

RELATÓRIO GERENCIAL DE INVESTIMENTOS

PLANO DE BENEFÍCIO: ESCELDOS II MIX 30

DEZEMBRO DE 2020

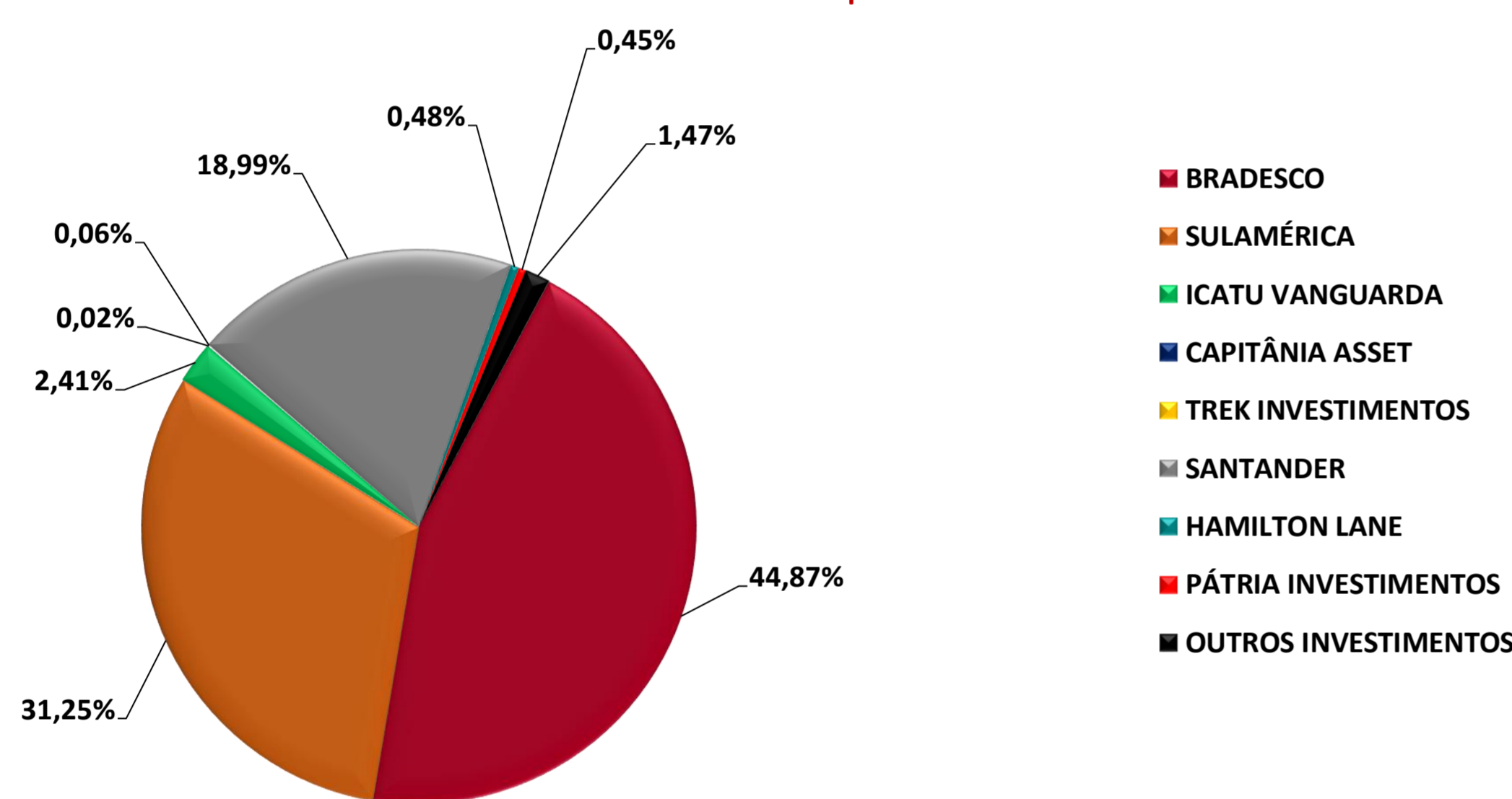
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS POR TIPO DE APLICAÇÃO

