

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 2019)

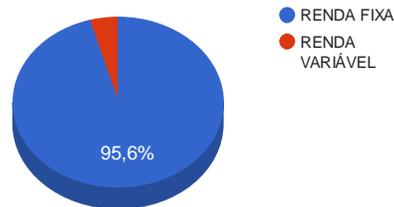
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			66.817,45	0,39%			Artigo 20
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.469.385,36	20,12%	377	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.164.610,67	24,15%	780	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.388.191,32	13,85%	525	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.863.927,59	28,20%	1.263	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.363.678,19	7,91%	793	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	174.326,85	1,01%	673	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	756.401,81	4,39%	955	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	17.247.339,24				

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

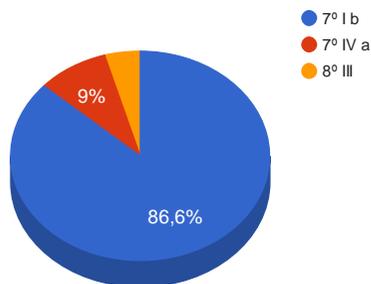
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	14.886.114,94	86,31%	0,00%	0,00%	0,00%	-14.886.114,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	1.538.005,04	8,92%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.538.005,04
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	756.401,81	4,39%	0,00%	0,00%	0,00%	-756.401,81
Total Carteira		17.180.521,79					

RENDA FIXA	16.490.937,43	95,99%
RENDA VARIÁVEL	756.401,81	4,40%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	14.886.114,94	86,31%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.538.005,04	8,92%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	756.401,81	4,39%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	17.180.521,79	99,61%	0,00	0,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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	16.424.119,98	95,23%	0,00%
Caixa Econômica Federal	756.401,81	4,39%	0,00%

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

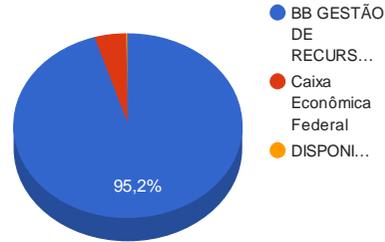
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	4,37%	4,37%	7,05%	14,01%	14,11%	30,65%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,36%	4,36%	7,01%	13,86%	13,82%	30,01%	0,20%	1,735%	5,46%
IMA Geral ex-C	1,91%	1,91%	3,92%	7,88%	10,04%	24,12%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	2,01%	3,98%	7,84%	10,21%	23,62%	0,30%	0,839%	2,77%
IDKA IPCA 2 Anos	1,26%	1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	1,22%	2,56%	5,85%	9,50%	22,93%	0,20%	0,607%	2,36%
IRF-M 1	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	0,58%	1,64%	3,60%	6,75%	17,55%	0,10%	0,109%	0,55%
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	0,53%	1,49%	3,10%	6,29%	16,40%	0,20%	0,003%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	0,45%	1,27%	2,59%	5,24%	13,98%	1,00%	0,003%	0,01%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

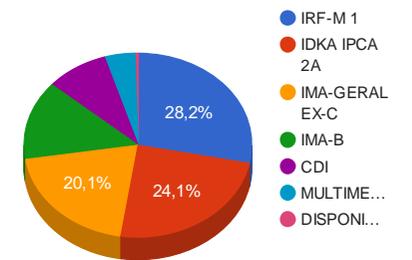
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	10,82%	10,82%	11,40%	22,94%	14,70%	50,60%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,99%	0,99%	3,21%	-	-	-	1,60%	0,784%	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.424.119,98	95,23%
Caixa Econômica Federal	756.401,81	4,39%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	66.817,45	0,39%

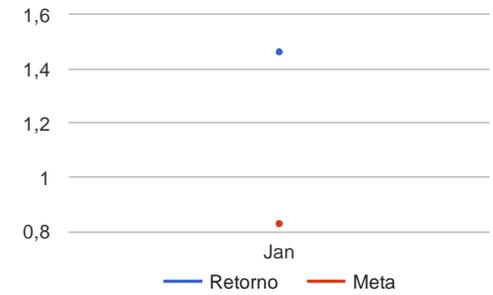
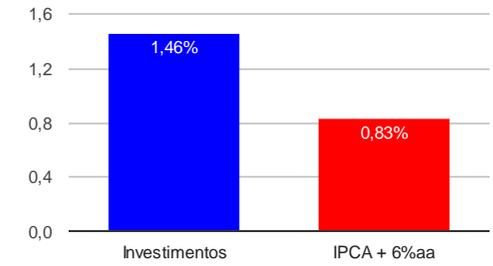


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	4.863.927,59	28,20%
IDKA IPCA 2A	4.164.610,67	24,15%
IMA-GERAL EX-C	3.469.385,36	20,12%
IMA-B	2.388.191,32	13,85%
CDI	1.538.005,04	8,92%
MULTIMERCADO	756.401,81	4,39%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	66.817,45	0,39%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos ap6s as movimentac6es (aplica6es e resgates) no m6s de janeiro / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplica6es	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - M6s (%)	Institui66o(%)
BB IMA-B T6TULOS P6BLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI6RIO	1.883.623,56	418.336,01	0,00	2.388.191,32	86.231,75	3,75%	1,73%	4,36%
BB ALOCA66O ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCI6RIO	3.401.086,37	0,00	0,00	3.469.385,36	68.298,99	2,01%	0,84%	2,01%
BB IDKA 2 T6TULOS P6BLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI6RIO	4.114.604,88	0,00	0,00	4.164.610,67	50.005,79	1,22%	0,61%	1,22%
BB IRF-M 1 T6TULOS P6BLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCI6RIO	4.836.104,16	0,00	0,00	4.863.927,59	27.823,43	0,58%	0,11%	0,58%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCI6RIO LP	1.356.485,38	0,00	0,00	1.363.678,19	7.192,81	0,53%	0,00%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCI6RIO	173.549,34	0,00	0,00	174.326,85	777,51	0,45%	0,00%	0,45%
Total Renda Fixa					240.330,28	1,49%	0,62%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	749.016,43	0,00	0,00	756.401,81	7.385,38	0,99%	0,78%	0,99%
Total Renda Variável					7.385,38	0,99%	0,78%	

