

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2019

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



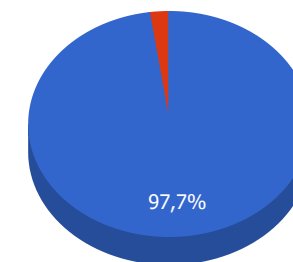
Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	941.990,16	2,45%	21	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	688.152,41	1,79%	351	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	247.244,03	0,64%	1.214	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.509.590,60	19,53%	962	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.347.960,59	16,51%	35	2,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	6.944.193,13	18,06%	333	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.123.459,70	15,93%	700	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	371.491,95	0,97%	770	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.186.109,72	10,89%	135	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.768,57	0,05%	333	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	85.104,33	0,22%	166.227	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	4.025.561,28	10,47%	160	4,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 a D...	Não há	77.083,61	0,20%	11	6,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	877.600,00	2,28%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			38.443.310,08				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			9,72				Artigo 6º
PL Total			38.443.319,80				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	90,00%	34.598.979,07
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	28.802.590,62	74,92%	15,00%	30,00%	90,00%	5.796.388,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	23.065.986,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	8.686.035,85	22,59%	5,00%	15,00%	35,00%	4.769.122,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	0,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	77.083,61	0,20%	0,00%	0,00%	5,00%	1.845.081,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.922.165,50
Total Renda Fixa	100,00%	37.565.710,08	97,72%	27,00%	75,00%	285,00%	

Distribuição por Segmento

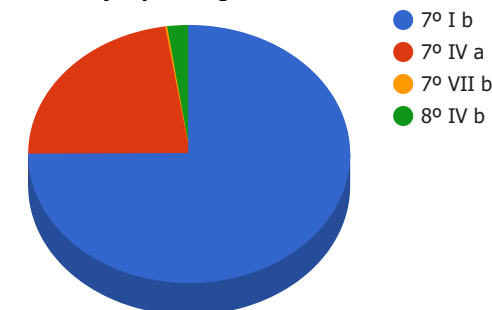


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.844.331,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	7.688.662,02
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	7.688.662,02
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	10,00%	3.844.331,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	0,00%	5,00%	1.922.165,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	877.600,00	2,28%	2,00%	5,00%	5,00%	1.044.565,50
Total Renda Variável	30,00%	877.600,00	2,28%	16,00%	27,00%	70,00%	

Distribuição por Artigos



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Agosto / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BANESTES DTVM	15.501.621,75	40,32	0,25
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.400.001,19	34,86	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.464.603,53	24,62	0,00
OLIVEIRA TRUST	77.083,61	0,20	0,00

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 - 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 '	28.802.590,62	74,92	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	8.686.035,85	22,59	5,00	35,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	77.083,61	0,20	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
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 '	877.600,00	2,28	2,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,77%	22,00%	5,82%	13,81%	38,20%	41,83%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,79%	21,63%	5,77%	13,60%	37,66%	40,89%	0,04%	0,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,79%	21,65%	5,75%	13,61%	37,44%	40,76%	0,04%	0,12%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,00%	0,00%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,47%	7,56%	3,32%	6,27%	11,64%	19,57%	0,01%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,42%	16,06%	4,57%	10,60%	27,30%	32,79%	0,02%	0,08%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	-1,92%	20,65%	5,86%	13,56%	34,39%	36,56%	0,03%	0,10%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,12%	21,31%	5,63%	13,50%	36,77%	39,34%	0,04%	0,11%

IRF-M (Benchmark)	0,26%	8,42%	3,54%	6,63%	16,67%	23,59%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	8,26%	3,48%	6,51%	16,43%	23,07%	0,01%	0,03%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-1,47%	-2,31%	-2,35%	-2,83%	-3,53%	13,44%	0,01%	0,02%

CDI (Benchmark)	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,49%	4,09%	1,50%	3,04%	6,12%	13,21%	0,00%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,15%	1,42%	0,52%	1,06%	2,14%	4,88%	0,00%	0,00%

