

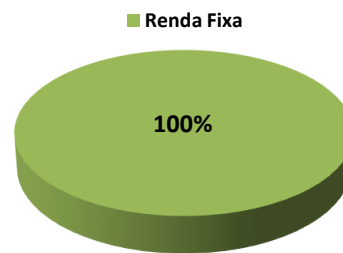


Relatório de Acompanhamento da Carteira de Investimentos - Fundo Financeiro
Setembro /2012

Evolução do Patrimônio



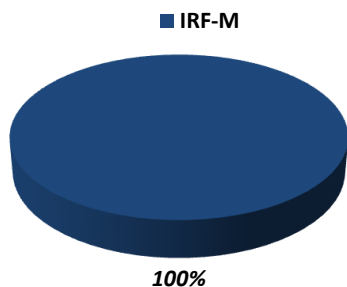
Distribuição por segmento



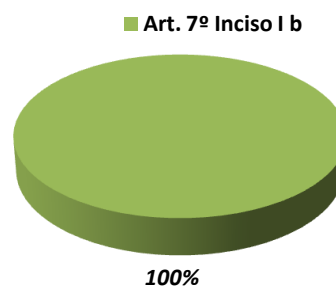
Enquadramento Legal - Resolução CMN nº 3.922/10

<u>Tipo de Fundo de Investimento</u>	<u>Fundo de Investimento</u>	<u>Enquadrament</u> <u>o</u>	<u>Limites</u> <u>Legais por</u> <u>fundo</u>	<u>% da Carteira</u>	<u>Rentabilidade do fundo</u>			<u>Risco</u>	
					<u>set-12</u>	<u>2012</u>	<u>12 Meses</u>	<u>V@R¹</u>	<u>Volatilidad</u> <u>e no ano²</u>
a) Renda Fixa									
Renda Fixa IRF-M - 100% TPF	BB Previdenciário RF IRF-M Títulos Públ Art. 7º Inciso I b		100%	100,00%	0,60%	10,94%	14,25%	0,22%	2,08%

Distribuição por Parâmetro de Rentabilidade

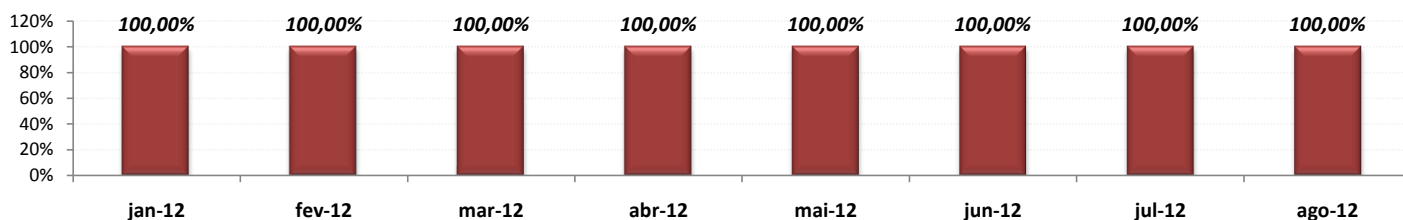


Distribuição por Enquadramento legal



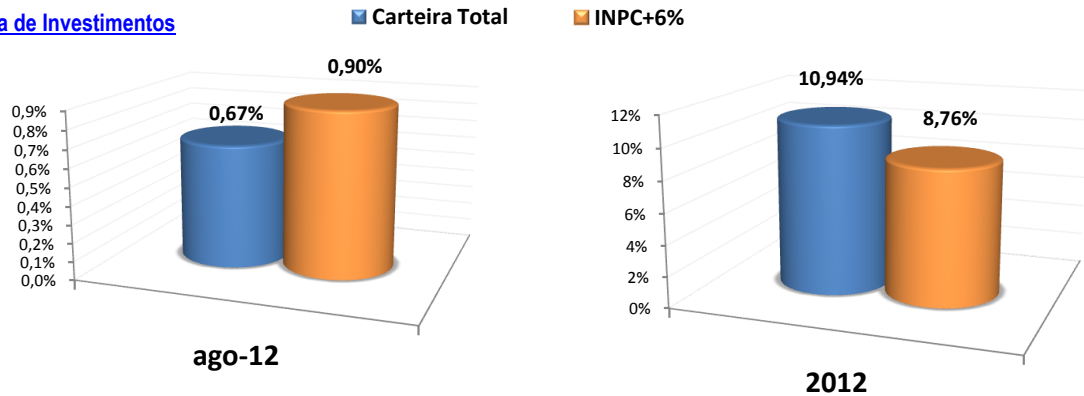
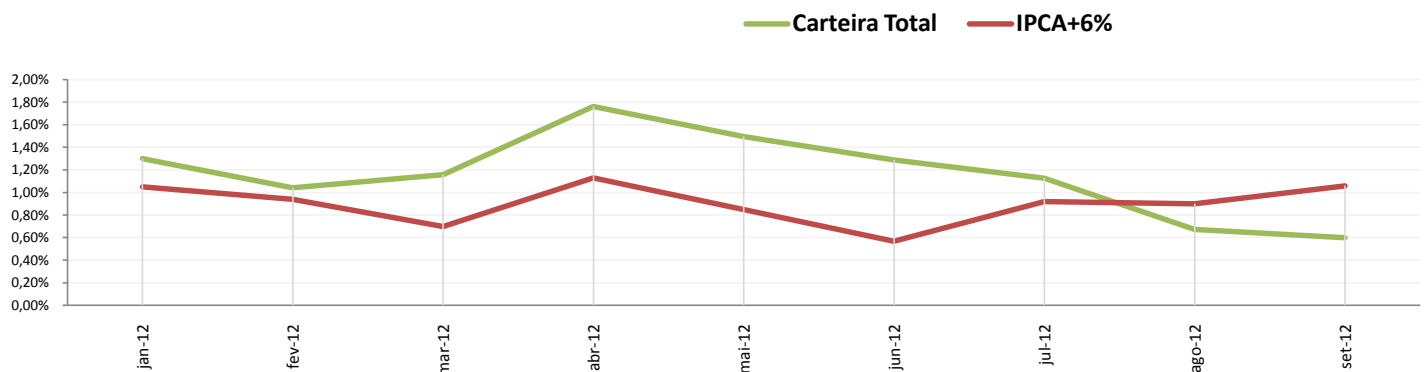
Participação por fundo de Investimento

