

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 2019)

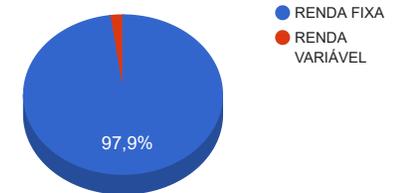
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.283.382,98	3,35%	1.250	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.913.042,23	5,00%	22	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.446.645,27	19,45%	909	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.918.331,70	15,46%	31	1,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.307.303,27	19,08%	688	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	5.971.246,35	15,59%	308	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	147.735,72	0,39%	328	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.399.019,98	3,65%	821	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	73.684,34	0,19%	165.425	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.918,84	0,03%	2.990	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	5.901.810,68	15,41%	50	9,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 a D+35	Não há	94.393,25	0,25%	11	5,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	825.608,00	2,16%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			38.292.122,61				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			110.367,74				Artigo 6º
Total			38.402.490,35				

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

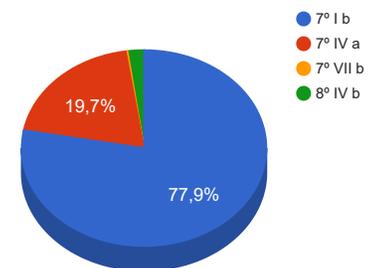
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	90,00%	34.462.910,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	29.839.951,80	77,93%	15,00%	30,00%	90,00%	4.622.958,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	22.975.273,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	7.532.169,56	19,67%	5,00%	15,00%	35,00%	5.870.073,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	94.393,25	0,25%	0,00%	0,00%	5,00%	1.820.212,88
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	7.658.424,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	7.658.424,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	10,00%	3.829.212,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	825.608,00	2,16%	2,00%	5,00%	5,00%	1.088.998,13
Total Carteira		38.292.122,61					

RENDA FIXA	37.576.882,35	98,13%
RENDA VARIÁVEL	825.608,00	2,16%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 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 "	29.839.951,80	77,93%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	7.532.169,56	19,67%	5,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	94.393,25	0,25%	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 "	825.608,00	2,16%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	38.292.122,61	100,00%	41,00	345,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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	14.635.616,94	38,22%	0,00%
BANESTES DTVM	13.743.103,45	35,89%	0,27%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.819.008,97	25,64%	0,00%
OLIVEIRA TRUST	94.393,25	0,25%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,06%	21,12%	12,50%	21,12%	40,78%	49,39%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,04%	20,80%	12,35%	20,80%	40,18%	48,45%	0,20%	3,096%	11,68%
IMA-B	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,28%	20,90%	12,81%	20,90%	39,55%	46,49%	0,20%	3,291%	10,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,69%	15,08%	9,06%	15,08%	28,54%	38,72%	0,20%	2,313%	7,71%
IRF-M	2,16%	6,98%	4,59%	6,98%	15,72%	26,07%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,14%	6,86%	4,54%	6,86%	15,51%	25,56%	0,20%	1,189%	3,82%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,35%	-0,32%	-0,74%	-0,32%	-1,50%	16,67%	1,56%	0,726%	1,19%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,70%	5,86%	4,07%	5,86%	11,00%	20,42%	0,15%	1,013%	1,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,10%	0,171%	0,49%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	3,01%	1,50%	3,01%	6,17%	13,82%	0,20%	0,003%	0,12%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,44%	3,01%	1,48%	3,01%	6,12%	13,80%	0,80%	0,024%	0,13%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,80%	0,000%	0,11%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,16%	1,07%	0,54%	1,07%	2,18%	5,45%	4,00%	0,002%	0,04%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

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

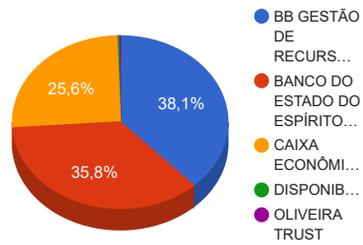
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	2,29%	9,45%	5,52%	9,45%	-	-	0,50%	1,096%	-

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

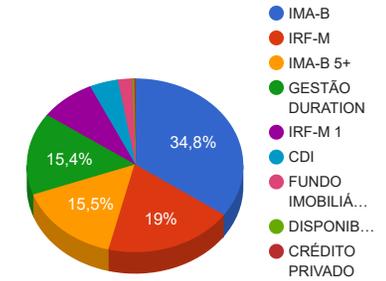
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,18%	2,24%	0,98%	2,24%	12,66%	-3,55%	1,20%	2,628%	9,90%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.635.616,94	38,22%
BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO	13.743.103,45	35,89%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.819.008,97	25,64%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	110.367,74	0,29%
OLIVEIRA TRUST	94.393,25	0,25%



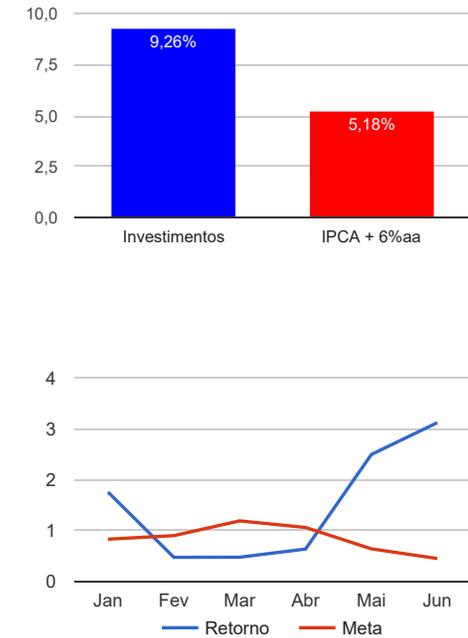
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	13.364.976,97	34,90%
IRF-M	7.307.303,27	19,08%
IMA-B 5+	5.971.246,35	15,59%
GESTÃO DURATION	5.901.810,68	15,41%
IRF-M 1	3.196.425,21	8,35%
CDI	1.630.358,88	4,26%
FUNDO IMOBILIÁRIO	825.608,00	2,16%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	110.367,74	0,29%
CRÉDITO PRIVADO	94.393,25	0,25%



