

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2018)

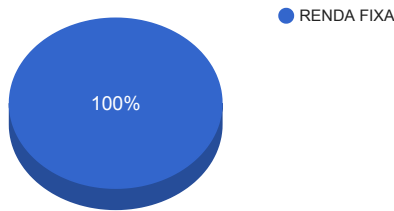
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			118.862,91	0,91%			Artigo 20
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.002.279,97	7,65%	370	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.851.478,36	14,13%	650	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.044.155,92	38,49%	1.267	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.512.141,84	11,54%	733	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.997.061,04	22,87%	315	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	578.607,29	4,42%	814	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	13.104.587,33				

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

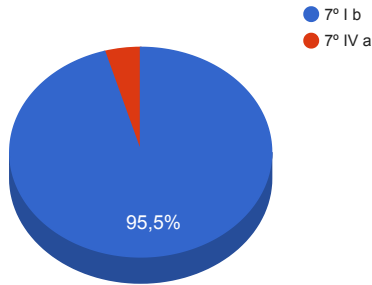
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.407.117,13	94,68%	90,00%	100,00%	100,00%	697.470,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	578.607,29	4,42%	0,00%	0,00%	40,00%	4.663.227,64
Total Carteira		12.985.724,42					

RENDA FIXA	13.104.587,33	100,92%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2018		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 "	12.407.117,13	94,68%	0,00%	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 "	578.607,29	4,42%	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 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 "	0,00	0,00%	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 III	0,00	0,00%	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	12 985 724,42	99,09%	0,00	655,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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)

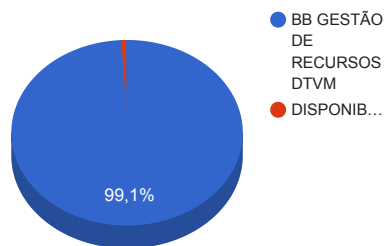
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.985.724,42	99,09%	0,00%

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

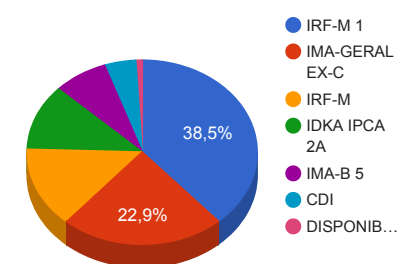
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,36%	6,14%	3,07%	3,04%	8,51%	23,34%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	5,58%	2,34%	2,47%	7,60%	21,30%	0,20%	0,881%	2,27%
IRF-M	1,30%	4,24%	1,83%	0,46%	5,74%	24,19%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	4,10%	1,80%	0,35%	5,53%	23,63%	0,20%	1,508%	3,14%
IMA-B 5	0,89%	4,98%	2,11%	1,40%	6,53%	20,86%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,87%	4,83%	2,07%	1,31%	6,32%	20,44%	0,20%	1,232%	2,89%
IMA Geral ex-C	0,61%	4,11%	1,77%	0,69%	5,18%	21,05%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	4,17%	1,58%	0,63%	4,99%	20,00%	0,30%	1,092%	2,60%
IRF-M 1	0,61%	4,85%	1,72%	2,99%	6,75%	20,26%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	4,66%	1,67%	2,86%	6,51%	19,70%	0,10%	0,163%	0,52%
CDI	0,47%	4,81%	1,59%	3,17%	6,65%	18,95%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,77%	1,57%	3,13%	6,69%	19,12%	0,20%	0,047%	0,07%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.985.724,42	99,09%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	118.862,91	0,91%



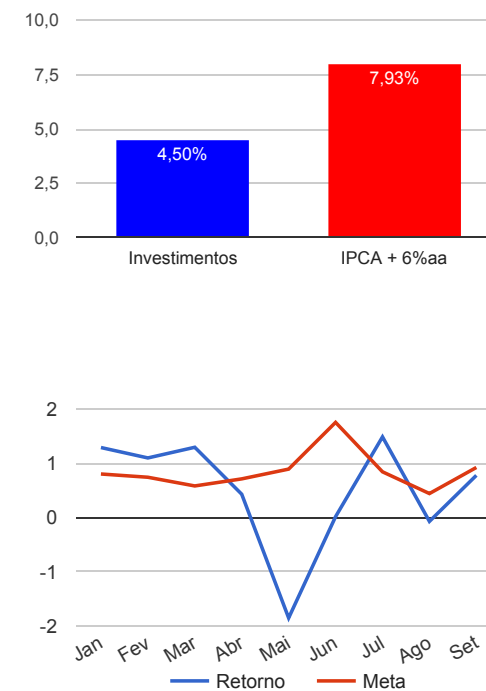
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	5.044.155,92	38,49%
IMA-GERAL EX-C	2.997.061,04	22,87%
IRF-M	1.851.478,36	14,13%
IDKA IPCA 2A	1.512.141,84	11,54%
IMA-B 5	1.002.279,97	7,65%
CDI	578.607,29	4,42%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	118.862,91	0,91%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	11.894.465,76	0,00	0,00	12.047.551,85	153.086,09	1,29%	0,80%	160,58%	0,89%
Fevereiro	12.047.551,85	150.000,00	0,00	12.331.154,26	133.602,41	1,10%	0,74%	148,34%	0,81%
Março	12.331.154,26	98.000,00	0,00	12.589.705,38	160.551,12	1,29%	0,58%	223,80%	0,76%
Abril	12.589.705,38	0,00	0,00	12.643.544,84	53.839,46	0,43%	0,71%	60,42%	0,83%
Mai	12.643.544,84	100.000,00	0,00	12.507.873,74	-235.671,10	-1,85%	0,89%	-208,09%	1,60%
Junho	12.507.873,74	0,00	0,00	12.509.700,72	1.826,98	0,01%	1,75%	0,83%	2,83%
Julho	12.509.700,72	0,00	0,00	12.695.234,54	185.533,82	1,48%	0,84%	176,21%	1,34%
Agosto	12.695.234,54	11.073.145,17	10.873.145,13	12.885.895,12	-9.339,46	-0,07%	0,44%	-16,36%	1,17%
Setembro	12.885.895,12	0,00	0,00	12.985.724,42	99.829,30	0,77%	0,92%	83,99%	0,73%
Acumulado no ano					543.258,62	4,50%	7,93%	56,66%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.828.063,74	0,00	0,00	1.851.478,36	23.414,62	1,28%	1,51%	1,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.494.635,86	0,00	0,00	1.512.141,84	17.505,98	1,17%	0,88%	1,17%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	993.680,94	0,00	0,00	1.002.279,97	8.599,03	0,87%	1,23%	0,87%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.979.175,76	0,00	0,00	2.997.061,04	17.885,28	0,60%	1,09%	0,60%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.014.561,85	0,00	0,00	5.044.155,92	29.594,07	0,59%	0,16%	0,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	575.776,97	0,00	0,00	578.607,29	2.830,32	0,49%	0,05%	0,49%
Total Renda Fixa					99.829,30	0,77%	0,73%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.509.700,72	0,00	10.873.145,13	1.851.478,36	214.922,77	2,83%	1,80%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.044.155,92	44.155,92	0,88%	1,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.500.000,00	0,00	1.512.141,84	12.141,84	0,81%	2,34%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	573.145,17	0,00	578.607,29	5.462,12	0,95%	1,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.002.279,97	2.279,97	0,23%	2,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.000.000,00	0,00	2.997.061,04	-2.938,96	-0,10%	1,58%
Total Renda Fixa					276.023,66	2,20%	