

# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2020

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 / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.811.192,38	4,38%	941	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.193.338,16	19,81%	36	2,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.863.242,17	11,76%	709	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	7.490.681,23	18,12%	332	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	253.087,28	0,61%	1.213	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	733.609,97	1,77%	359	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.499.901,58	3,63%	22	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.033.343,81	4,92%	717	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	133.248,49	0,32%	651	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.287,24	0,03%	324	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.221,68	0,00%	684	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	18.300,74	0,04%	166.177	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	220.452,95	0,53%	225	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	4.280.572,00	10,35%	759	1,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.230.793,98	19,91%	344	2,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	148.195,96	0,36%	3.457	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5 a D...	Não há	25.581,12	0,06%	11	5,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.400.000,00	3,39%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>41.350.050,74</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>236.738,63</b>				Artigo 6º
		<b>PL Total</b>	<b>41.586.789,37</b>				

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2020)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	5,00%	19,00%	90,00%	37.215.045,67
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	26.878.396,58	65,00%	15,00%	30,00%	90,00%	10.336.649,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	24.810.030,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	13.046.073,04	31,55%	5,00%	13,00%	40,00%	3.493.947,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.067.502,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	827.001,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	25.581,12	0,06%	0,00%	1,00%	5,00%	2.041.921,42
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>39.950.050,74</b>	<b>96,61%</b>	<b>30,00%</b>	<b>73,00%</b>	<b>292,00%</b>	

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2020)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	4.135.005,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	6,00%	7,00%	20,00%	8.270.010,15
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	8.270.010,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	6,00%	10,00%	4.135.005,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	2,00%	5,00%	2.067.502,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.400.000,00	3,39%	2,00%	2,00%	5,00%	667.502,54
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>1.400.000,00</b>	<b>3,39%</b>	<b>15,00%</b>	<b>24,00%</b>	<b>70,00%</b>	

**Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Janeiro / 2020)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BANESTES DTVM	22.573.254,63	54,59	0,31
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.758.559,91	30,86	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.992.655,08	14,49	0,00
OLIVEIRA TRUST	25.581,12	0,06	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	26.878.396,58	65,00	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	13.046.073,04	31,55	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	25.581,12	0,06	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	6,00	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 '	1.400.000,00	3,39	2,00	5,00

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,03%	0,03%	-1,54%	6,07%	22,33%	43,41%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,05%	-1,45%	6,13%	22,08%	42,79%	0,03%	0,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,04%	-0,04%	-1,75%	5,77%	21,74%	42,13%	0,03%	0,09%

<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,42%	1,13%	2,89%	6,33%	13,50%	0,00%	0,00%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,72%	0,72%	1,29%	3,71%	10,08%	19,31%	0,00%	0,02%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,25%	0,25%	-0,36%	5,44%	17,72%	34,14%	0,02%	0,06%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,74%	0,74%	-1,49%	5,41%	23,76%	38,46%	0,03%	0,10%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,55%	-1,35%	6,31%	25,06%	42,79%	0,03%	0,11%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,88%	0,88%	1,04%	4,50%	11,47%	23,54%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	0,98%	4,38%	11,22%	23,04%	0,01%	0,03%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-4,53%	-4,53%	-10,49%	-18,25%	-19,48%	-7,21%	0,09%	0,06%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37%	0,37%	1,03%	2,44%	5,55%	12,08%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	0,35%	1,05%	2,45%	5,55%	12,19%	0,00%	0,00%