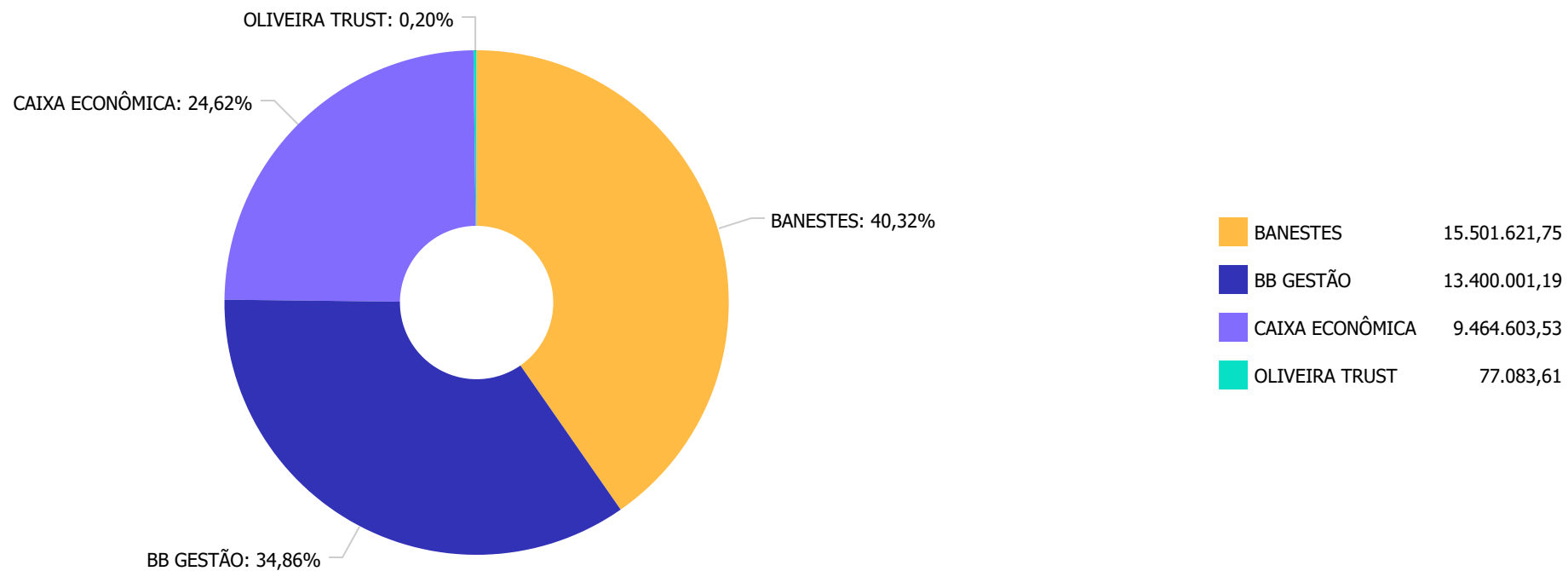
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	3,60%	1,33%	2,68%	5,40%	11,68%	0,00%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,62%	11,70%	4,39%	8,78%	18,32%	-	0,01%	0,03%