| | ESTRUTURA DE ALOCAÇÃO RF | | Rentabilidade | | | Patrimônio | | | Rentabilidade Acumulada | | | | Benchmark |
|---|--------------------------|--------|-------------------|----------------|----------------|------------|--------|---------------|-------------------------|---------------|--------|-------------------|-----------|
| | Mensal | Bench. | Mensal | % s/RF | % s/TG | Ano | Bench. | Ult. 12 Meses | Bench. | Ult. 24 Meses | Bench. | COMPOSIÇÃO | |
| RENDA FIXA | | | | | | | | | | | | | |
| FUNDO E GESTOR | | | | | | | | | | | | | |
| Enerprev Consolidador FIC de FI Renda Fixa - SulAmérica | 0,40% | 0,21% | 18.367.818 | 99,99% | 62,18% | 1,80% | 3,27% | 1,80% | 3,27% | 8,06% | 9,41% | CDI + 0,5% a.a. | |
| Enerprev FI Renda Fixa - Bradesco | 0,43% | 0,21% | 9.141.658 | 49,77% | 30,95% | 2,70% | 3,27% | 2,70% | 3,27% | 8,99% | 9,41% | CDI + 0,5% a.a. | |
| Enerprev Sul America FI - SulAmérica | 0,37% | 0,21% | 9.226.160 | 50,23% | 31,23% | 1,00% | 3,27% | 1,00% | 3,27% | 7,29% | 9,41% | CDI + 0,5% a.a. | |
| Debêntures (Vale do Rio Doce) | 13,83% | - | 1.673 | 0,01% | 0,01% | - | - | - | - | - | - | - | |
| TOTAL RENDA FIXA | - | - | 18.369.491 | 100,00% | 62,19% | - | - | - | - | - | - | - | |
| ESTRUTURA DE ALOCAÇÃO CE | | | | | | | | | | | | | |
| FUNDO E GESTOR | | | | | | | | | | | | | |
| Icatu Vang Enerpr RF - Icatu Vanguarda | 2,52% | 1,93% | 711.627 | 97,99% | 2,41% | 7,35% | 11,70% | 7,35% | 11,70% | 20,70% | 23,60% | INPC + 6,0% a.a. | |
| Capitânia Inflation Cp Firf - Capitânia Asset | 0,77% | 1,82% | 6.602 | 0,91% | 0,02% | -52,04% | 10,72% | -52,04% | 10,72% | -70,15% | 22,31% | IPCA + 6,0% a.a. | |
| Novero FI RF CP Imob - Trek Investimentos | -0,13% | 1,90% | 7.965 | 1,10% | 0,03% | 3,73% | 11,76% | 3,73% | 11,76% | -12,29% | 24,59% | IPCA + 7,0% a.a. | |
| TOTAL CRÉDITO ESTRUTURADO | - | - | 726.194 | 100,00% | 2,46% | - | - | - | - | - | - | - | |
| ESTRUTURA DE ALOCAÇÃO EMP | | | | | | | | | | | | | |
| FUNDO E GESTOR | | | | | | | | | | | | | |
