

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.989.920,30	12,42%	903	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.554.980,20	15,94%	676	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.827.204,59	17,64%	597	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.823.304,23	17,62%	1.239	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	810.228,25	5,06%	648	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	2.432.508,28	15,18%	387	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.391.103,57	8,68%	1.637	0,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	186.677,82	1,16%	46.574	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	124.363,34	0,78%	37.510	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	884.574,56	5,52%	60	1,60%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			16.024.865,14				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			17.573,76				Artigo 6º
PL Total			16.042.438,90				

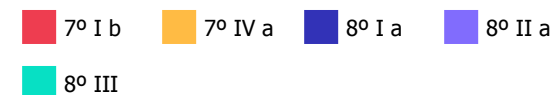
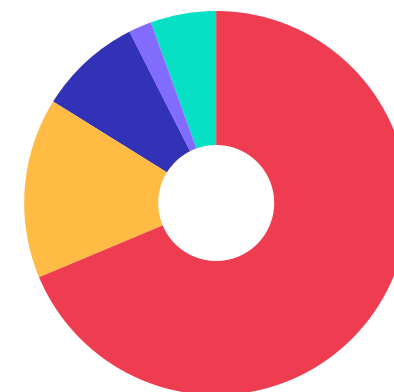
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2020)

i ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão! ✕

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	1.391.103,57	8,68%	0,00%	10,00%	30,00%	3.416.355,97
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	4.807.459,54
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	311.041,16	1,94%	0,00%	3,00%	20,00%	2.893.931,87
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	3.204.973,03
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	884.574,56	5,52%	0,00%	5,00%	10,00%	717.911,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	801.243,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	801.243,26
Total Renda Variável	35,00%	2.586.719,29	16,14%	0,00%	22,00%	120,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.602.486,51
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	1.602.486,51
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	1.602.486,51
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Setembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.713.823,98	98,06	0,00
ITAÚ UNIBANCO	311.041,16	1,94	0,00

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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	11.005.637,57	68,68	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	2.432.508,28	15,18	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	1.391.103,57	8,68	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	311.041,16	1,94	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	884.574,56	5,52	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

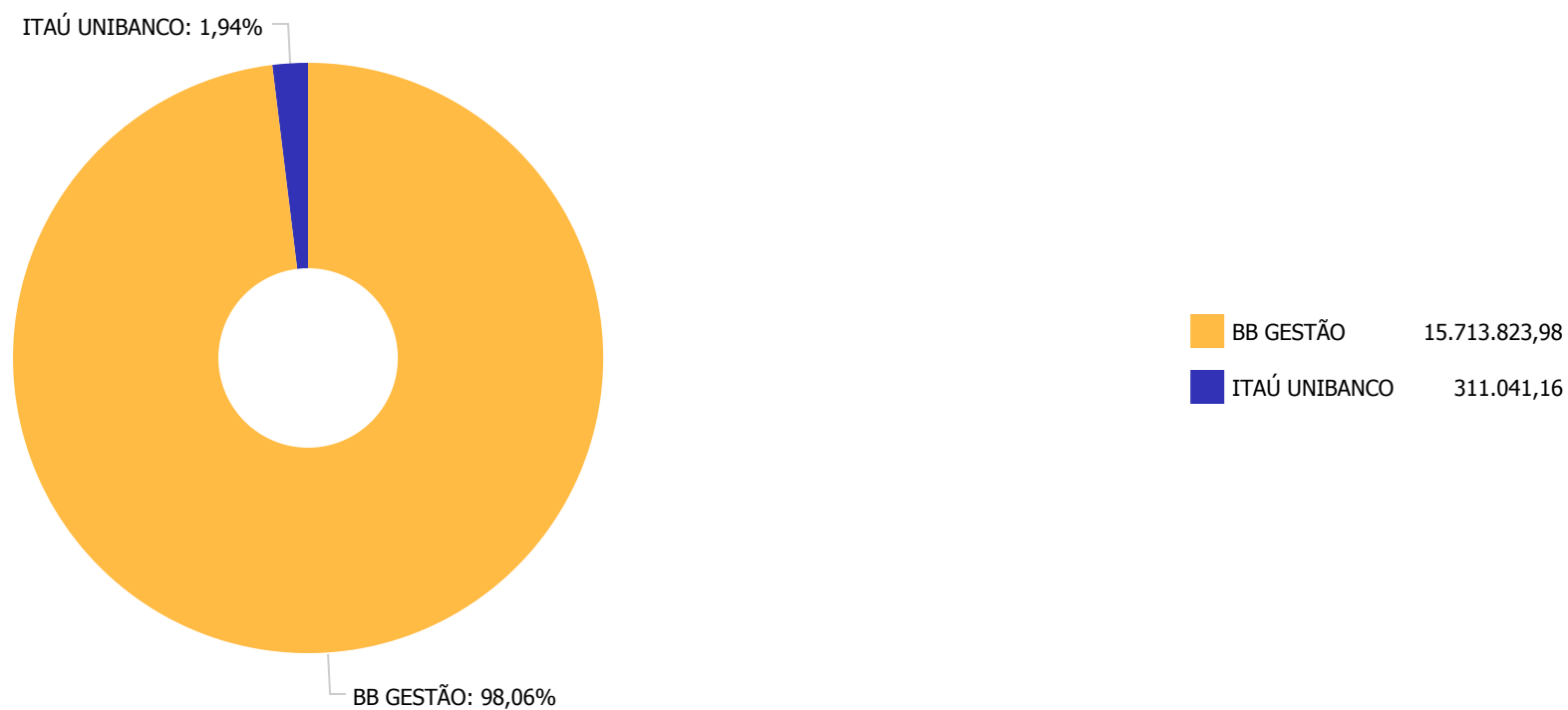
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,71%	1,96%	0,25%	2,99%	3,90%	21,11%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,75%	1,86%	0,10%	3,07%	3,70%	21,50%	0,02%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	2,83%	0,36%	1,43%	4,17%	11,70%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,15%	4,30%	1,18%	4,93%	6,95%	23,16%	0,02%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,56%	-0,93%	0,84%	5,77%	1,83%	33,39%	0,04%	0,11%
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,88%	-	-0,03%	2,85%	-	-	0,02%	-

