

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020

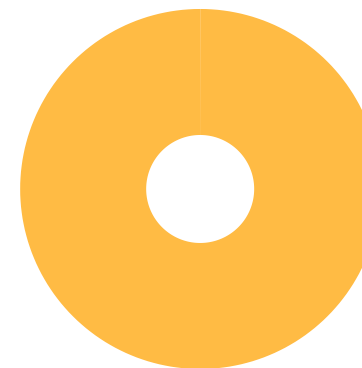


**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	685.570,78	43,00%	312	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	138.827,91	8,71%	653	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	19.714,66	1,24%	397	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	82.308,82	5,16%	582	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	667.975,50	41,90%	98	0,82%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>1.594.397,67</b>				

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2020)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	824.398,69	51,71%	20,00%	30,00%	90,00%	610.559,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	956.638,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	102.023,48	6,40%	5,00%	25,00%	40,00%	535.735,59
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	239.159,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	667.975,50	41,90%	0,00%	5,00%	5,00%	-588.255,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	79.719,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	79.719,88
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>1.594.397,67</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>220,00%</b>	

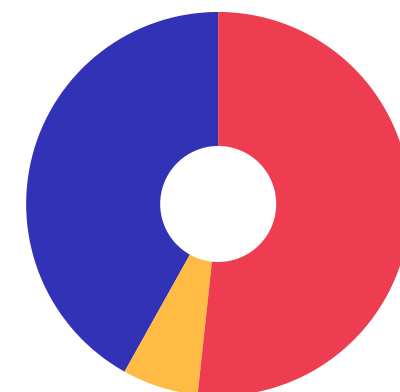


RENDA FIXA 1.594.397,67

**⚠ ATENÇÃO!** Limite cumulativo em desacordo com a Resolução!

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2020)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	20,00%	318.879,53
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	159.439,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	79.719,88
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>14,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00%</b>	



7º I b    7º IV a    7º VII a

**Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Outubro / 2020)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	926.422,17	58,10	-
PETRA CAPITAL	667.975,50	41,90	-

**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)

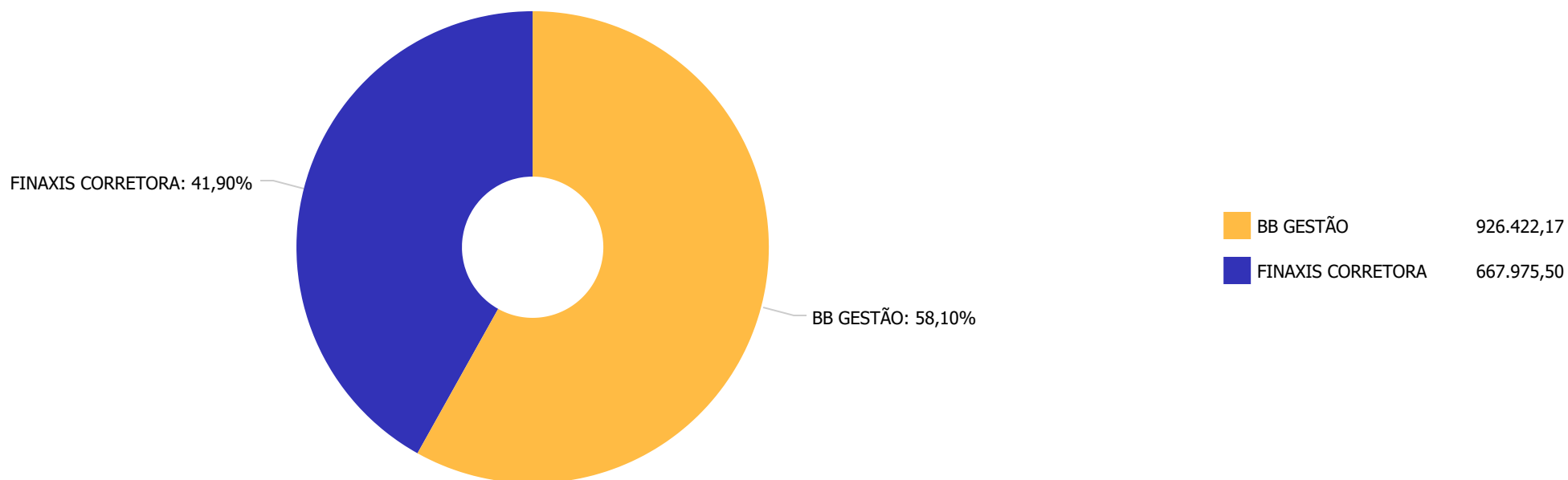
**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	824.398,69	51,71	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	102.023,48	6,40	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	667.975,50	41,90	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 II, Alínea ' a '	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