| Empréstimos ⁽¹⁾ | 0,48% | 0,76% | 432.162 | 100,00% | 1,46% | 7,04% | 9,91% | 7,04% | 9,91% | 16,59% | 24,64% | CDI + 7,0% a.a. | |
| TOTAL EMPRÉSTIMOS | - | - | 432.162 | 100,00% | 1,46% | - | - | - | - | - | - | - | |
| ESTRUTURA DE ALOCAÇÃO RV | | | | | | | | | | | | | |
| FUNDO E GESTOR | | | | | | | | | | | | | |
| Enerprev Consolidador FIC de FIA - SulAmérica | 9,29% | 9,30% | 9.711.511 | 100,00% | 32,88% | 2,81% | 2,93% | 2,81% | 2,93% | 34,15% | 35,43% | IBOVESPA | |
| Enerprev FIC de FI em Ações - Bradesco | 9,31% | 9,30% | 4.106.100 | 42,28% | 13,90% | 2,83% | 2,93% | 2,83% | 2,93% | 29,69% | 35,43% | IBOVESPA | |
| Enerprev Fundo de Investimento em Ações - Santander | 9,28% | 9,30% | 5.605.412 | 57,72% | 18,98% | 2,87% | 2,93% | 2,87% | 2,93% | 35,30% | 35,43% | IBOVESPA | |
| TOTAL RENDA VARIÁVEL | - | - | 9.711.511 | 100,00% | 32,88% | - | - | - | - | - | - | - | |
| ESTRUTURA DE ALOCAÇÃO IE | | | | | | | | | | | | | |
| FUNDO E GESTOR | | | | | | | | | | | | | |
| Hamilton Lane FICFIP - Hamilton Lane | 5,21% | 2,05% | 142.027 | 51,70% | 0,48% | -6,46% | 13,81% | -6,46% | 13,81% | 20,57% | 29,23% | IPCA + 9,0% a.a. | |
| P2 Brasil Infraestrutura III - Pátria Investimentos | 6,82% | 1,90% | 132.705 | 48,30% | 0,45% | -25,59% | 11,76% | -25,59% | 11,76% | -9,71% | 24,59% | IPCA + 7,0% a.a. | |
| TOTAL INVESTIMENTO ESTRUTURADO | - | - | 274.732 | 100,00% | 0,93% | - | - | - | - | - | - | - | |
| ESTRUTURA DE ALOCAÇÃO IMOB | | | | | | | | | | | | | |
| FUNDO E GESTOR | | | | | | | | | | | | | |
| Sao Francisco 34 FII - Trek Investimentos | -0,09% | 1,90% | 8.657 | 34,78% | 0,03% | -0,54% | 8,91% | - | - | - | - | IPCA + 7,0% a.a. | |
| Imóveis ⁽¹⁾ | 0,42% | 1,83% | 16.235 | 65,22% | 0,05% | 7,80% | 10,32% | 7,80% | 10,32% | -23,45% | 20,59% | INPC + 4,70% a.a. | |
| TOTAL INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO | - | - | 24.892 | 100,00% | 0,08% | - | - | - | - | - | - | - | |
| CAIXA | - | - | 300 | - | 0,00% | - | - | - | - | - | - | - | |
| TOTAL GERAL (TG) | - | - | 29.539.282 | - | 100,00% | - | - | - | - | - | - | - | |