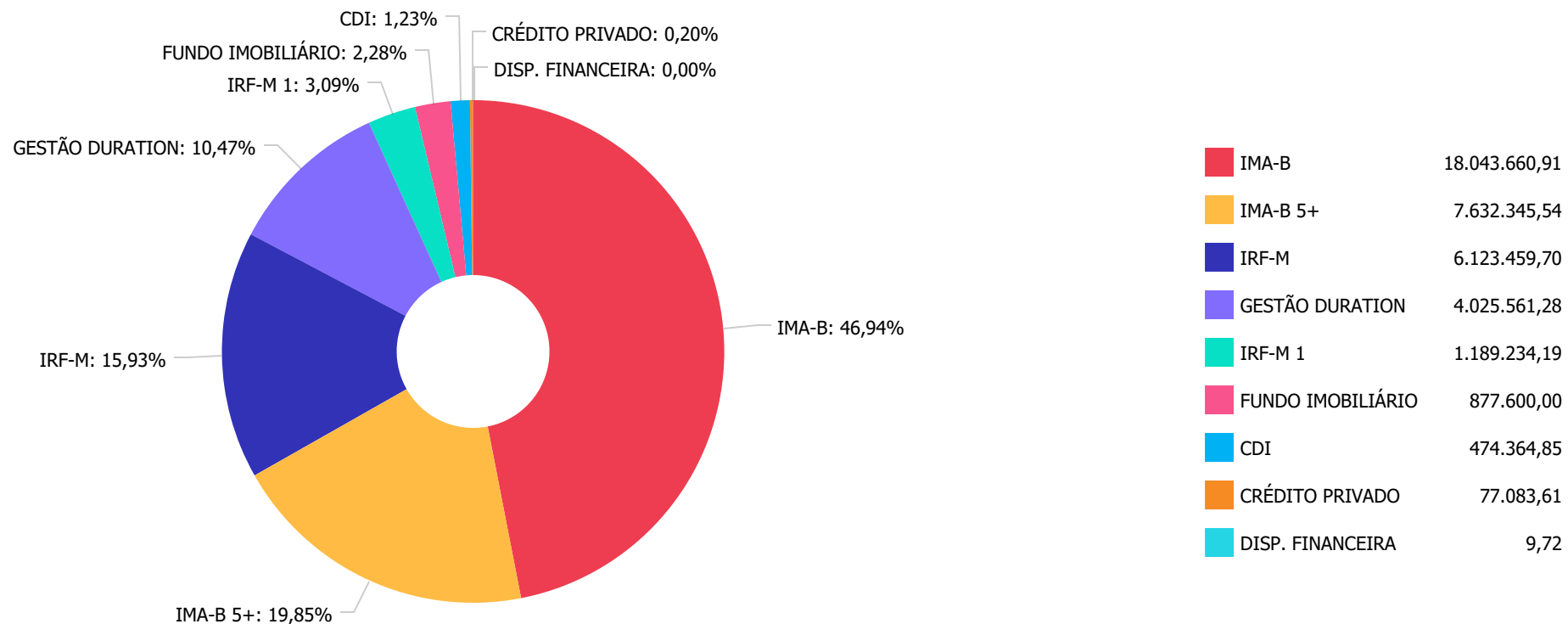
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,85%	8,68%	7,55%	6,17%	15,90%	7,65%	0,08%	0,07%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Agosto / 2019)



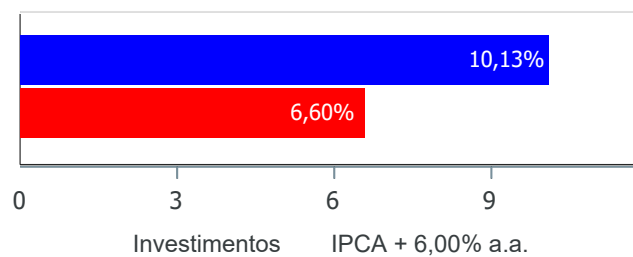
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	35.960.953,34	406.682,26	669.600,17	36.329.454,05	631.418,62	631.418,62	1,76%	1,76%	0,83%	0,83%	211,13%	1,03%
Fevereiro	36.329.454,05	957.814,49	980.514,17	36.478.731,79	171.977,42	803.396,04	0,47%	2,24%	0,90%	1,73%	129,00%	1,03%
Março	36.478.731,79	4.370.867,42	4.507.104,22	36.516.012,59	173.517,60	976.913,64	0,48%	2,72%	1,19%	2,95%	92,37%	1,97%
Abril	36.516.012,59	623.829,09	784.871,12	36.587.416,93	232.446,37	1.209.360,01	0,64%	3,38%	1,06%	4,04%	83,61%	0,90%
Mai	36.587.416,93	9.382.430,50	9.457.335,46	37.425.652,25	913.140,28	2.122.500,29	2,50%	5,96%	0,64%	4,71%	126,60%	1,62%
Junho	37.425.652,25	3.177.762,30	3.478.890,65	38.292.122,61	1.167.598,71	3.290.099,00	3,12%	9,26%	0,45%	5,18%	178,91%	1,95%
Julho	38.292.122,61	704.143,24	741.596,42	38.828.369,14	573.699,71	3.863.798,71	1,50%	10,90%	0,72%	5,94%	183,53%	1,29%
Agosto	38.828.369,14	6.633.048,87	6.748.024,88	38.443.310,08	-270.083,05	3.593.715,66	-0,70%	10,13%	0,62%	6,60%	153,54%	2,59%

