

Relatório Analítico dos Investimentos

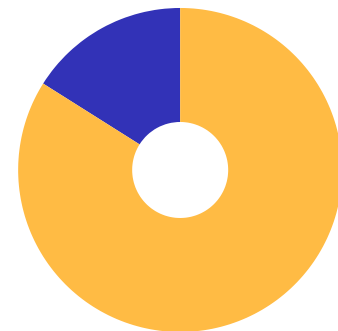
em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.559.983,02	15,98%	675	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.825.218,84	17,63%	590	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.826.505,84	17,64%	1.234	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.996.458,91	12,46%	910	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	811.740,71	5,07%	653	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	2.430.754,72	15,17%	397	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.379.745,77	8,61%	1.618	0,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	187.607,32	1,17%	45.375	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	122.152,13	0,76%	37.702	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	881.222,78	5,50%	64	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			16.021.390,04				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			71.973,08	Artigo 6º			
PL Total			16.093.363,12				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	16.021.390,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	11.019.907,32	68,78%	40,00%	60,00%	100,00%	5.001.482,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	16.021.390,04
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	801.069,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	9.612.834,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	9.612.834,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	45,00%	2.430.754,72	15,17%	0,00%	10,00%	40,00%	3.977.801,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	6.408.556,02
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	3.204.278,01
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.403.208,51
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.403.208,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	801.069,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	801.069,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	801.069,50
Total Renda Fixa	100,00%	13.450.662,04	83,95%	40,00%	75,00%	570,00%	



RENDA FIXA 13.450.662,04

RENDA VARIÁVEL 2.570.728,00

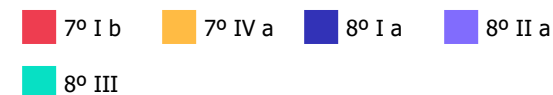
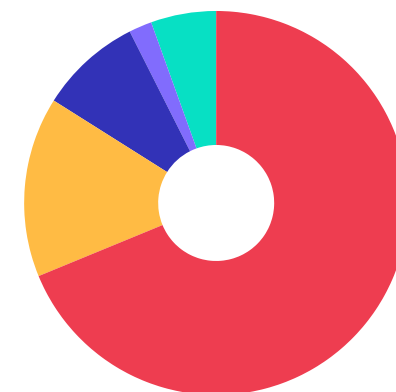
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	35,00%	1.379.745,77	8,61%	0,00%	10,00%	30,00%	3.426.671,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	4.806.417,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	25,00%	309.759,45	1,93%	0,00%	3,00%	20,00%	2.894.518,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	3.204.278,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	881.222,78	5,50%	0,00%	5,00%	10,00%	720.916,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	801.069,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	801.069,50
Total Renda Variável	35,00%	2.570.728,00	16,05%	0,00%	22,00%	120,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 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%	1.602.139,00
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	1.602.139,00
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	1.602.139,00
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.711.630,59	98,07	-
ITAÚ UNIBANCO	309.759,45	1,93	-

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'	11.019.907,32	68,78	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'	2.430.754,72	15,17	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'	1.379.745,77	8,61	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	309.759,45	1,93	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	881.222,78	5,50	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 Outubro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,00%	1,96%	-1,39%	2,13%	2,16%	17,10%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	1,79%	-1,70%	2,07%	1,80%	17,32%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,04%	5,45%	1,09%	4,85%	6,73%	19,60%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	4,89%	1,13%	5,25%	6,32%	18,19%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,16%	3,29%	0,43%	1,38%	4,06%	11,49%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	2,94%	0,25%	1,13%	3,67%	10,79%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,20%	4,72%	0,50%	4,81%	5,71%	20,28%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,19%	4,50%	0,40%	4,62%	5,42%	19,71%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	-0,73%	-3,19%	4,62%	-1,29%	24,83%	0,02%	0,10%
IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	-	-1,99%	2,03%	-	-	0,01%	-

