

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2019)

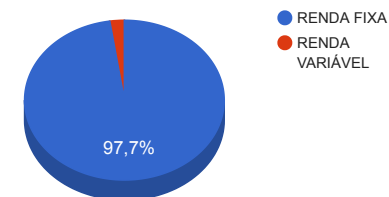
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	16.791.785,36	17,70%	552	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.643.375,38	14,38%	876	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.011.018,68	18,98%	74	7,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	4.149.973,20	4,37%	334	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.729.800,40	15,52%	681	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.728.727,51	7,09%	913	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.450.423,59	1,53%	1.212	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	13.181.217,47	13,89%	643	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.084.431,95	3,25%	608	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	895.443,16	0,94%	729	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.229.156,33	2,35%	214	0,42%	Artigo 8º, Inciso III
Total			94.895.353,03				

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

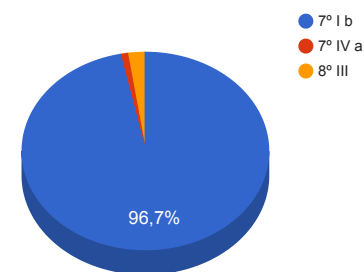
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	91.770.753,54	96,71%	50,00%	60,00%	100,00%	3.124.599,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	895.443,16	0,94%	0,00%	25,00%	40,00%	37.062.698,05
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	18.979.070,61
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.229.156,33	2,35%	0,00%	10,00%	10,00%	7.260.378,97
Total Carteira		94.895.353,03					

RENDA FIXA	92.666.196,70	97,65%
RENDA VARIÁVEL	2.229.156,33	2,35%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	91.770.753,54	96,71%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	895.443,16	0,94%	0,00%	40,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.229.156,33	2,35%	0,00%	10,00%
Total	94.895.353,03	100,00%	50,00	170,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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	56.974.389,37	60,04%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	19.909.944,98	20,98%	0,00%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	18.011.018,68	18,98%	0,16%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,73%	26,55%	4,48%	17,54%	44,85%	43,66%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	26,14%	4,42%	17,32%	44,24%	42,79%	0,20%	2,783%	11,11%
IMA-B	2,86%	19,55%	3,77%	13,27%	31,37%	34,72%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,85%	19,32%	3,72%	13,15%	31,00%	34,05%	0,20%	1,966%	7,30%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2,79%	17,75%	3,63%	12,35%	27,42%	31,07%	0,20%	1,910%	6,19%
IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,72%	10,10%	2,74%	7,07%	15,16%	22,44%	0,20%	1,010%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,72%	10,08%	2,72%	7,04%	15,21%	22,44%	0,20%	1,012%	2,86%
IDKA IPCA 2 Anos	1,60%	9,13%	2,72%	6,49%	12,85%	22,46%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	8,36%	2,46%	5,73%	12,10%	20,62%	0,20%	0,887%	1,93%
IMA Geral ex-C	1,46%	10,53%	2,59%	7,40%	16,57%	22,60%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	11,06%	2,62%	7,89%	17,17%	23,01%	0,30%	0,853%	3,32%
IRF-M 1	0,64%	5,31%	1,92%	3,72%	7,44%	14,70%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	5,12%	1,85%	3,60%	7,22%	14,20%	0,10%	0,117%	0,47%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	3,82%	1,25%	2,54%	5,13%	10,94%	1,00%	0,008%	0,10%
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-

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

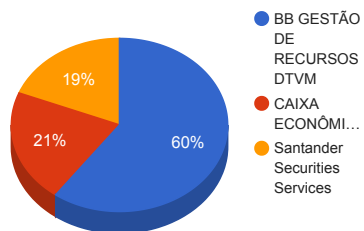
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,12%	14,38%	3,11%	10,02%	18,30%	25,15%	0,002	1,371%	3,53%

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

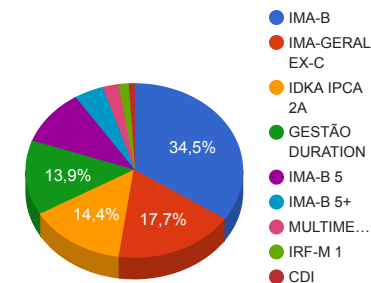
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,30%	6,51%	2,25%	4,57%	8,42%	16,47%	0,60%	0,833%	0,84%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.974.389,37	60,04%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	19.909.944,98	20,98%
Santander Securities Services	18.011.018,68	18,98%



