

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

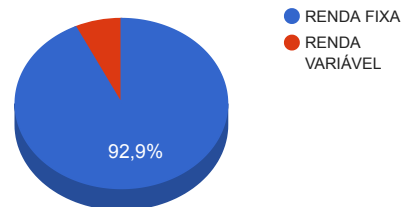
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			124.752,10	0,89%			Artigo 20
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.237.938,82	23,05%	413	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.681.259,87	19,09%	438	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.690.970,74	26,28%	1.249	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.592.930,33	11,34%	800	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.127.070,66	8,02%	672	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	593.231,40	4,22%	782	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	243.018,98	1,73%	142	0,05%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	754.167,63	5,37%	224	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	14.045.340,53				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 2019)

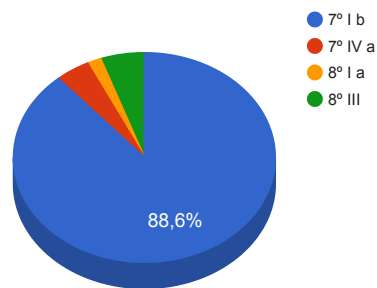
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.330.170,42	87,79%	40,00%	70,00%	100,00%	1.715.170,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	593.231,40	4,22%	0,00%	13,00%	40,00%	5.024.904,81
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	15,00%	2.106.801,08
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	243.018,98	1,73%	0,00%	2,00%	30,00%	3.970.583,18
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	2.809.068,11
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	754.167,63	5,37%	0,00%	6,00%	10,00%	650.366,42
Total Carteira		13.920.588,43					

RENDA FIXA	13.048.153,92	93,73%
RENDA VARIÁVEL	997.186,61	7,16%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2019		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 "	12.330.170,42	87,79%	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 "	593.231,40	4,22%	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 "	243.018,98	1,73%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	754.167,63	5,37%	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%
Total Renda Fixa	13.920.588,43	99,11%	40,00	690,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 2019)

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	13.920.588,43	99,11%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2019)

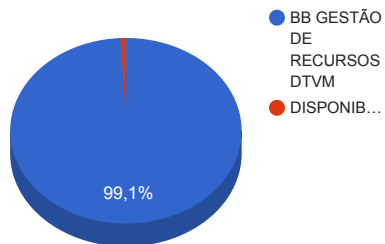
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	2,05%	3,43%	7,67%	9,88%	22,57%	0,20%	0,795%	3,04%
IDKA IPCA 2 Anos	0,53%	1,80%	3,07%	6,69%	10,19%	23,90%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	1,83%	3,07%	6,58%	9,55%	22,05%	0,20%	0,641%	2,35%
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,48%	1,02%	1,49%	3,03%	6,31%	15,93%	0,20%	0,007%	0,04%
IRF-M 1	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,02%	1,56%	3,65%	6,65%	16,91%	0,10%	0,083%	0,55%
IMA Geral ex-C	0,44%	2,36%	3,57%	8,62%	9,74%	21,94%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,40%	3,60%	8,69%	9,81%	21,35%	0,30%	1,180%	2,80%
IRF-M	0,29%	1,68%	3,24%	9,41%	9,94%	24,31%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	1,64%	3,18%	9,31%	9,71%	23,72%	0,20%	0,970%	3,40%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2019)

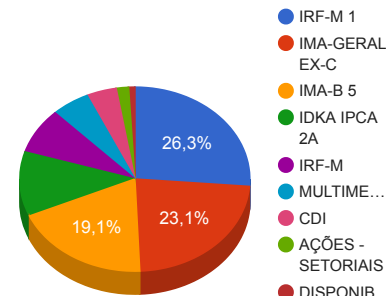
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,59%	1,42%	1,85%	4,43%	7,48%	21,77%	0,60%	0,297%	2,58%
IGC	-1,59%	8,25%	7,61%	25,52%	12,12%	41,65%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,80%	8,43%	7,49%	27,07%	14,37%	43,41%	1,00%	9,797%	20,82%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (fevereiro / 2019)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.920.588,43	99,11%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	124.752,10	0,89%



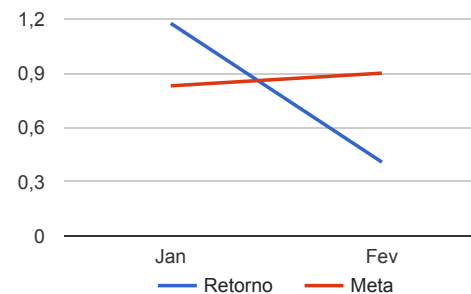
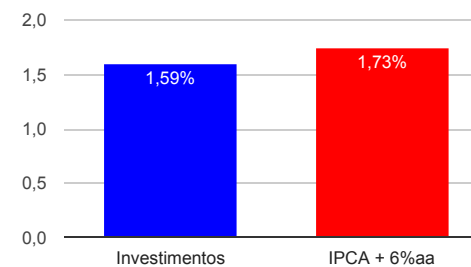
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.690.970,74	26,28%
IMA-GERAL EX-C	3.237.938,82	23,05%
IMA-B 5	2.681.259,87	19,09%
IDKA IPCA 2A	1.592.930,33	11,34%
IRF-M	1.127.070,66	8,02%
MULTIMERCADO	754.167,63	5,37%
CDI	593.231,40	4,22%
AÇÕES - SETORIAIS	243.018,98	1,73%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	124.752,10	0,89%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	13.574.386,44	1.500.000,00	1.500.000,00	13.733.920,12	159.533,68	1,18%	0,83%	141,32%	0,59%
Fevereiro	13.733.920,12	1.130.000,00	1.000.000,00	13.920.588,43	56.668,31	0,41%	0,90%	45,64%	0,79%
Acumulado no ano					216.201,99	1,59%	1,73%	91,60%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2019

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	1.583.323,94	0,00	0,00	1.592.930,33	9.606,39	0,61%	0,64%	0,61%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.667.273,62	0,00	0,00	2.681.259,87	13.986,25	0,52%	0,80%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	590.369,96	0,00	0,00	593.231,40	2.861,44	0,48%	0,01%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.674.844,86	0,00	0,00	3.690.970,74	16.125,88	0,44%	0,08%	0,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.225.393,75	0,00	0,00	3.237.938,82	12.545,07	0,39%	1,18%	0,39%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.992.713,99	130.000,00	1.000.000,00	1.127.070,66	4.356,67	0,21%	0,97%	0,28%
Total Renda Fixa					59.481,70	0,43%	0,65%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	750.000,00	0,00	754.167,63	4.167,63	0,56%	0,30%	0,59%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	250.000,00	0,00	243.018,98	-6.981,02	-2,79%	9,80%	-1,80%
Total Renda Variável					-2.813,39	-0,28%	2,61%	