

Relatório Analítico dos Investimentos

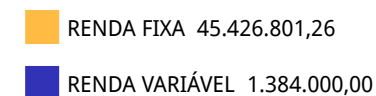
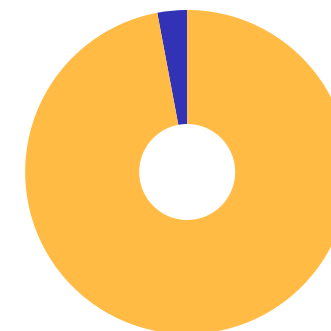
em julho de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 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	2.587.961,46	5,53%	905	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.833.580,38	3,92%	791	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.158.429,68	19,56%	37	2,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	6.590.185,11	14,08%	312	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.739.947,46	5,85%	342	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.948.437,44	6,30%	718	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.103.177,17	4,49%	374	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.213.194,39	13,27%	21	3,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	94.098,93	0,20%	600	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.200.555,82	2,56%	2.132	0,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	463.947,56	0,99%	11.376	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	25.399,08	0,05%	319	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	97.619,90	0,21%	168.195	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	157.393,87	0,34%	114	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.064.728,92	19,36%	223	2,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	148.144,09	0,32%	392	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.384.000,00	2,96%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			46.810.801,26				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			7.424,17				Artigo 6º
PL Total			46.818.225,43				

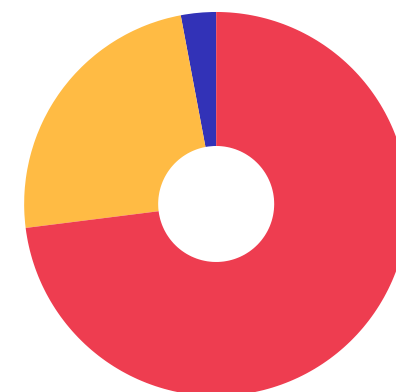
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2020)

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%	42.129.721,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.174.913,09	73,01%	15,00%	30,00%	90,00%	7.954.808,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	28.086.480,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	11.251.888,17	24,04%	5,00%	13,00%	40,00%	7.472.432,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.340.540,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	936.216,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.340.540,06
Total Renda Fixa	100,00%	45.426.801,26	97,04%	30,00%	73,00%	292,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 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%	4.681.080,13
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	6,00%	7,00%	20,00%	9.362.160,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	9.362.160,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	6,00%	10,00%	4.681.080,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	2,00%	5,00%	2.340.540,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.384.000,00	2,96%	2,00%	2,00%	5,00%	956.540,06
Total Renda Variável	30,00%	1.384.000,00	2,96%	15,00%	24,00%	70,00%	



7º I b 7º IV a 8º IV b

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BANESTES DTVM	26.406.394,33	56,41	0,43
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.674.065,55	22,80	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.730.341,38	20,79	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 '	34.174.913,09	73,01	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	11.251.888,17	24,04	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 '	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	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 '	1.384.000,00	2,96	2,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,47%	7,59%	4,50%	6,40%	12,02%	32,81%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	7,47%	4,47%	6,32%	11,77%	32,19%	0,01%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,32%	1,68%	11,51%	1,64%	7,81%	49,37%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,28%	1,51%	11,38%	1,46%	7,68%	48,58%	0,04%	0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,29%	1,46%	11,43%	1,50%	7,35%	47,92%	0,04%	0,16%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,24%	2,84%	0,94%	2,39%	5,51%	13,20%	-	-
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,67%	5,55%	1,97%	4,80%	8,68%	21,03%	0,01%	0,01%
IMA-B (Benchmark)	4,39%	2,65%	8,14%	2,38%	8,16%	37,86%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,38%	2,42%	8,09%	2,17%	7,73%	37,07%	0,02%	0,11%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	6,59%	-2,31%	10,55%	-3,03%	2,22%	38,94%	0,04%	0,19%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,49%	-1,55%	10,74%	-2,09%	4,09%	44,21%	0,04%	0,18%
IRF-M (Benchmark)	1,08%	6,00%	3,32%	5,08%	9,81%	26,59%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	5,86%	3,31%	4,96%	9,57%	26,04%	0,01%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,24%	1,61%	0,75%	1,26%	3,74%	10,19%	0,00%	0,00%