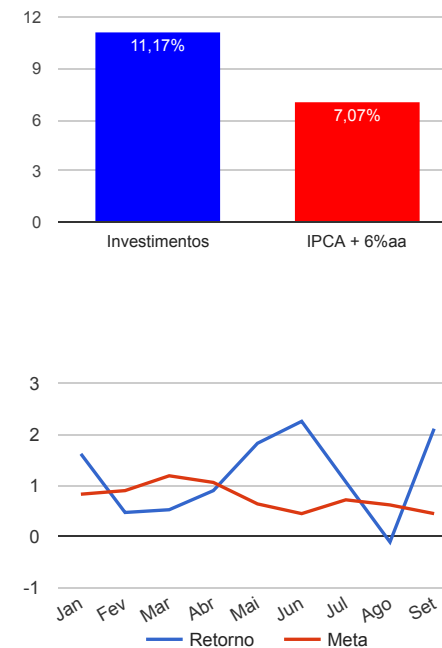
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	32.740.819,08	34,50%
IMA-GERAL EX-C	16.791.785,36	17,70%
IDKA IPCA 2A	13.643.375,38	14,38%
GESTÃO DURATION	13.181.217,47	13,89%
IMA-B 5	9.813.159,46	10,34%
IMA-B 5+	4.149.973,20	4,37%
MULTIMERCADO	2.229.156,33	2,35%
IRF-M 1	1.450.423,59	1,53%
CDI	895.443,16	0,94%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	81.228.243,99	4.660.827,36	4.357.703,38	82.851.161,93	1.319.793,96	1,62%	0,83%	194,65%	0,71%
Fevereiro	82.851.161,93	3.662.305,57	2.697.530,49	84.212.141,33	396.204,32	0,47%	0,90%	52,79%	0,99%
Março	84.212.141,33	2.168.598,52	1.671.565,75	85.154.817,47	445.643,37	0,53%	1,19%	44,08%	1,63%
Abril	85.154.817,47	1.478.779,34	1.324.186,03	86.077.263,42	767.852,64	0,90%	1,06%	84,95%	0,71%
Mai	86.077.263,42	26.048.227,90	25.315.017,27	88.395.799,96	1.585.325,91	1,83%	0,64%	285,05%	1,18%
Junho	88.395.799,96	6.998.505,87	6.420.894,88	90.980.009,43	2.006.598,48	2,26%	0,45%	500,79%	1,47%
Julho	90.980.009,43	5.848.986,57	5.413.501,90	92.393.171,32	977.677,22	1,07%	0,72%	147,67%	0,96%
Agosto	92.393.171,32	1.845.743,48	1.745.166,92	92.395.851,88	-97.896,00	-0,11%	0,62%	-17,06%	1,67%
Setembro	92.395.851,88	1.885.728,02	1.347.657,31	94.895.353,03	1.961.430,44	2,11%	0,45%	472,63%	1,38%
Acumulado no ano					9.362.630,34	11,17%	7,07%	157,86%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.001.613,93	0,00	0,00	4.149.973,20	148.359,27	3,71%	2,78%	3,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.285.324,22	36.969,69	0,00	14.729.800,40	407.506,49	2,85%	1,97%	2,85%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	16.636.264,56	890.087,65	0,00	18.011.018,68	484.666,47	2,77%	1,91%	2,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	12.907.789,16	0,00	0,00	13.181.217,47	273.428,31	2,12%	1,37%	2,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.032.266,49	0,00	0,00	3.084.431,95	52.165,46	1,72%	1,01%	1,72%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.614.942,34	0,00	0,00	6.728.727,51	113.785,17	1,72%	1,01%	1,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.543.806,03	0,00	0,00	16.791.785,36	247.979,33	1,50%	0,85%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.793.499,59	0,00	344.934,86	13.643.375,38	194.810,65	1,41%	0,89%	1,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.487.869,47	0,00	46.606,82	1.450.423,59	9.160,94	0,62%	0,12%	0,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	891.914,42	958.670,68	956.115,63	895.443,16	973,69	0,05%	0,01%	0,37%
Total Renda Fixa					1.932.835,78	2,13%	1,40%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.200.561,67	0,00	0,00	2.229.156,33	28.594,66	1,30%	0,83%	1,30%
Total Renda Variável					28.594,66	1,30%	0,83%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	15.629.859,39	1.761.049,95	0,00	18.011.018,68	620.109,34	3,61%	3,63%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.091.580,85	110.918,95	0,00	14.729.800,40	527.300,60	3,72%	3,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.363.361,61	0,00	0,00	16.791.785,36	428.423,75	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	12.783.054,21	0,00	0,00	13.181.217,47	398.163,26	3,11%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.652.202,06	0,00	344.934,86	13.643.375,38	336.108,18	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.678.094,94	882.399,17	0,00	6.728.727,51	168.233,40	2,69%	2,72%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.000.000,00	0,00	4.149.973,20	149.973,20	3,75%	4,42%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.002.235,45	0,00	0,00	3.084.431,95	82.196,50	2,74%	2,74%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.726.819,75	0,00	5.332.174,78	1.450.423,59	55.778,62	1,64%	1,85%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	872.735,49	2.826.090,00	2.829.216,49	895.443,16	25.834,16	1,43%	1,25%
Total Renda Fixa					2.792.121,01	3,11%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.180.065,68	0,00	0,00	2.229.156,33	49.090,65	2,25%	2,25%
Total Renda Variável					49.090,65	2,25%	