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA FIXA**

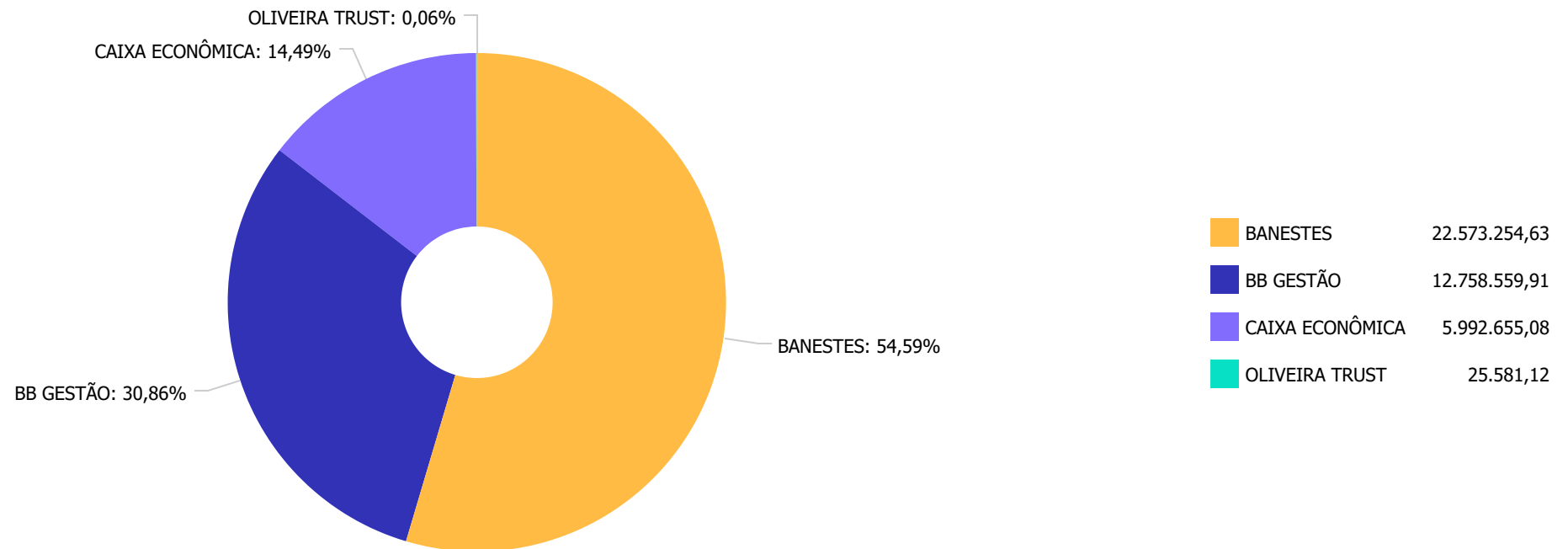
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,11%	0,11%	0,38%	0,88%	1,97%	4,24%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,30%	0,30%	0,92%	2,17%	4,90%	10,67%	0,00%	0,00%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,39%	0,39%	1,07%	2,45%	5,88%	13,19%	0,00%	0,00%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,34%	0,34%	0,91%	2,48%	5,57%	12,15%	0,00%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,62%	0,62%	1,76%	6,99%	16,65%	-	0,01%	0,03%



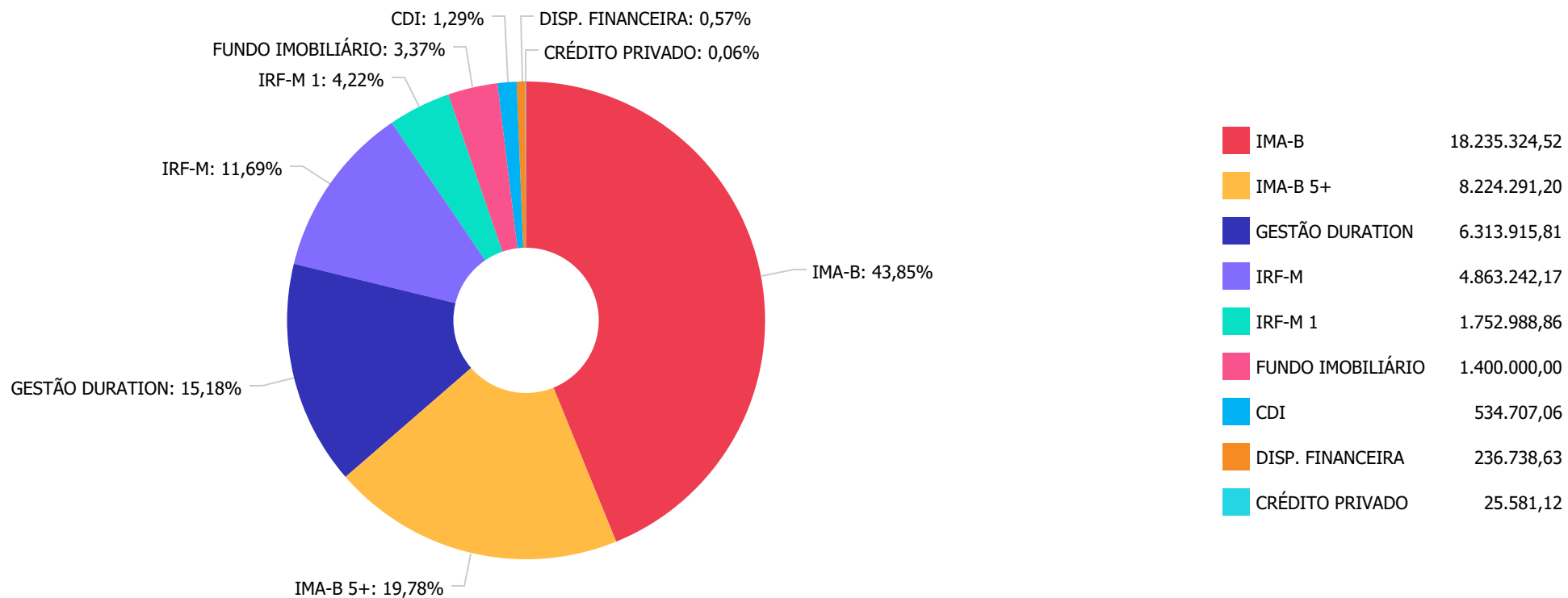
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	17,45%	17,45%	46,57%	62,48%	67,46%	50,21%	0,22%	0,23%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2020)



