

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 2018)

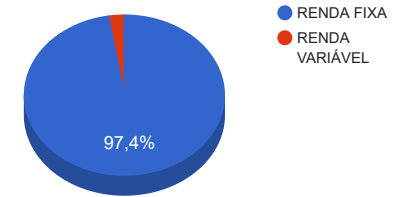
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	11.175.025,80	31,01%	1.220	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.260.246,04	11,82%	31	1,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.874.823,36	13,53%	19	4,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.174.016,87	11,58%	734	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.144.248,07	3,17%	685	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.650.760,92	7,35%	64	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.285.720,08	3,57%	736	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	418.657,97	1,16%	145.535	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.562.667,57	4,34%	234	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.246.449,86	9,01%	2.565	0,71%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 a D+35	Não há	317.057,61	0,88%	11	5,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	932.000,00	2,59%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			36.041.674,15				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			206.706,67				Artigo 6º
Total			36.248.380,82				

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

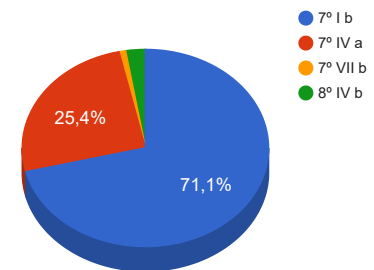
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	25.628.360,14	71,11%	15,00%	25,00%	70,00%	-399.188,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	15,00%	60,00%	21.625.004,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	9.164.256,40	25,43%	5,00%	15,00%	30,00%	1.648.245,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.802.083,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	317.057,61	0,88%	2,00%	5,00%	5,00%	1.485.026,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.802.083,71
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	3.604.167,42
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	3.604.167,42
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	3.604.167,42
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.802.083,71
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	932.000,00	2,59%	2,00%	5,00%	5,00%	870.083,71
Total Carteira		36.041.674,15					

RENDA FIXA	35.316.380,82	97,99%
RENDA VARIÁVEL	932.000,00	2,59%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	25.628.360,14	71,11%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	9.164.256,40	25,43%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	317.057,61	0,88%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	932.000,00	2,59%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	36.041.674,15	100,00%	0,00	0,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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
BANESTES DTVM	15.032.280,18	41,71%	0,40%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.737.931,84	35,34%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.954.404,52	22,07%	0,00%
OLIVEIRA TRUST	317.057,61	0,88%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,40%	3,40%	3,46%	6,35%	14,49%	42,84%	-	-	-
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,67%	4,67%	4,20%	7,22%	14,95%	46,05%	0,20%	2,715%	10,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,37%	3,37%	3,39%	6,21%	14,24%	42,39%	0,20%	1,795%	9,09%

IRF-M	1,30%	1,30%	2,65%	5,38%	14,09%	40,05%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	1,29%	2,59%	5,25%	13,78%	39,58%	0,20%	0,887%	4,50%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,35%	0,35%	0,59%	1,71%	5,32%	15,77%	1,56%	0,039%	0,57%

IRF-M 1	0,59%	0,59%	1,79%	4,11%	10,35%	26,16%	-	-	-
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,72%	0,72%	2,00%	4,42%	10,71%	27,66%	0,15%	0,270%	2,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	0,59%	1,74%	4,00%	10,12%	25,62%	0,10%	0,109%	0,65%

CDI	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-	-
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,64%	0,64%	1,80%	4,06%	10,04%	26,21%	0,20%	0,011%	0,14%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,58%	0,58%	1,64%	3,73%	9,39%	24,89%	0,80%	0,011%	0,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,57%	0,57%	1,66%	3,78%	9,39%	24,73%	0,20%	0,005%	0,13%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,51%	0,51%	1,49%	3,41%	8,50%	22,70%	0,80%	0,000%	0,11%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,23%	0,23%	0,70%	1,78%	5,15%	15,15%	4,00%	0,003%	0,11%

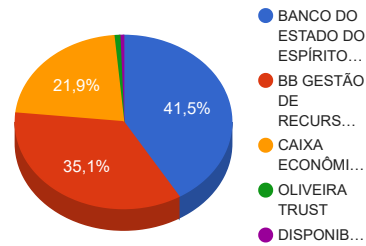
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
--------------	---	---	---	---	---	---	---	---	---

