

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2019)

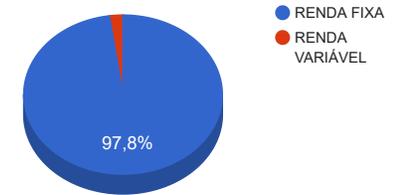
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.292.356,31	3,33%	1.230	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.934.581,90	4,98%	21	1,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.541.491,43	19,42%	956	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.890.831,87	15,17%	34	1,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.335.548,85	18,89%	696	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.525.488,35	16,81%	333	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	65.304,59	0,17%	165.641	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	5.986.040,88	15,42%	82	8,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.146,79	0,02%	326	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.308.695,89	3,37%	784	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 a D+35	Não há	78.234,28	0,20%	11	5,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	861.648,00	2,22%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>38.828.369,14</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			110.367,74				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>38.938.736,88</b>				

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

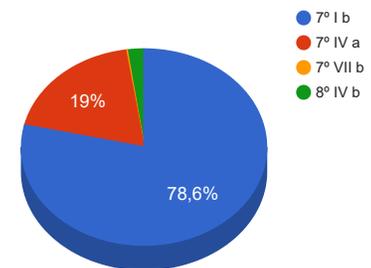
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	90,00%	34.945.532,23
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	30.520.298,71	78,60%	15,00%	30,00%	90,00%	4.425.233,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	23.297.021,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.368.188,15	18,98%	5,00%	15,00%	35,00%	6.221.741,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	78.234,28	0,20%	0,00%	0,00%	5,00%	1.863.184,18
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	7.765.673,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	7.765.673,83
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	10,00%	3.882.836,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	861.648,00	2,22%	2,00%	5,00%	5,00%	1.079.770,46
<b>Total Carteira</b>		<b>38.828.369,14</b>					

RENDA FIXA	38.077.088,88	98,07%
RENDA VARIÁVEL	861.648,00	2,22%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	30.520.298,71	78,60%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.368.188,15	18,98%	5,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	78.234,28	0,20%	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 II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	861.648,00	2,22%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>38.828.369,14</b>	<b>100,00%</b>	<b>41,00</b>	<b>345,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	15.218.698,10	39,19%	0,00%
BANESTES DTVM	13.811.454,65	35,57%	0,26%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.719.982,11	25,03%	0,00%
OLIVEIRA TRUST	78.234,28	0,20%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,51%	22,95%	12,19%	15,32%	38,55%	44,87%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,49%	22,60%	12,07%	15,03%	37,98%	43,91%	0,20%	1,883%	11,76%
IMA-B	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-	-
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,51%	23,94%	13,93%	17,64%	38,55%	44,02%	0,20%	2,054%	10,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	16,55%	8,83%	11,64%	27,24%	35,12%	0,20%	1,344%	7,75%
IRF-M	1,09%	8,14%	5,09%	6,66%	15,28%	24,57%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	8,01%	5,04%	6,55%	15,04%	24,05%	0,20%	0,631%	3,81%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,54%	-0,86%	-1,06%	-1,50%	-2,04%	15,45%	1,56%	0,859%	1,25%
IRF-M 1	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-	-
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,13%	7,05%	4,66%	6,14%	11,36%	20,12%	0,15%	0,519%	1,80%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	3,93%	1,93%	3,34%	7,06%	14,72%	0,10%	0,125%	0,50%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	3,58%	1,55%	3,03%	6,19%	13,55%	0,20%	0,004%	0,13%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,49%	3,15%	1,37%	2,67%	5,46%	12,01%	0,80%	0,000%	0,11%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,20%	1,27%	0,56%	1,08%	2,19%	5,17%	4,00%	0,003%	0,05%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	1,43%	11,02%	6,10%	9,03%	18,07%	-	0,50%	0,731%	3,49%

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

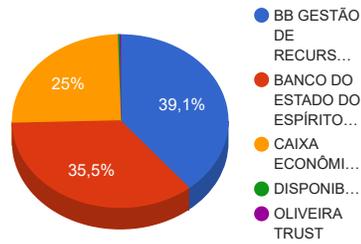
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

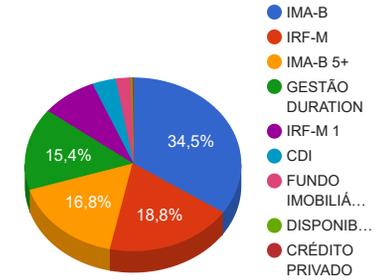
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,27%	13,10%	6,02%	10,37%	23,45%	28,72%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,37%	6,71%	6,12%	3,07%	9,92%	-2,00%	1,20%	6,136%	8,36%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.218.698,10	39,19%
BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO	13.811.454,65	35,57%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.719.982,11	25,03%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	110.367,74	0,28%
OLIVEIRA TRUST	78.234,28	0,20%