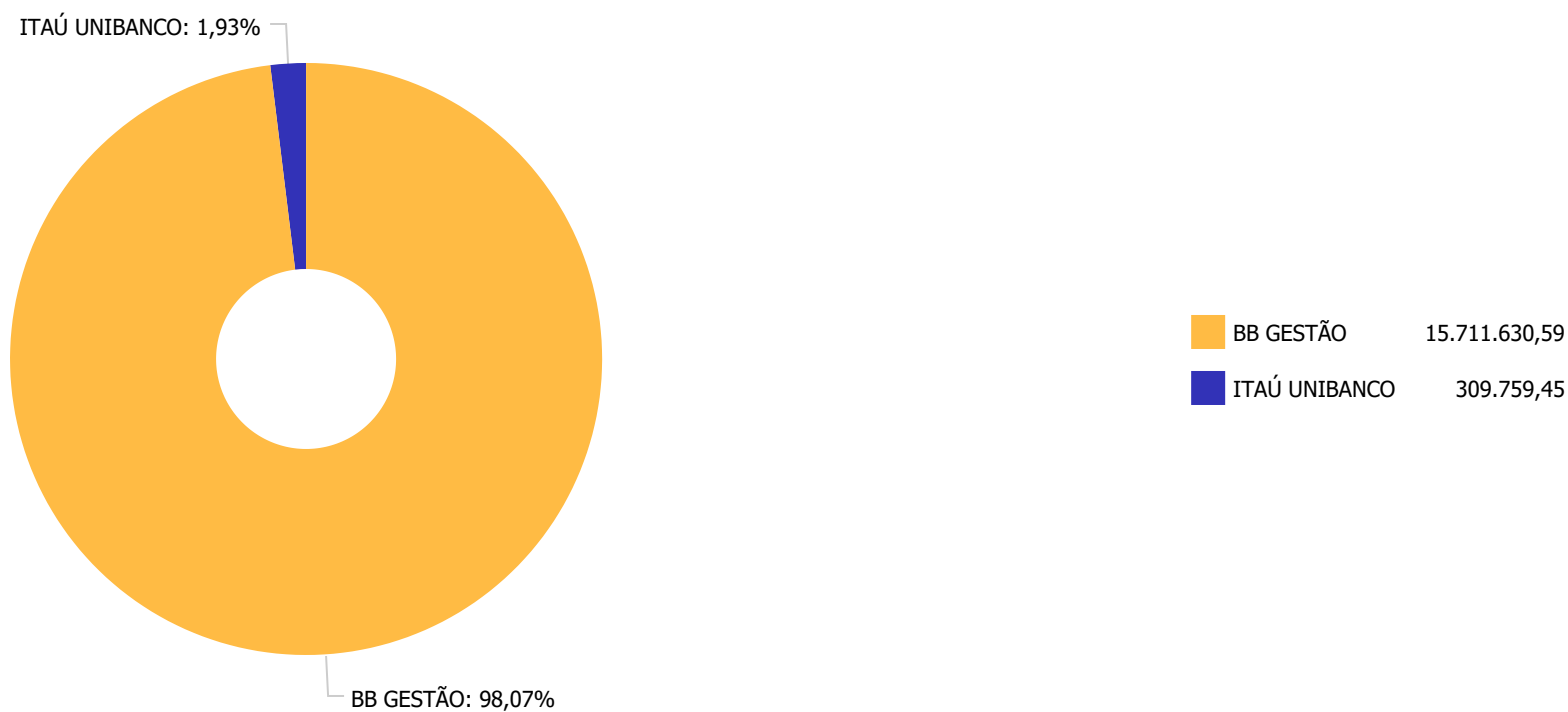
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IGC (Benchmark)	-1,00%	-15,47%	-8,22%	18,56%	-7,28%	18,78%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-0,82%	-18,46%	-8,90%	16,42%	-11,42%	11,13%	0,12%	0,40%

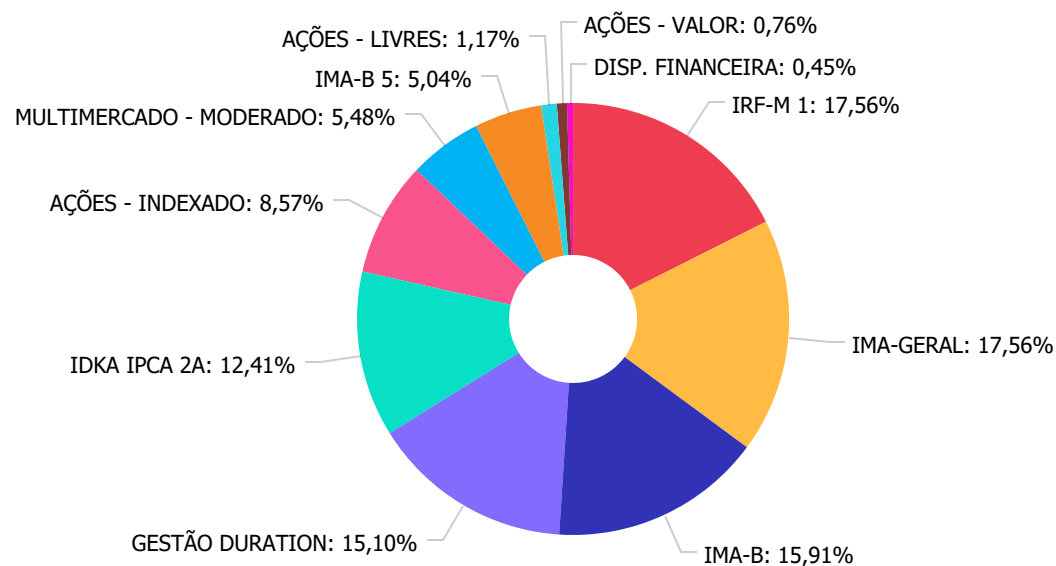
Ibovespa (Benchmark)	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	-1,78%	-13,20%	-7,04%	20,27%	-3,69%	23,76%	0,11%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,50%	-20,29%	-4,68%	18,03%	-12,18%	19,23%	0,11%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-	-0,63%	0,96%	-	-	0,01%	-