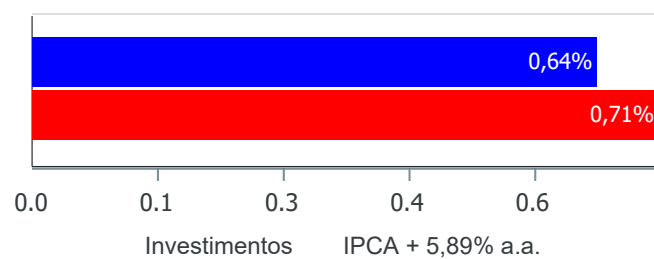
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2020)



**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	41.708.995,45	70.282.314,89	70.910.071,28	41.350.050,74	268.811,68	268.811,68	0,64%	0,64%	0,71%	0,71%	90,53%	2,67%

**Investimentos x Meta Atuarial**



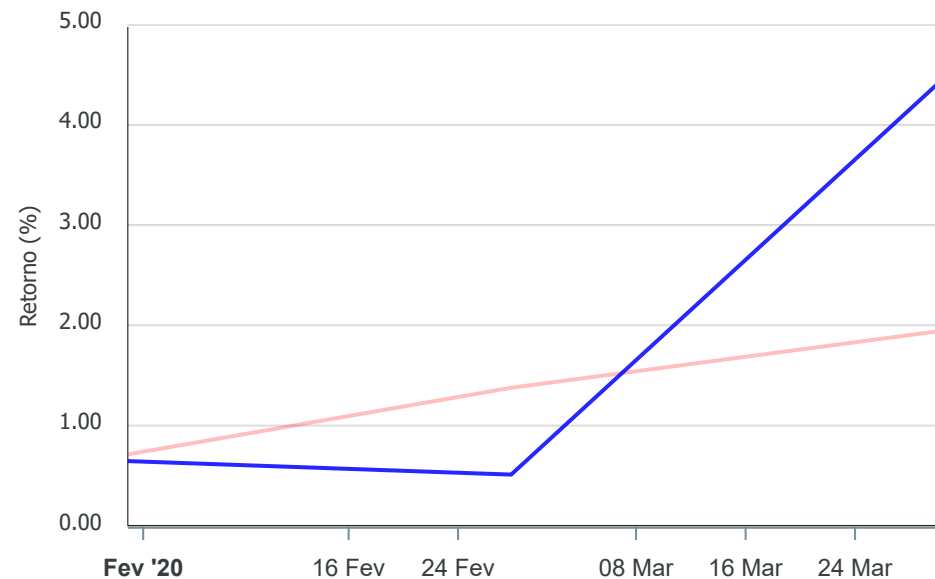
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2020

## FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.871.621,18	0,00	50.000,00	4.863.242,17	41.620,99	0,85%	0,85%	0,65%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	36.137,25	52.905,60	71.435,99	18.300,74	693,88	0,78%	0,11%	0,00%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	4.254.399,39	0,00	0,00	4.280.572,00	26.172,61	0,62%	0,62%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	3.511.913,73	0,00	1.500.000,00	2.033.343,81	21.430,08	0,61%	0,82%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	252.030,40	0,00	0,00	253.087,28	1.056,88	0,42%	0,42%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.217,17	0,00	0,00	1.221,68	4,51	0,37%	0,37%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.131.304,18	0,00	1.000.000,00	133.248,49	1.944,31	0,17%	0,35%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	19.094,16	80.528,97	86.495,29	13.287,24	159,40	0,16%	0,30%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.361.278,83	0,00	1.555.000,00	1.811.192,38	4.913,55	0,15%	0,25%	1,67%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	106.058,66	17.500.000,00	17.400.000,00	220.452,95	14.394,29	0,08%	0,39%	0,03%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	29.588,86	15.050.000,00	14.942.140,00	148.195,96	10.747,10	0,07%	0,34%	0,03%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	7.487.004,29	127,79	0,00	7.490.681,23	3.549,15	0,05%	0,05%	2,59%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.499.901,58	-98,42	-0,01%	0,72%	0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	733.892,87	0,00	0,00	733.609,97	-282,90	-0,04%	-0,04%	2,62%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	6.843.641,58	16.510.000,00	15.100.000,00	8.230.793,98	-22.847,60	-0,10%	0,74%	2,57%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.851.026,26	19.588.752,53	19.205.000,00	8.193.338,16	-41.440,63	-0,15%	0,55%	2,90%
RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	26.794,64	0,00	0,00	25.581,12	-1.213,52	-4,53%	-4,53%	8,79%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>40.517.003,45</b>	<b>70.282.314,89</b>	<b>70.910.071,28</b>	<b>39.950.050,74</b>	<b>60.803,68</b>	<b>0,05%</b>		<b>1,99%</b>

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2020

## 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	1.191.992,00	0,00	0,00	1.400.000,00	208.008,00	17,45%	17,45%	22,09%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.191.992,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.400.000,00</b>	<b>208.008,00</b>	<b>17,45%</b>		<b>22,09%</b>