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

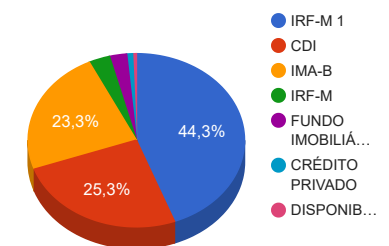
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,64%	2,64%	2,65%	10,60%	18,12%	72,74%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	8,88%	8,88%	7,87%	6,01%	13,11%	61,81%	1,20%	9,784%	22,89%

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

Administrador	Valor	%
BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO	15.032.280,18	41,71%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.737.931,84	35,34%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.954.404,52	22,07%
OLIVEIRA TRUST	317.057,61	0,88%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	206.706,67	0,57%

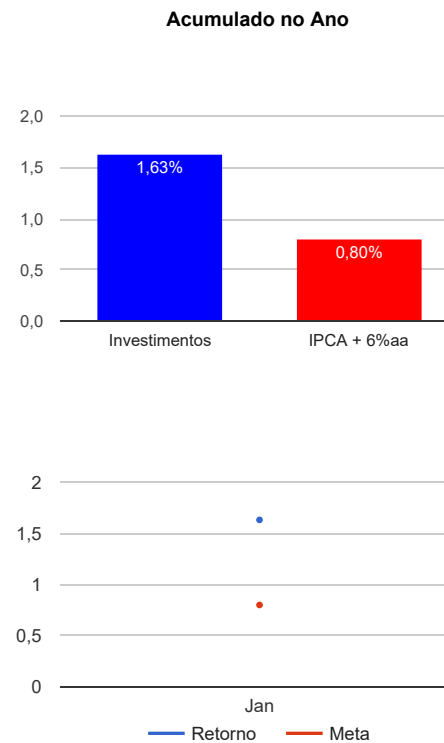


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	16.049.849,16	44,53%
CDI	9.164.256,40	25,43%
IMA-B	8.434.262,91	23,40%
IRF-M	1.144.248,07	3,17%
FUNDO IMOBILIÁRIO	932.000,00	2,59%
CRÉDITO PRIVADO	317.057,61	0,88%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	206.706,67	0,57%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	35.694.657,30	909.470,61	1.144.966,93	36.041.674,15	582.513,17	1,63%	0,80%	203,62%	0,88%
Acumulado no ano					582.513,17	1,63%	0,80%	203,62%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.474.763,47	300.000,00	717.337,32	4.260.246,04	202.819,89	4,25%	2,72%	4,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.037.777,18	0,00	0,00	4.174.016,87	136.239,69	3,37%	1,80%	3,37%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.186.728,39	0,00	57.263,04	1.144.248,07	14.782,72	1,25%	0,89%	1,29%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	4.840.213,58	0,00	0,00	4.874.823,36	34.609,78	0,72%	0,27%	0,72%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.633.989,68	0,00	0,00	2.650.760,92	16.771,24	0,64%	0,01%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.209.867,06	0,00	100.000,00	11.175.025,80	65.158,74	0,58%	0,11%	0,59%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.227.723,84	0,00	0,00	3.246.449,86	18.726,02	0,58%	0,01%	0,58%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.278.457,72	0,00	0,00	1.285.720,08	7.262,36	0,57%	0,00%	0,57%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	329.680,66	0,00	13.744,00	317.057,61	1.120,95	0,34%	0,04%	0,35%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	181.282,01	246.833,59	10.330,98	418.657,97	873,35	0,20%	0,00%	0,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.433.450,91	362.637,02	235.006,71	1.562.667,57	1.586,35	0,09%	0,00%	0,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.722,80	0,00	4.724,88	0,00	2,08	0,04%	0,00%	0,49%
Total Renda Fixa					499.953,17	1,44%	0,65%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	856.000,00	0,00	6.560,00	932.000,00	82.560,00	9,64%	9,78%	8,88%
Total Renda Variável					82.560,00	9,64%	9,78%	