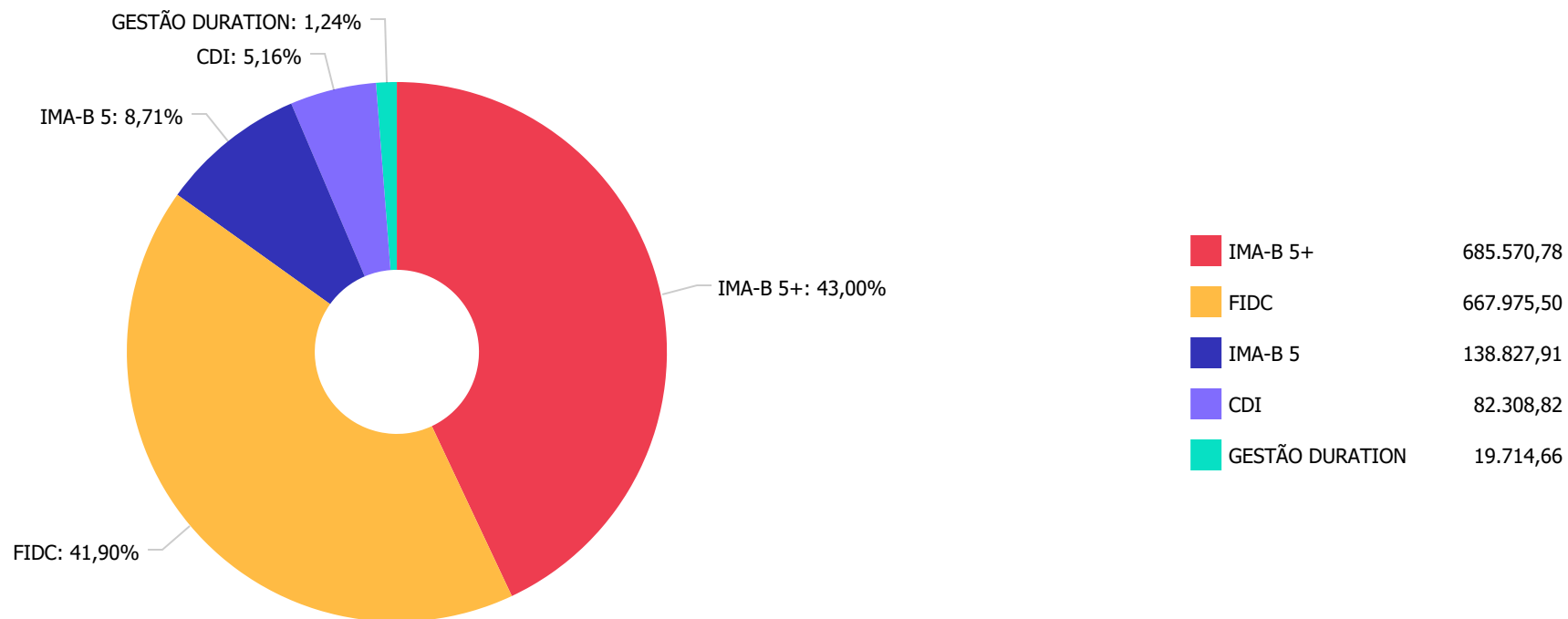
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,22%	-4,35%	-5,92%	4,90%	-5,85%	28,98%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	-4,63%	-6,05%	4,65%	-6,05%	28,32%	0,03%	0,16%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,20%	4,72%	0,50%	4,81%	5,71%	20,28%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,19%	4,50%	0,40%	4,62%	5,42%	19,71%	0,01%	0,03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,16%	1,98%	0,37%	1,12%	2,69%	8,87%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-4,54%	6,25%	-3,44%	-4,89%	-13,61%	0,00%	0,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	-	-1,99%	2,03%	-	-	0,01%	-