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



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

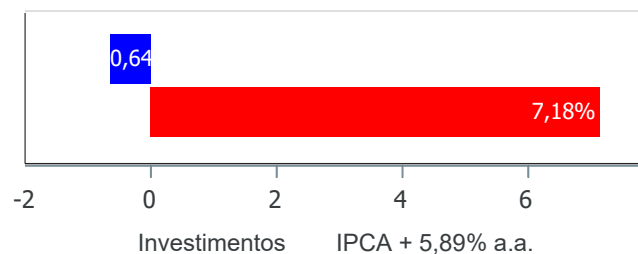


IRF-M 1	2.826.505,84
IMA-GERAL	2.825.218,84
IMA-B	2.559.983,02
GESTÃO DURATION	2.430.754,72
IDKA IPCA 2A	1.996.458,91
AÇÕES - INDEXADO	1.379.745,77
MULTIMERCADO - MODERADO	881.222,78
IMA-B 5	811.740,71
AÇÕES - LIVRES	187.607,32
AÇÕES - VALOR	122.152,13
DISP. FINANCEIRA	71.973,08

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%
Outubro	16.024.865,14	0,00	0,00	16.021.390,04	-3.475,10	-100.379,41	-0,02%	-0,64%	1,34%	7,18%	-8,94%	2,38%

Investimentos x Meta Atuarial



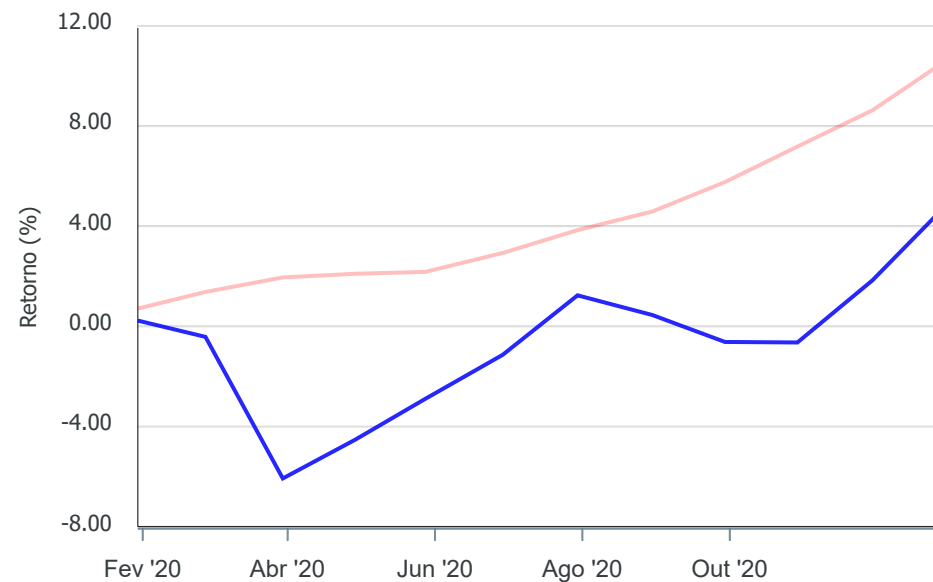
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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 Outubro/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...	1.989.920,30	0,00	0,00	1.996.458,91	6.538,61	0,33%	0,33%	1,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.554.980,20	0,00	0,00	2.559.983,02	5.002,82	0,20%	0,20%	2,26%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	810.228,25	0,00	0,00	811.740,71	1.512,46	0,19%	0,19%	1,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.823.304,23	0,00	0,00	2.826.505,84	3.201,61	0,11%	0,11%	0,29%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.827.204,59	0,00	0,00	2.825.218,84	-1.985,75	-0,07%	-0,07%	1,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.432.508,28	0,00	0,00	2.430.754,72	-1.753,56	-0,07%	-0,07%	1,48%
Total Renda Fixa	13.438.145,85	0,00	0,00	13.450.662,04	12.516,19	0,09%		1,26%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	186.677,82	0,00	0,00	187.607,32	929,50	0,50%	0,50%	10,68%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	884.574,56	0,00	0,00	881.222,78	-3.351,78	-0,38%	-0,38%	1,36%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.391.103,57	0,00	0,00	1.379.745,77	-11.357,80	-0,82%	-0,82%	11,99%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	124.363,34	0,00	0,00	122.152,13	-2.211,21	-1,78%	-1,78%	10,83%
Total Renda Variável	2.586.719,29	0,00	0,00	2.570.728,00	-15.991,29	-0,62%		8,20%