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%
Acumulado no ano					3.290.099,00	9,26%	5,18%	178,91%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.788.058,73	856.432,41	4.500,00	5.918.331,70	278.340,56	4,93%	3,29%	5,28%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.786.770,41	1.924.342,12	0,00	5.971.246,35	260.133,82	4,55%	3,10%	5,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.181.356,16	0,00	0,00	7.446.645,27	265.289,11	3,69%	2,31%	3,69%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.769.650,48	0,00	0,00	5.901.810,68	132.160,20	2,29%	1,10%	2,29%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.203.951,66	0,00	50.000,00	7.307.303,27	153.351,61	2,13%	1,19%	2,14%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.881.153,18	0,00	0,00	1.913.042,23	31.889,05	1,70%	1,01%	1,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.392.695,83	0,00	0,00	1.399.019,98	6.324,15	0,45%	0,00%	0,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.772.893,14	0,00	1.500.000,00	1.283.382,98	10.489,84	0,38%	0,17%	0,57%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	403.475,83	17.813,73	274.689,69	147.735,72	1.135,85	0,27%	0,00%	0,41%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.091.065,04	0,00	1.093.818,05	0,00	2.753,01	0,25%	0,02%	0,49%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	195.016,39	0,00	185.500,00	9.918,84	402,45	0,21%	0,02%	0,44%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	49.054,98	379.174,04	354.650,65	73.684,34	105,97	0,02%	0,00%	0,16%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	110.510,42	0,00	15.732,26	94.393,25	-384,91	-0,35%	0,73%	-0,35%
Total Renda Fixa					1.141.990,71	3,12%	1,94%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	800.000,00	0,00	0,00	825.608,00	25.608,00	3,20%	2,63%	1,18%
Total Renda Variável					25.608,00	3,20%	2,63%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.682.396,30	145.934,65	0,00	7.446.645,27	618.314,32	9,06%	9,06%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.119.304,77	4.234.082,56	949.635,00	5.918.331,70	514.579,37	10,44%	12,81%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	880.071,51	4.677.404,15	0,00	5.971.246,35	413.770,69	10,32%	12,35%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.138.065,65	0,00	150.000,00	7.307.303,27	319.237,62	4,51%	4,54%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	2.505.779,55	3.143.360,93	0,00	5.901.810,68	252.670,20	4,95%	5,52%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.825.439,76	0,00	1.000.000,00	1.913.042,23	87.602,47	3,70%	4,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.412.963,96	0,00	5.200.000,00	1.283.382,98	70.419,02	1,32%	1,73%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.864.394,72	0,00	2.893.818,05	0,00	29.423,33	1,19%	1,64%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.378.289,45	0,00	0,00	1.399.019,98	20.730,53	1,50%	1,50%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.225.314,40	0,00	2.231.500,00	9.918,84	16.104,44	0,97%	1,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	414.917,39	485.376,40	757.846,45	147.735,72	5.288,38	0,96%	1,33%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	55.291,27	497.863,20	479.797,32	73.684,34	327,19	0,21%	0,54%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	142.644,52	0,00	47.300,41	94.393,25	-950,86	-0,76%	-0,74%
Total Renda Fixa					2.347.516,70	6,62%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	871.139,34	0,00	11.200,00	825.608,00	-34.331,34	-3,90%	0,98%
				Total Renda Variável	-34.331,34	-3,90%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.072.075,21	419.934,65	0,00	7.446.645,27	954.635,41	15,07%	15,08%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.707.663,53	4.532.977,54	959.635,00	5.918.331,70	637.325,63	18,21%	20,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.855.024,76	214.244,00	1.257.000,00	7.307.303,27	495.034,51	6,84%	6,86%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	504.061,75	5.010.701,59	0,00	5.971.246,35	456.483,01	18,08%	20,80%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,00	5.643.360,93	0,00	5.901.810,68	258.449,75	5,19%	9,45%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.238.611,42	0,00	3.500.000,00	1.913.042,23	174.430,81	5,42%	5,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.334.343,10	1.040.000,00	5.240.037,62	1.283.382,98	149.077,50	2,73%	3,21%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.817.255,32	0,00	2.893.818,05	0,00	76.562,73	2,88%	3,34%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.430.247,09	10.064,93	3.488.469,16	9.918,84	58.075,98	2,34%	3,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.358.112,18	0,00	0,00	1.399.019,98	40.907,80	3,01%	3,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	572.192,76	1.194.383,54	1.632.959,12	147.735,72	14.118,54	2,02%	2,65%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	35.425,26	853.718,88	816.151,64	73.684,34	691,84	0,52%	1,07%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	189.383,21	0,00	79.045,20	94.393,25	-15.944,76	-10,31%	-0,32%
Total Renda Fixa					3.299.848,75	9,52%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	846.557,75	0,00	11.200,00	825.608,00	-9.749,75	-1,10%	2,24%
				Total Renda Variável	-9.749,75	-1,10%	