■ BB Previdenciário RF IRF-M Títulos Públicos FI

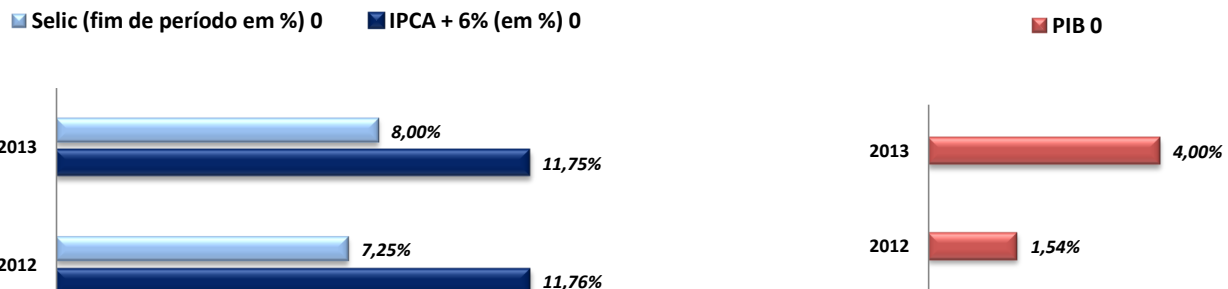


¹ A medida de risco do fundo utilizada é o V.A.R. - Value at Risk, que indica a maior perda esperada com base em simulação histórica, para o intervalo de 1 (um) dia e nível de confiança de 95%. É expresso em % sobre o Patrimônio Líquido do fundo. Ex.: para cada R\$ 1 milhão aplicado em um fundo com VAR igual a 0,10%, a perda máxima esperada para 1 dia é de R\$ 1 mil.

² Volatilidade: A volatilidade é uma medida de risco dos fundos. Formalmente, a volatilidade de um fundo é o desvio padrão da série de retornos do mesmo. Quanto maior a volatilidade de um fundo, maior o seu risco

Relatório de Acompanhamento da Carteira de Investimentos - Fundo Financeiro
Setembro /2012Rentabilidade da Carteira de InvestimentosRentabilidade diária da Carteira de InvestimentosIndicadores de Mercado

	INPC+6%	IPCA+6%	CDI	IMA-B	IMA-B 5	IMA-B 5+	IDkA IPCA 2 Anos	IDkA IPCA 20 Anos	IRF-M	IRF-M 1	IRF-M 1+	IMA Geral ex-C	IBOVES PA	IGC	IBRX	ICON	IDIV
set/12	1,12%	1,06%	0,54%	1,44%	1,65%	1,26%	1,75%	0,71%	0,59%	0,55%	0,61%	0,88%	3,70%	2,30%	2,78%	5,44%	0,66%
2012	8,76%	8,41%	6,59%	19,11%	12,20%	24,43%	12,35%	35,89%	10,97%	7,60%	13,21%	12,47%	4,27%	10,99%	6,39%	27,06%	10,15%
12 meses	11,91%	11,60%	9,43%	23,80%	14,72%	31,28%	14,60%	47,45%	14,34%	10,44%	16,95%	16,04%	13,09%	19,78%	16,31%	43,60%	25,12%

Projeções de Indicadores de MercadoRelatório Focus-Bacen (<http://www4.bcb.gov.br/pec/GCI/PORT/readout/readout.asp>)

Data-base: 00/01/00

A rentabilidade obtida no passado não representa a garantia de resultados futuros. A rentabilidade divulgada não é líquida de impostos. O parâmetro de rentabilidade é uma referência de rendimento a ser perseguida pelo fundo e não uma garantia de rentabilidade. Fundos de Investimento não contam com garantia do administrador do fundo, do gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor do Crédito – FGC; Leia o prospecto e o regulamento antes de investir. Este documento é distribuído unicamente a título informativo. . Opiniões e estimativas do Banco do Brasil podem mudar a qualquer momento sem prévio aviso. Não devem ser utilizadas para embasar nenhum procedimento administrativo perante órgãos fiscalizadores ou reguladores sem prévia autorização de seu autor.