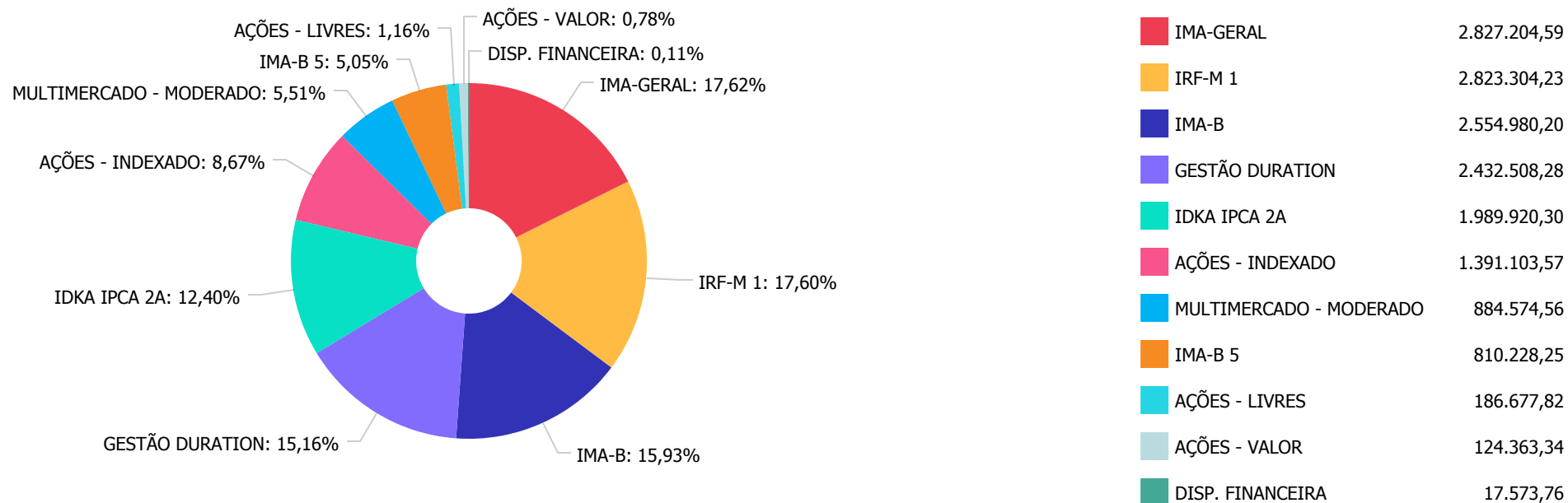
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IGC (Benchmark)	-4,81%	-14,61%	0,77%	33,69%	-3,97%	32,91%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-5,04%	-17,78%	-0,39%	30,27%	-8,20%	24,95%	0,10%	0,40%
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	-4,00%	-11,63%	3,54%	35,88%	-0,77%	43,28%	0,12%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,96%	-20,69%	2,00%	30,39%	-10,53%	31,29%	0,11%	0,41%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	-0,57%	-	0,44%	1,61%	-	-	0,01%	-