**Distribuição dos ativos por Administradores - base (Outubro / 2020)**



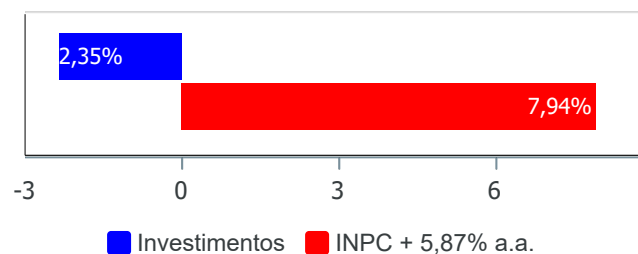
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.128.083,55	47.145,98	403.210,41	769.023,75	-2.995,37	-2.995,37	-0,27%	-0,27%	0,69%	0,69%	-38,47%	0,59%
Fevereiro	769.023,75	1.914.597,25	0,00	2.684.121,84	500,84	-2.494,53	0,02%	-0,25%	0,58%	1,27%	-19,39%	0,05%
Março	2.684.121,84	745.331,24	2.472.046,66	954.040,44	-3.365,98	-5.860,51	-0,13%	-0,37%	0,68%	1,96%	-18,96%	0,80%
Abril	954.040,44	49.226,73	137.650,30	865.058,02	-558,85	-6.419,36	-0,06%	-0,43%	0,22%	2,19%	-19,66%	0,44%
Mai	865.058,02	1.415.072,21	1.378.072,70	903.972,85	1.915,32	-4.504,04	0,08%	-0,35%	0,20%	2,40%	-14,47%	0,18%
Junho	903.972,85	888.956,45	0,00	1.792.920,83	-8,47	-4.512,51	0,00%	-0,35%	0,78%	3,19%	-10,88%	0,12%
Julho	1.792.920,83	79.340,72	964.149,38	853.598,71	-54.513,46	-59.025,97	-3,04%	-3,38%	0,96%	4,19%	-80,65%	10,53%
Agosto	853.598,71	1.016.647,77	965.933,80	942.332,38	38.019,70	-21.006,27	2,03%	-1,41%	0,84%	5,06%	-27,92%	10,14%
Setembro	942.332,38	1.378.175,56	1.299.295,99	1.010.546,70	-10.665,25	-31.671,52	-0,46%	-1,87%	1,35%	6,48%	-28,80%	0,91%
Outubro	1.010.546,70	591.691,37	0,00	1.594.397,67	-7.840,40	-39.511,92	-0,49%	-2,35%	1,37%	7,94%	-29,55%	1,55%

**Investimentos x Meta Atuarial**



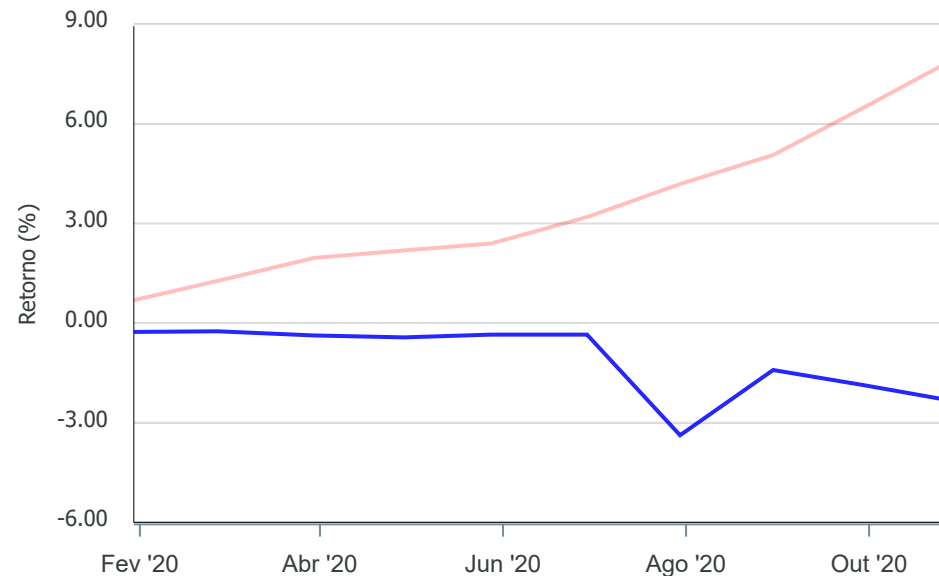
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos  Meta Atuarial  CDI  IMA-B  IMA-B 5
- IMA-B 5+  IMA Geral  IRF-M  IRF-M 1  IRF-M 1+
- Ibovespa  IBX  SMLL  IDIV

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2020****FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	138.569,25	0,00	0,00	138.827,91	258,66	0,19%	0,19%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	82.177,84	0,00	0,00	82.308,82	130,98	0,16%	0,16%	0,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	19.728,88	0,00	0,00	19.714,66	-14,22	-0,07%	-0,07%	1,48%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	669.017,31	0,00	0,00	667.975,50	-1.041,81	-0,16%	-0,16%	0,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	101.053,42	591.691,37	0,00	685.570,78	-7.174,01	-1,04%	0,20%	3,30%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.010.546,70</b>	<b>591.691,37</b>	<b>0,00</b>	<b>1.594.397,67</b>	<b>-7.840,40</b>	<b>-0,49%</b>		<b>1,55%</b>