

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

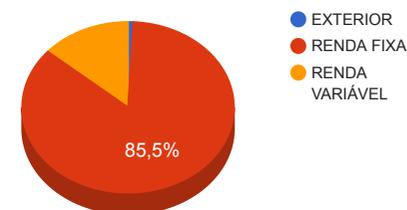
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	22.287,07	0,80%	376	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.197.171,00	43,24%	748	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	484.828,06	17,51%	1.268	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	537.782,38	19,42%	815	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	41.768,65	1,51%	298	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	83.399,92	3,01%	677	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	24.345,92	0,88%	120	0,01%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	22.588,89	0,82%	73	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	276.096,47	9,97%	218	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	78.400,00	2,83%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	2.768.668,36				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (outubro / 2018)

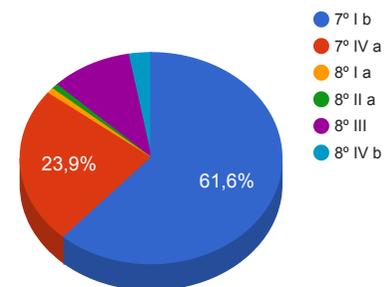
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.704.286,13	61,56%	20,00%	30,00%	70,00%	233.781,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	1.661.201,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	662.950,95	23,94%	5,00%	10,00%	30,00%	167.649,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	415.300,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	138.433,42
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	24.345,92	0,88%	2,00%	5,00%	10,00%	252.520,92
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	22.588,89	0,82%	2,00%	5,00%	10,00%	254.277,95
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	276.096,47	9,97%	7,00%	10,00%	10,00%	770,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	138.433,42
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	78.400,00	2,83%	2,00%	5,00%	5,00%	60.033,42
Total Carteira		2.768.668,36					

EXTERIOR	22.588,89	0,82%
RENDA FIXA	2.367.237,08	85,50%
RENDA VARIÁVEL	378.842,39	13,68%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	1.704.286,13	61,56%	20,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	662.950,95	23,94%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	24.345,92	0,88%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	22.588,89	0,82%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	276.096,47	9,97%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	78.400,00	2,83%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	2.768.668,36	100,00%	54,00	225,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 2018)

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)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.625.910,82	94,84%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	142.757,54	5,16%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (outubro / 2018)

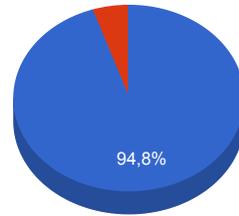
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	3,10%	8,23%	3,75%	4,10%	9,30%	24,04%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3,07%	8,05%	3,70%	4,01%	9,09%	23,59%	0,20%	1,588%	3,03%
IDKA IPCA 2 Anos	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	7,79%	3,21%	3,90%	9,03%	23,32%	0,20%	0,977%	2,33%
IRF-M 1	0,92%	5,81%	1,97%	3,41%	7,06%	20,23%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,64%	1,93%	3,32%	6,85%	19,69%	0,10%	0,273%	0,55%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,32%	1,58%	3,15%	6,53%	18,49%	0,20%	0,009%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	4,65%	1,37%	2,76%	5,67%	16,44%	0,80%	0,000%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	4,43%	1,31%	2,63%	5,41%	16,02%	1,00%	0,003%	0,02%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	10,77%	10,13%	11,40%	2,38%	12,87%	33,01%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	11,52%	11,66%	11,39%	3,97%	14,22%	33,59%	1,00%	15,424%	20,63%
IFIX	5,04%	0,72%	4,08%	-4,06%	0,73%	18,90%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,62%	-8,41%	0,01%	-6,67%	-9,26%	-6,64%	1,20%	9,180%	21,26%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,73%	5,83%	1,38%	3,16%	7,69%	20,32%	0,60%	0,221%	2,71%
Global BDRX	-14,26%	15,88%	-3,45%	10,87%	23,42%	55,12%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	-14,16%	14,06%	-3,67%	9,70%	21,05%	50,09%	0,70%	9,858%	16,62%

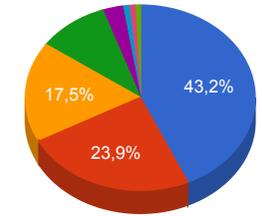
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (outubro / 2018)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.625.910,82	94,84%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	142.757,54	5,16%



- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	1.197.171,00	43,24%
CDI	662.950,95	23,94%
IRF-M 1	484.828,06	17,51%
MULTIMERCADO	276.096,47	9,97%
FUNDO IMOBILIÁRIO	78.400,00	2,83%
AÇÕES - SETORIAIS	24.345,92	0,88%
BDR NÍVEL I	22.588,89	0,82%
IMA-B 5	22.287,07	0,80%

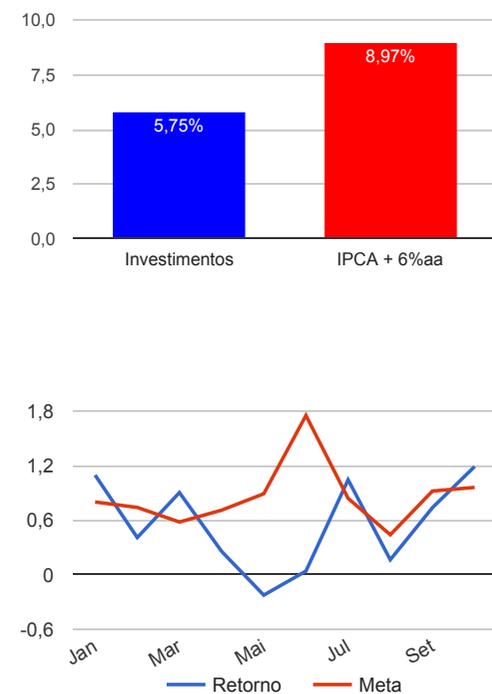


- IDKA IPCA 2A
- CDI
- IRF-M 1
- MULTIME...
- FUNDO IMOBILIÁ...
- AÇÕES - SETORIAIS
- BDR NÍVEL I
- IMA-B 5

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	2.980.076,96	269.728,81	416.522,43	2.865.909,74	32.626,40	1,09%	0,80%	136,60%	0,72%
Fevereiro	2.865.909,74	338.963,62	358.967,43	2.857.648,92	11.742,99	0,41%	0,74%	55,49%	0,88%
Março	2.857.648,92	898.186,92	852.054,16	2.930.007,61	26.225,93	0,90%	0,58%	156,48%	0,75%
Abril	2.930.007,61	551.729,83	514.579,85	2.974.803,18	7.645,59	0,26%	0,71%	36,40%	0,61%
Mai	2.974.803,18	1.638.307,34	1.527.669,28	3.078.563,59	-6.877,65	-0,22%	0,89%	-25,08%	1,12%
Junho	3.078.563,59	984.482,01	1.028.428,58	3.035.881,58	1.264,56	0,04%	1,75%	2,34%	1,78%
Julho	3.035.881,58	730.491,25	611.987,79	3.187.303,55	32.918,51	1,04%	0,84%	123,99%	0,76%
Agosto	3.187.303,55	939.735,68	1.075.080,82	3.057.240,87	5.282,46	0,17%	0,44%	37,43%	1,22%
Setembro	3.057.240,87	224.886,60	425.489,57	2.879.193,83	22.555,93	0,74%	0,92%	79,98%	1,06%
Outubro	2.879.193,83	267.509,35	412.268,25	2.768.668,36	34.233,43	1,19%	0,96%	123,56%	0,98%
Acumulado no ano					167.618,15	5,75%	8,97%	64,11%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.077.768,80	96.846,73	0,00	1.197.171,00	22.555,47	1,92%	0,98%	2,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.738,81	20.383,17	0,00	22.287,07	165,09	0,75%	1,59%	3,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	739.851,90	28.197,49	288.000,00	484.828,06	4.778,67	0,62%	0,27%	0,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	534.943,01	0,00	0,00	537.782,38	2.839,37	0,53%	0,01%	0,53%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	41.056,10	560,00	42,00	41.768,65	194,55	0,47%	0,00%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.133,02	121.521,96	103.540,16	83.399,92	285,10	0,15%	0,00%	0,45%
				Total Renda Fixa	30.818,25	1,25%	0,57%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	21.830,56	0,00	0,00	24.345,92	2.515,36	11,52%	15,42%	11,52%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	121,89	0,00	126,09	0,00	4,20	3,45%	14,34%	8,52%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	76.400,00	0,00	560,00	78.400,00	2.560,00	3,35%	9,18%	2,62%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	294.036,04	0,00	20.000,00	276.096,47	2.060,43	0,70%	0,22%	0,73%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	26.313,70	0,00	0,00	22.588,89	-3.724,81	-14,16%	9,86%	-14,16%
Total Renda Variável					3.415,18	0,82%	3,44%	