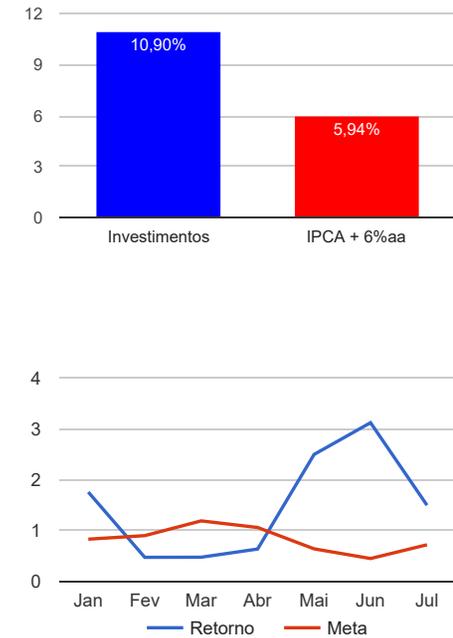
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	13.432.323,30	34,59%
IRF-M	7.335.548,85	18,89%
IMA-B 5+	6.525.488,35	16,81%
GESTÃO DURATION	5.986.040,88	15,42%
IRF-M 1	3.226.938,21	8,31%
CDI	1.382.147,27	3,56%
FUNDO IMOBILIÁRIO	861.648,00	2,22%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	110.367,74	0,28%
CRÉDITO PRIVADO	78.234,28	0,20%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	35.960.953,34	406.682,26	669.600,17	36.329.454,05	631.418,62	1,76%	0,83%	211,13%	1,03%
Fevereiro	36.329.454,05	957.814,49	980.514,17	36.478.731,79	171.977,42	0,47%	0,90%	52,86%	1,03%
Março	36.478.731,79	4.370.867,42	4.507.104,22	36.516.012,59	173.517,60	0,48%	1,19%	39,85%	1,97%
Abril	36.516.012,59	623.829,09	784.871,12	36.587.416,93	232.446,37	0,64%	1,06%	60,08%	0,90%
Mai	36.587.416,93	9.382.430,50	9.457.335,46	37.425.652,25	913.140,28	2,50%	0,64%	389,57%	1,62%
Junho	37.425.652,25	3.177.762,30	3.478.890,65	38.292.122,61	1.167.598,71	3,12%	0,45%	692,76%	1,95%
Julho	38.292.122,61	704.143,24	741.596,42	38.828.369,14	573.699,71	1,50%	0,72%	206,87%	1,29%
Acumulado no ano					3.863.798,71	10,90%	5,94%	183,53%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.918.331,70	87.523,65	263.700,00	5.890.831,87	148.676,52	2,48%	2,05%	2,51%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.971.246,35	460.768,46	0,00	6.525.488,35	93.473,54	1,45%	1,88%	1,49%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.901.810,68	0,00	0,00	5.986.040,88	84.230,20	1,43%	0,73%	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.446.645,27	0,00	0,00	7.541.491,43	94.846,16	1,27%	1,34%	1,27%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.913.042,23	0,00	0,00	1.934.581,90	21.539,67	1,13%	0,52%	1,13%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.307.303,27	0,00	50.000,00	7.335.548,85	78.245,58	1,07%	0,63%	1,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.283.382,98	0,00	0,00	1.292.356,31	8.973,33	0,70%	0,12%	0,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.399.019,98	0,00	98.000,00	1.308.695,89	7.675,91	0,55%	0,00%	0,55%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.918,84	17.518,98	27.556,68	0,00	118,86	0,43%	0,01%	0,54%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	147.735,72	15.813,73	155.639,49	8.146,79	236,83	0,14%	0,00%	0,49%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	73.684,34	122.518,42	131.044,74	65.304,59	146,57	0,07%	0,00%	0,20%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	94.393,25	0,00	15.655,51	78.234,28	-503,46	-0,53%	0,86%	-0,54%
Total Renda Fixa					537.659,71	1,44%	1,18%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	825.608,00	0,00	0,00	861.648,00	36.040,00	4,37%	6,14%	4,37%
Total Renda Variável					36.040,00	4,37%	6,14%	