Investimentos x Meta Atuarial



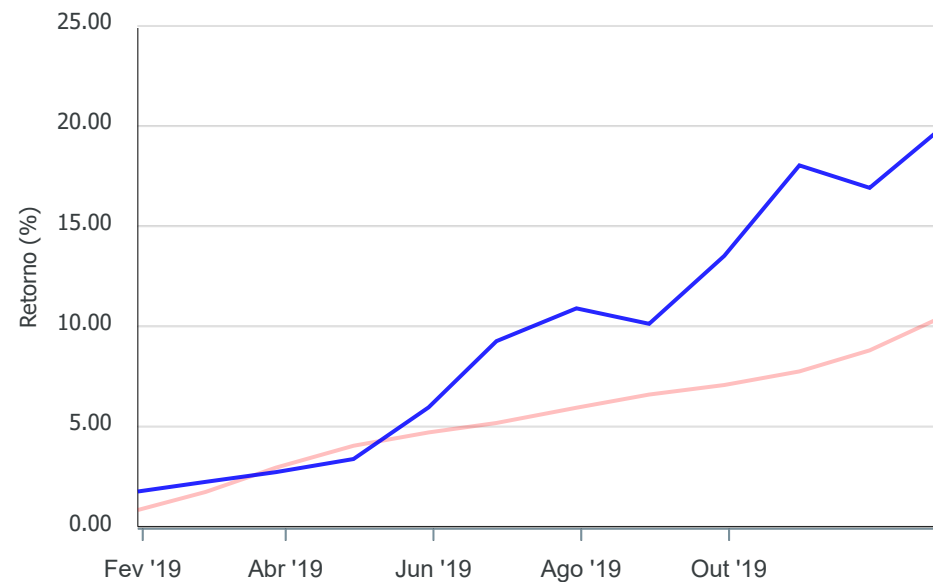
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2019

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.986.040,88	1.959,30	2.000.000,00	4.025.561,28	37.561,10	0,63%	0,62%	0,94%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.934.581,90	0,00	1.000.000,00	941.990,16	7.408,26	0,38%	0,47%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.292.356,31	0,00	1.050.000,00	247.244,03	4.887,72	0,38%	0,52%	0,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.308.695,89	0,00	941.701,66	371.491,95	4.497,72	0,34%	0,49%	0,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.335.548,85	0,00	1.230.000,00	6.123.459,70	17.910,85	0,24%	0,24%	1,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	8.146,79	18.141,37	8.580,12	17.768,57	60,53	0,23%	0,43%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	65.304,59	127.872,22	108.163,10	85.104,33	90,62	0,05%	0,15%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.541.491,43	0,00	0,00	7.509.590,60	-31.900,83	-0,42%	-0,42%	2,48%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	6.525.488,35	473.675,39	0,00	6.944.193,13	-54.970,61	-0,79%	-0,79%	3,60%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	78.234,28	0,00	0,00	77.083,61	-1.150,67	-1,47%	-1,47%	1,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	700.000,00	0,00	688.152,41	-11.847,59	-1,69%	-0,79%	3,61%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.890.831,87	1.016.400,59	409.580,00	6.347.960,59	-149.691,87	-2,17%	-2,12%	3,50%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,00	4.295.000,00	0,00	4.186.109,72	-108.890,28	-2,54%	-1,92%	3,23%
Total Renda Fixa	37.966.721,14	6.633.048,87	6.748.024,88	37.565.710,08	-286.035,05	-0,64%		2,47%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	861.648,00	0,00	0,00	877.600,00	15.952,00	1,85%	1,85%	7,71%
Total Renda Variável	861.648,00	0,00	0,00	877.600,00	15.952,00	1,85%		7,71%