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2020)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

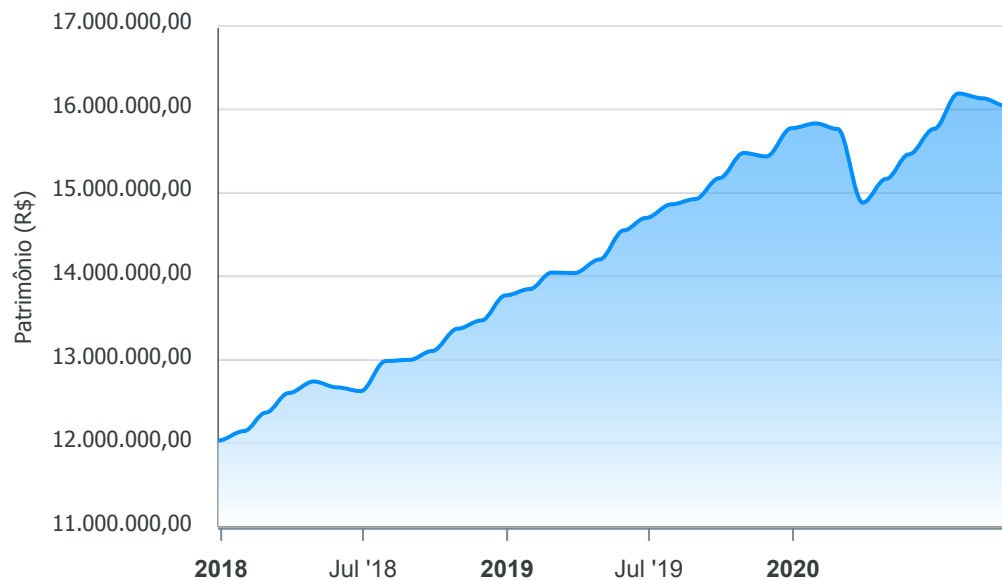
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	15.700.744,44	0,00	0,00	15.737.096,18	36.351,74	36.351,74	0,23%	0,23%	0,71%	0,71%	32,52%	1,88%
Fevereiro	15.737.096,18	224.735,01	109.000,00	15.749.973,13	-102.858,06	-66.506,32	-0,65%	-0,42%	0,66%	1,38%	-30,41%	2,77%
Março	15.749.973,13	0,00	0,00	14.855.508,49	-894.464,64	-960.970,96	-5,68%	-6,07%	0,57%	1,96%	-310,48%	11,53%
Abril	14.855.508,49	52.000,00	0,00	15.153.504,31	245.995,82	-714.975,14	1,65%	-4,52%	0,14%	2,10%	-215,13%	5,77%
Mai	15.153.504,31	0,00	0,00	15.412.465,07	258.960,76	-456.014,38	1,71%	-2,89%	0,07%	2,18%	-132,81%	2,92%
Junho	15.412.465,07	3.678.976,59	3.619.976,59	15.751.328,37	279.863,30	-176.151,08	1,81%	-1,14%	0,74%	2,93%	-38,73%	2,40%
Julho	15.751.328,37	0,00	0,00	16.130.048,80	378.720,43	202.569,35	2,40%	1,24%	0,89%	3,85%	32,27%	2,00%
Agosto	16.130.048,80	229.300,00	129.000,00	16.104.114,00	-126.234,80	76.334,55	-0,78%	0,45%	0,72%	4,59%	9,88%	1,98%
Setembro	16.104.114,00	199.290,00	105.300,00	16.024.865,14	-173.238,86	-96.904,31	-1,07%	-0,62%	1,12%	5,76%	-10,77%	2,84%