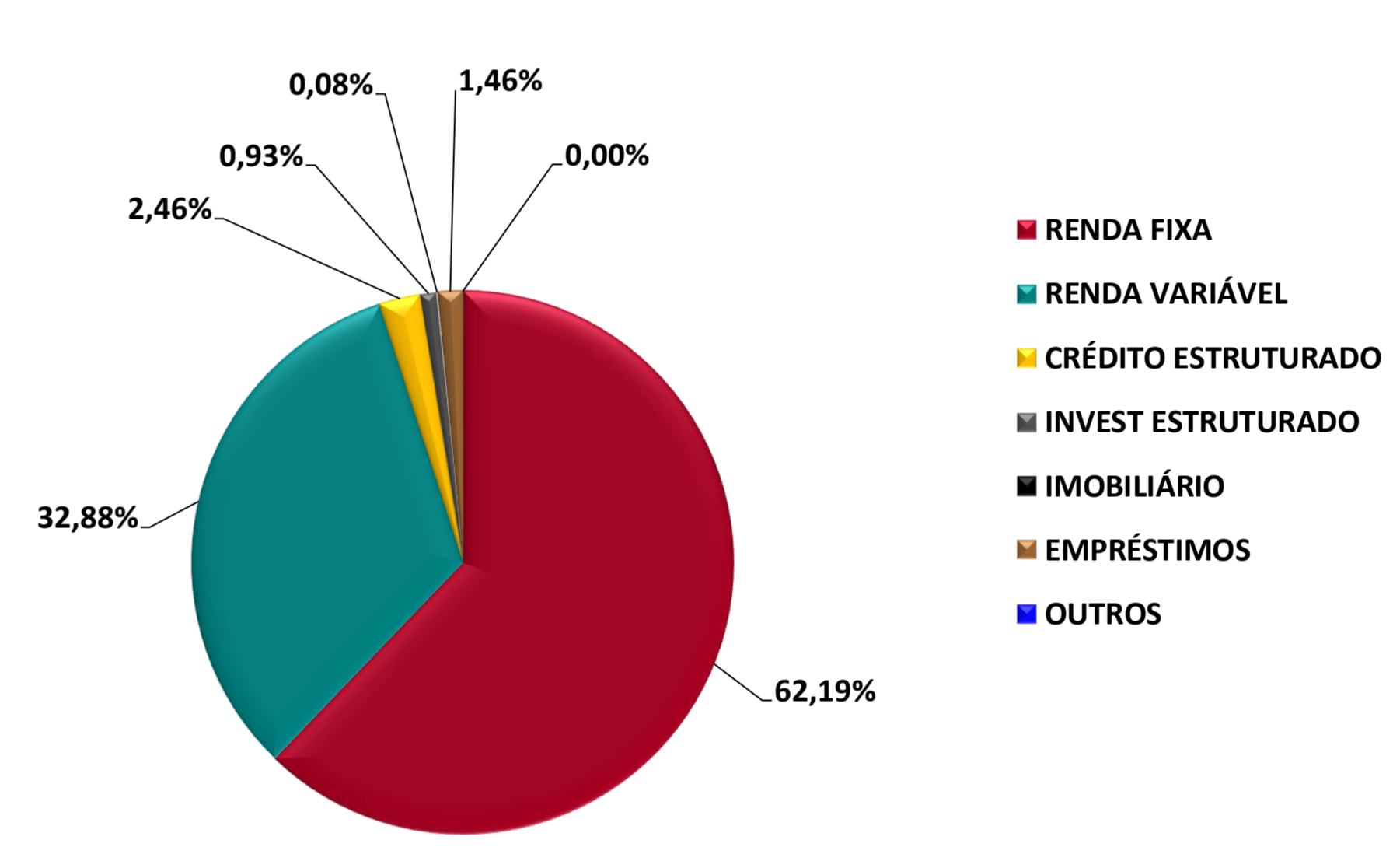
⁽¹⁾ Os resultados de imóveis e empréstimo refere-se a prévia das contas patrimoniais, portanto estes valores podem sofrer alterações.