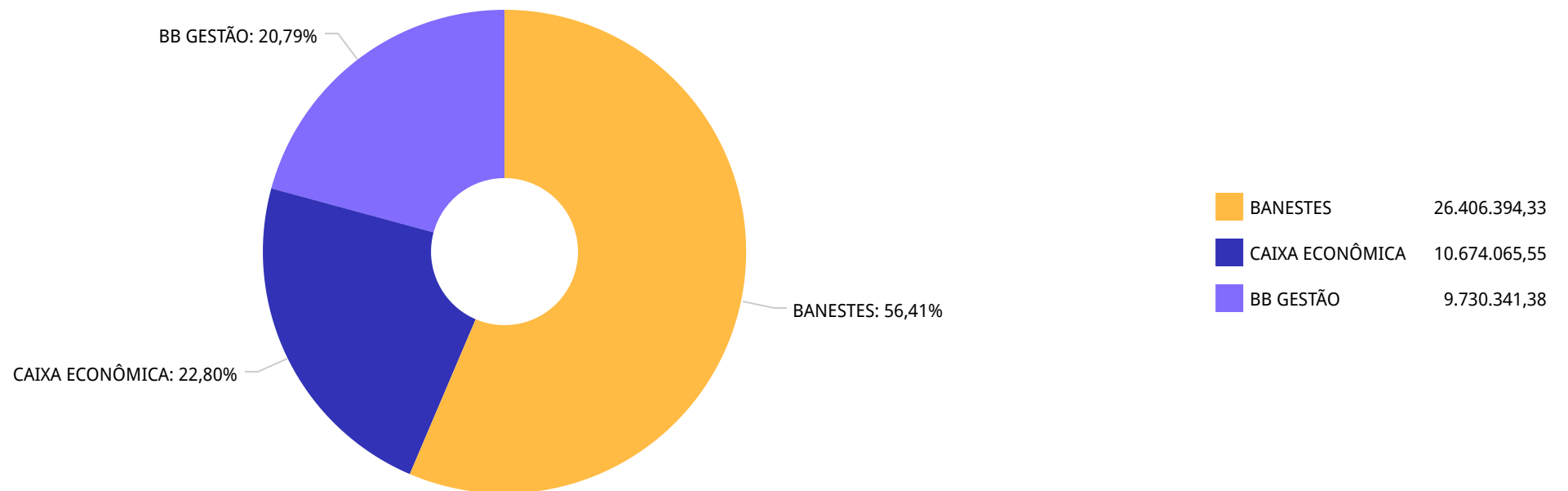
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,03%	0,44%	0,13%	0,33%	1,21%	3,43%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,12%	1,46%	0,43%	1,15%	3,35%	8,99%	0,00%	0,00%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,61%	-0,94%	1,32%	-1,33%	1,09%	7,99%	0,00%	0,03%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,55%	-1,09%	1,33%	-1,43%	1,02%	7,23%	0,00%	0,03%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,40%	0,07%	0,28%	1,35%	4,66%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,98%	5,65%	3,14%	4,79%	9,68%	28,24%	0,01%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	1,86%	0,53%	2,86%	-0,08%	6,90%	26,22%	0,01%	0,04%