Investimentos x Meta Atuarial



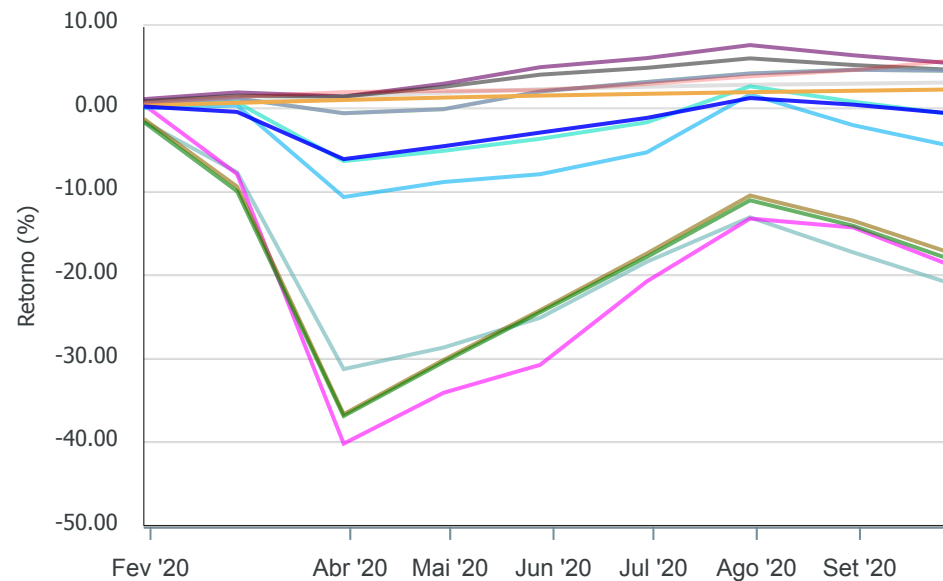
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO



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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.987.652,18	0,00	0,00	1.989.920,30	2.268,12	0,11%	0,11%	1,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.927.367,72	0,00	105.300,00	2.823.304,23	1.236,51	0,04%	0,04%	0,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	811.475,03	0,00	0,00	810.228,25	-1.246,78	-0,15%	-0,15%	1,65%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.848.642,04	0,00	0,00	2.827.204,59	-21.437,45	-0,75%	-0,75%	2,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.253.033,09	199.290,00	0,00	2.432.508,28	-19.814,81	-0,81%	-0,88%	2,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.595.349,44	0,00	0,00	2.554.980,20	-40.369,24	-1,56%	-1,56%	4,15%
Total Renda Fixa	13.423.519,50	199.290,00	105.300,00	13.438.145,85	-79.363,65	-0,59%		1,97%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	889.620,34	0,00	0,00	884.574,56	-5.045,78	-0,57%	-0,57%	1,27%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	129.545,67	0,00	0,00	124.363,34	-5.182,33	-4,00%	-4,00%	11,90%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	196.422,80	0,00	0,00	186.677,82	-9.744,98	-4,96%	-4,96%	10,80%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.465.005,69	0,00	0,00	1.391.103,57	-73.902,12	-5,04%	-5,04%	10,36%
Total Renda Variável	2.680.594,50	0,00	0,00	2.586.719,29	-93.875,21	-3,50%		7,36%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.958.310,65	0,00	0,00	1.989.920,30	31.609,65	1,61%	1,61%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.533.829,72	0,00	0,00	2.554.980,20	21.150,48	0,83%	0,83%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.046.583,91	0,00	234.300,00	2.823.304,23	11.020,32	0,36%	0,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	800.764,75	0,00	0,00	810.228,25	9.463,50	1,18%	1,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.824.259,98	0,00	0,00	2.827.204,59	2.944,61	0,10%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.007.155,39	428.590,00	0,00	2.432.508,28	-3.237,11	-0,13%	-0,03%
				Total Renda Fixa	72.951,45	0,55%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	120.113,40	0,00	0,00	124.363,34	4.249,94	3,54%	3,54%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	880.742,85	0,00	0,00	884.574,56	3.831,71	0,44%	0,44%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	183.014,07	0,00	0,00	186.677,82	3.663,75	2,00%	2,00%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.396.553,65	0,00	0,00	1.391.103,57	-5.450,08	-0,39%	-0,39%
				Total Renda Variável	6.295,32	0,24%	