	3,68%	3,68%	6,86%
BB ENERGIA FI AÇÕES	16.529.688,76	0,00	0,00	16.958.971,70	429.282,94	2,60%	2,60%	8,61%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	18.513.411,39	0,00	0,00	18.757.538,51	244.127,12	1,32%	1,32%	0,62%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	3.012.568,36	0,00	0,00	3.034.570,58	22.002,22	0,73%	0,73%	1,13%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	19.974.017,02	0,00	0,00	20.114.826,35	140.809,33	0,70%	0,70%	0,06%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.504.739,89	0,00	0,00	5.435.881,13	-68.858,76	-1,25%	0,00%	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	12.722.732,89	0,00	0,00	12.034.686,21	-688.046,68	-5,41%	-5,41%	8,81%
Total Renda Variável	111.320.483,77	0,00	0,00	113.049.773,89	1.729.290,12	1,55%		5,03%

Igor Thierry S. Donato
Igor Thierry Silva Donato
Chefe do Setor de Contabilidade
Mat. 177727
CRC-RN 013710/O

Thiago Costa Marinho
Thiago Costa Marinho
PREVIDENCIÁRIO NATALPREV
Mat. 1777182-0

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2022)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instt	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I...	5.054.601,32	0,00	0,00	4.939.313,93	-115.287,39	-2,28%	-2,28%	11,66%
BB AÇÕES BOLSAS EUROPEIAS ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL ...	7.487.765,31	0,00	0,00	7.310.283,39	-177.481,92	-2,37%	-2,37%	9,23%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	35.854.637,33	0,00	0,00	32.075.100,52	-3.779.536,81	-10,54%	-10,54%	10,14%
Total Exterior	48.397.003,96	0,00	0,00	44.324.697,84	-4.072.306,12	-8,41%		10,16%


Thiago Costa Marreiros
Presidente NATALPREV
Mat. 177182-0