

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2019



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2019)

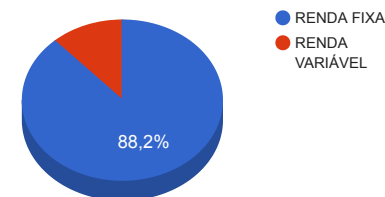
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.779.831,08	18,75%	1.230	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.697.138,80	18,19%	877	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.384.782,04	16,08%	597	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.193.453,80	14,79%	696	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.410.284,84	16,26%	517	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	608.237,23	4,10%	724	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	976.266,49	6,58%	168	0,19%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	777.792,64	5,25%	227	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			14.827.786,92				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			35.912,36	Artigo 6º			
Total			14.863.699,28				

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

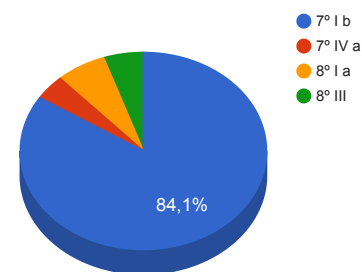
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.465.490,56	84,07%	40,00%	70,00%	100,00%	2.362.296,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	608.237,23	4,10%	0,00%	13,00%	40,00%	5.322.877,54
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	15,00%	2.224.168,04
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	976.266,49	6,58%	0,00%	2,00%	30,00%	3.472.069,59
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	2.965.557,38
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	777.792,64	5,25%	0,00%	6,00%	10,00%	704.986,05
Total Carteira		14.827.786,92					

RENDA FIXA	13.109.640,15	88,41%
RENDA VARIÁVEL	1.754.059,13	11,83%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 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 "	12.465.490,56	84,07%	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 "	608.237,23	4,10%	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 "	976.266,49	6,58%	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	777.792,64	5,25%	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	14.827.786,92	100,00%	40,00	690,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	14.827.786,92	100,00%	0,00%

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

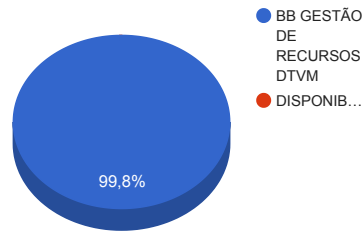
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,09%	8,14%	5,09%	6,66%	15,28%	24,57%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	8,01%	5,04%	6,55%	15,04%	24,05%	0,20%	0,631%	3,81%
IDKA IPCA 2 Anos	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	6,80%	3,06%	5,52%	11,69%	21,08%	0,20%	0,584%	1,96%
IMA-B 5	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	8,20%	4,09%	6,58%	13,86%	23,03%	0,20%	0,759%	2,93%
IMA Geral ex-C	0,95%	8,76%	4,79%	6,72%	15,13%	23,52%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	9,33%	5,29%	7,17%	15,58%	24,01%	0,30%	0,697%	3,60%
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,55%	3,57%	1,54%	3,03%	6,22%	13,77%	0,20%	0,003%	0,12%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

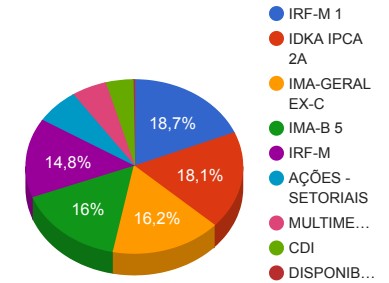
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	2,04%	18,25%	7,89%	7,50%	33,63%	50,67%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,66%	15,81%	6,27%	4,88%	31,29%	49,49%	1,00%	6,337%	15,70%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,41%	4,59%	1,88%	3,75%	7,15%	16,20%	0,60%	0,261%	1,39%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.827.786,92	100,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	35.912,36	0,24%



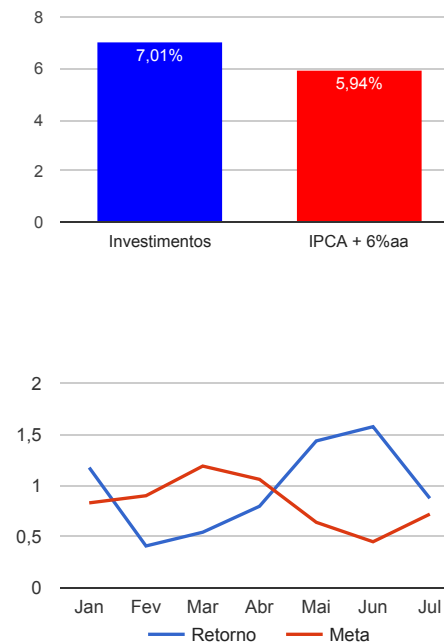
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.779.831,08	18,75%
IDKA IPCA 2A	2.697.138,80	18,19%
IMA-GERAL EX-C	2.410.284,84	16,26%
IMA-B 5	2.384.782,04	16,08%
IRF-M	2.193.453,80	14,79%
AÇÕES - SETORIAIS	976.266,49	6,58%
MULTIMERCADO	777.792,64	5,25%
CDI	608.237,23	4,10%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	35.912,36	0,24%



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%
Março	13.920.588,43	0,00	0,00	13.996.197,93	75.609,50	0,54%	1,19%	45,51%	1,17%
Abril	13.996.197,93	170.000,00	120.000,00	14.158.137,63	111.939,70	0,80%	1,06%	75,22%	0,63%
Mai	14.158.137,63	2.650.000,00	2.600.000,00	14.412.143,74	204.006,11	1,44%	0,64%	224,12%	1,21%
Junho	14.412.143,74	0,00	0,00	14.639.158,89	227.015,15	1,58%	0,45%	349,77%	1,28%
Julho	14.639.158,89	60.000,00	0,00	14.827.786,92	128.628,03	0,88%	0,72%	120,82%	0,89%
Acumulado no ano					963.400,48	7,01%	5,94%	117,96%	

Acumulado no Ano



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

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	2.170.166,80	0,00	0,00	2.193.453,80	23.287,00	1,07%	0,63%	1,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.386.015,85	0,00	0,00	2.410.284,84	24.268,99	1,02%	0,70%	1,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.670.905,70	0,00	0,00	2.697.138,80	26.233,10	0,98%	0,58%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.302.169,22	60.000,00	0,00	2.384.782,04	22.612,82	0,96%	0,76%	0,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.760.529,64	0,00	0,00	2.779.831,08	19.301,44	0,70%	0,12%	0,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	604.915,16	0,00	0,00	608.237,23	3.322,07	0,55%	0,00%	0,55%
Total Renda Fixa					119.025,42	0,92%	0,52%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	969.849,50	0,00	0,00	976.266,49	6.416,99	0,66%	6,34%	0,66%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	774.607,02	0,00	0,00	777.792,64	3.185,62	0,41%	0,26%	0,41%
Total Renda Variável					9.602,61	0,55%	3,64%	