

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2018



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

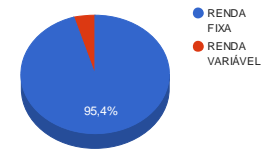
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			146.006,93	0,91%			Artigo 20
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.458.794,39	27,72%	1.268	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.336.510,71	20,74%	311	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.060.497,08	25,24%	748	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.836.993,05	11,42%	505	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	172.145,69	1,07%	677	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.343.601,85	8,35%	815	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	732.894,61	4,56%	955	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	16.087.444,31				

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

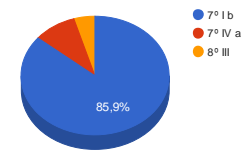
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	13.692.795,23	85,11%	60,00%	65,00%	100,00%	2.394.649,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	9.652.466,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	1.515.747,54	9,42%	0,00%	10,00%	30,00%	3.310.485,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	804.372,22
Total Renda Fixa	100,00%	15.208.542,77	94,54%	60,00	85,00	235,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	732.894,61	4,56%	0,00%	5,00%	15,00%	1.680.222,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	804.372,22
Total Renda Variável	30,00%	732.894,61	4,56%	0,00	10,00	50,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	13.692.795,23	85,11%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.515.747,54	9,42%	0,00%	30,00%
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%	5,00%	5,00%
Total Renda Fixa	15.208.542,77	94,54%	55,00	215,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	732.894,61	4,56%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	732.894,61	4,56%	0,00	45,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	15.208.542,77	94,54%	0,00%
Caixa Econômica Federal	732.894,61	4,56%	0,00%

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

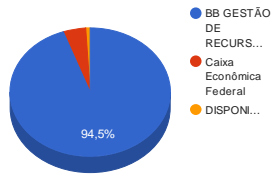
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	7,14%	10,23%	6,50%	5,19%	10,29%	26,38%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,07%	9,97%	6,40%	5,03%	10,00%	25,72%	0,20%	3,962%	5,48%
IMA Geral ex-C	3,43%	7,67%	3,81%	3,83%	8,63%	23,97%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,50%	7,82%	3,71%	3,93%	8,65%	23,07%	0,30%	1,886%	2,83%
IDKA IPCA 2 Anos	1,95%	8,21%	3,43%	4,19%	9,75%	25,22%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	7,79%	3,21%	3,90%	9,03%	23,32%	0,20%	0,977%	2,33%
IRF-M 1	0,92%	5,81%	1,97%	3,41%	7,06%	20,23%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	5,64%	1,93%	3,32%	6,85%	19,69%	0,10%	0,273%	0,55%
CDI	0,54%	5,38%	1,59%	3,20%	6,55%	18,35%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	5,32%	1,58%	3,15%	6,53%	18,49%	0,20%	0,009%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	4,43%	1,31%	2,63%	5,41%	16,02%	1,00%	0,003%	0,02%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2018)

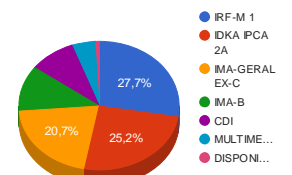
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	10,19%	14,43%	10,35%	1,52%	17,65%	34,66%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3,11%	-	-	-	-	-	1,60%	1,751%	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.208.542,77	94,54%
Caixa Econômica Federal	732.894,61	4,56%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	146.006,93	0,91%

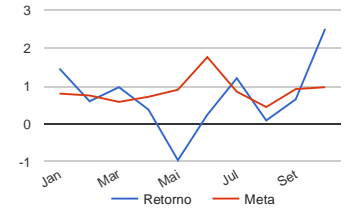
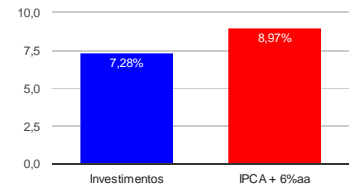


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.458.794,39	27,72%
IDKA IPCA 2A	4.060.497,08	25,24%
IMA-GERAL EX-C	3.336.510,71	20,74%
IMA-B	1.836.993,05	11,42%
CDI	1.515.747,54	9,42%
MULTIMERCADO	732.894,61	4,56%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	146.006,93	0,91%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.715.693,13	0,00	0,00	1.836.993,05	121.299,92	7,07%	3,96%	7,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.223.779,95	0,00	0,00	3.336.510,71	112.730,76	3,50%	1,89%	3,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.977.380,65	0,00	0,00	4.060.497,08	83.116,43	2,09%	0,98%	2,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.417.498,17	0,00	0,00	4.458.794,39	41.296,22	0,93%	0,27%	0,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.336.507,94	0,00	0,00	1.343.601,85	7.093,91	0,53%	0,01%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	171.375,17	0,00	0,00	172.145,69	770,52	0,45%	0,00%	0,45%
				Total Renda Fixa	366.307,76	2,47%	1,23%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	710.823,02	0,00	0,00	732.894,61	22.071,59	3,11%	1,75%	3,11%
Total Renda Variável					22.071,59	3,11%	1,75%	