⁽²⁾ As rentabilidades acima foram apuradas seguindo a metodologia dos gestores dos fundos e não devem servir de base de comparação com a rentabilidade da cota previdencial. Essa orientação deve ser observada, em especial, para os fundos estruturados, que possuem metodologia diferenciada no cálculo da cota.

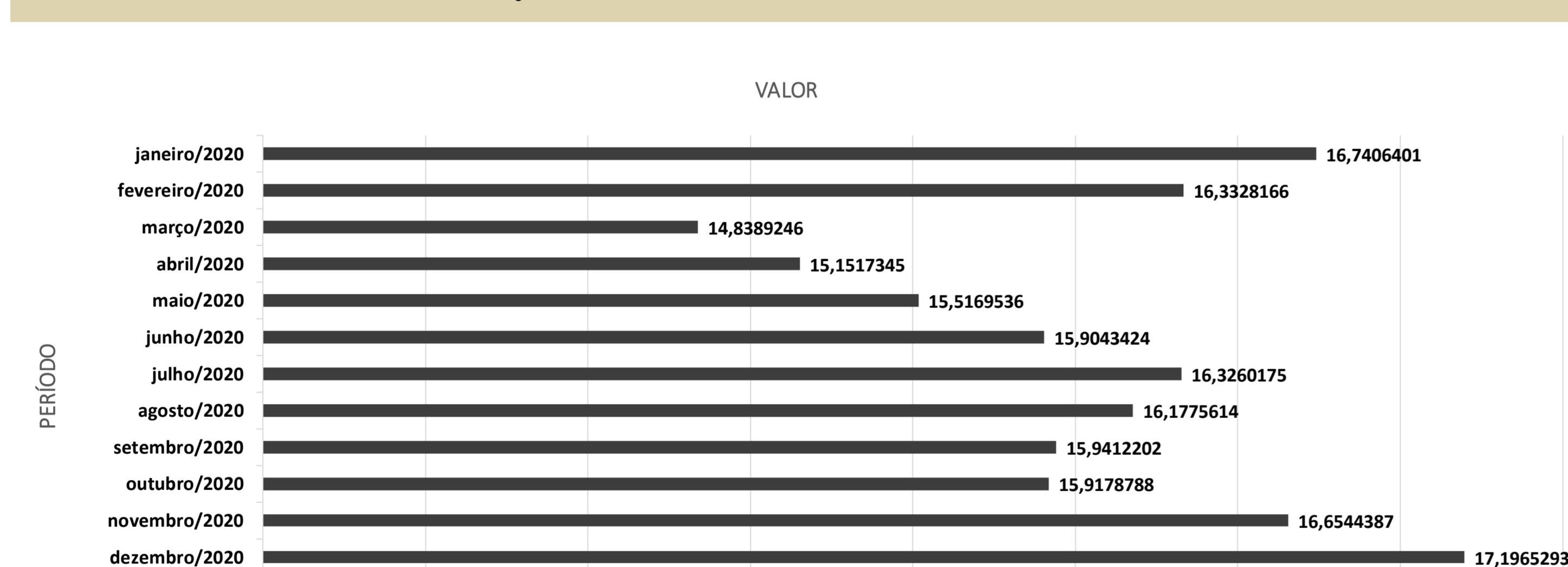
Recursos por Gestor



Recursos por Segmento de Aplicação



EVOLUÇÃO DO VALOR DA COTA PREVIDENCIAL DO PLANO ESCELDOS II MIX 30

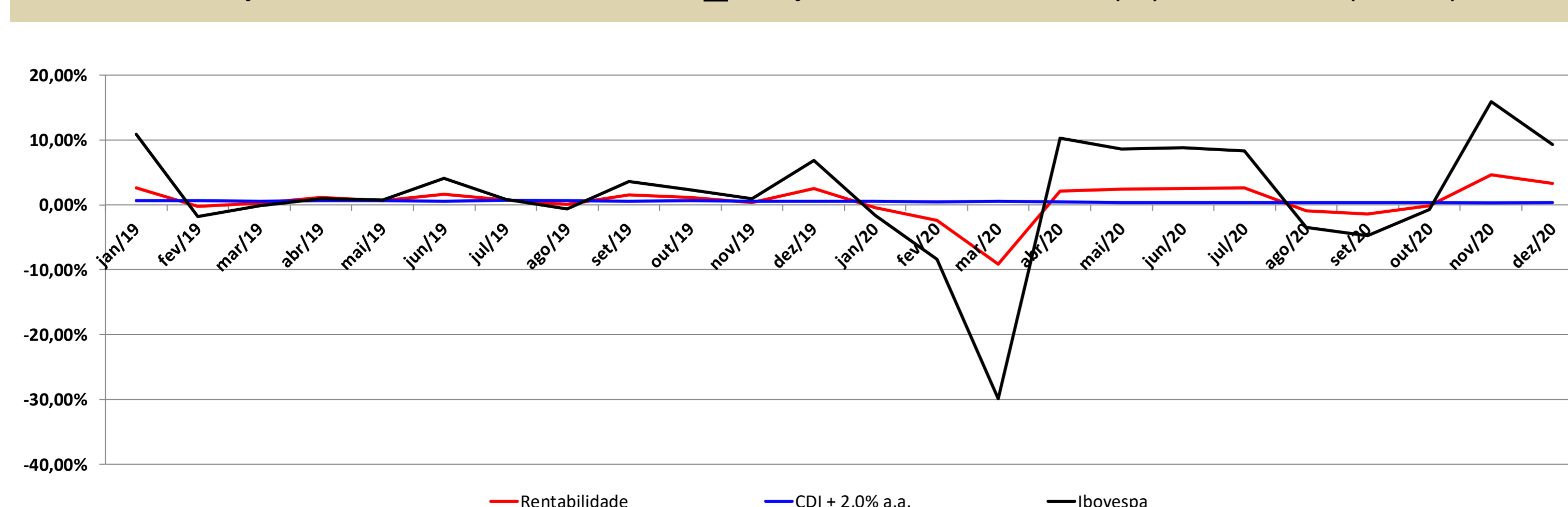


RENTABILIDADE DA COTA PREVIDENCIAL DO ESCELDOS II MIX 30⁽¹⁾

| RENTABILIDADE | |
|--------------------------|--------|
| janeiro/2020 | -0,42% |
| fevereiro/2020 | -2,44% |
| março/2020 | -9,15% |
| abril/2020 | 2,11% |
| maio/2020 | 2,41% |
| junho/2020 | 2,50% |
| julho/2020 | 2,65% |
| agosto/2020 | -0,91% |
| setembro/2020 | -1,46% |
| outubro/2020 | -0,15% |
| novembro/2020 | 4,63% |
| dezembro/2020 | 3,25% |
| ACUMULADO | |
| Ano | 2,29% |
| ULT. 12 Meses | 2,29% |
| ULT. 24 Meses | 15,75% |
| Acumulado desde Jan/2018 | 27,64% |

⁽²⁾ Rentabilidade passada não é garantia de rentabilidade futura.

VARIAÇÃO DA RENTABILIDADE DA COTA PREVIDENCIAL VS VARIAÇÃO DA META DE RENTABILIDADE (CDI) E RENDA VARIÁVEL (IBOVESPA)



Esse gráfico tem como objetivo demonstrar a sensibilidade da rentabilidade da cota com alguns indicadores financeiros, inclusive com a Renda Variável que geralmente apresenta alta volatilidade, como pode ser observado.

RENTABILIDADE DOS INDICADORES ECONÔMICOS

| INDICADOR ECONÔMICO | | | | |
|---------------------|----------|--------|----------|--------|
| PERÍODO | POUPANÇA | CDI | IBOVESPA | INPC |
| janeiro/2020 | 0,26% | 0,38% | -1,63% | 0,19% |
| fevereiro/2020 | 0,26% | 0,29% | -8,43% | 0,17% |
| março/2020 | 0,24% | 0,34% | -29,90% | 0,18% |
| abril/2020 | 0,22% | 0,28% | 10,25% | -0,23% |
| maio/2020 | 0,22% | 0,24% | 8,57% | -0,25% |
| junho/2020 | 0,17% | 0,21% | 8,76% | 0,30% |
| julho/2020 | 0,13% | 0,19% | 8,27% | 0,44% |
| agosto/2020 | 0,13% | 0,16% | -3,44% | 0,36% |
| setembro/2020 | 0,12% | 0,16% | -4,80% | 0,87% |
| outubro/2020 | 0,12% | 0,16% | -0,69% | 0,89% |
| novembro/2020 | 0,12% | 0,15% | 15,90% | 0,95% |
| dezembro/2020 | 0,12% | 0,16% | 9,30% | 1,46% |
| ACUMULADO | | | | |
| Ano | 2,13% | 2,75% | 2,93% | 5,45% |
| ULT. 12 Meses | 2,13% | 2,75% | 2,93% | 5,45% |
| ULT. 24 Meses | 6,48% | 8,86% | 35,43% | 10,17% |
| ULT. 36 Meses | 11,40% | 15,84% | 55,81% | 13,96% |