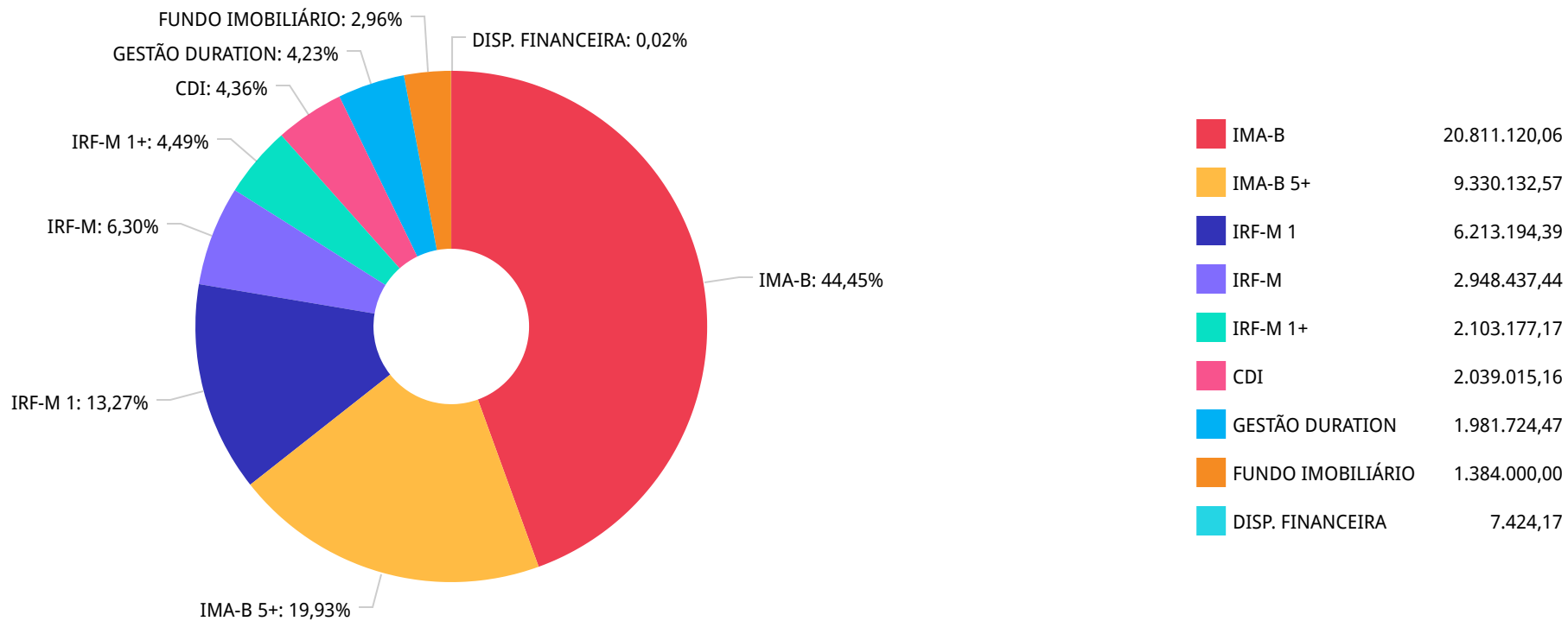
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	10,90%	16,11%	38,23%	-1,14%	60,62%	76,55%	0,11%	0,44%

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



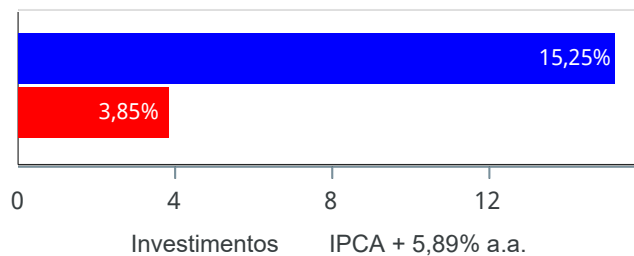
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Julho / 2020)



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%
Fevereiro	41.350.050,74	81.991.739,49	82.008.192,99	41.278.277,57	-55.319,67	213.492,01	-0,13%	0,51%	0,66%	1,38%	37,02%	2,29%
Março	41.278.277,57	172.538.259,16	172.631.699,95	42.808.766,55	1.623.929,77	1.837.421,78	3,93%	4,46%	0,57%	1,96%	228,18%	11,07%
Abril	42.808.766,55	33.790.585,62	33.646.457,84	43.154.591,25	201.696,92	2.039.118,70	0,47%	4,95%	0,14%	2,10%	235,59%	8,22%
Mai	43.154.591,25	3.164.640,44	3.471.122,34	43.393.860,44	545.751,09	2.584.869,79	1,26%	6,28%	0,07%	2,18%	288,41%	3,43%
Junho	43.393.860,44	161.885.061,47	162.093.888,17	44.613.929,27	1.428.895,53	4.013.765,32	3,29%	9,78%	0,74%	2,93%	333,44%	2,55%
Julho	44.613.929,27	109.691.745,07	109.716.045,24	46.810.801,26	2.221.172,16	6.234.937,48	4,98%	15,25%	0,89%	3,85%	396,54%	2,93%

Investimentos x Meta Atuarial



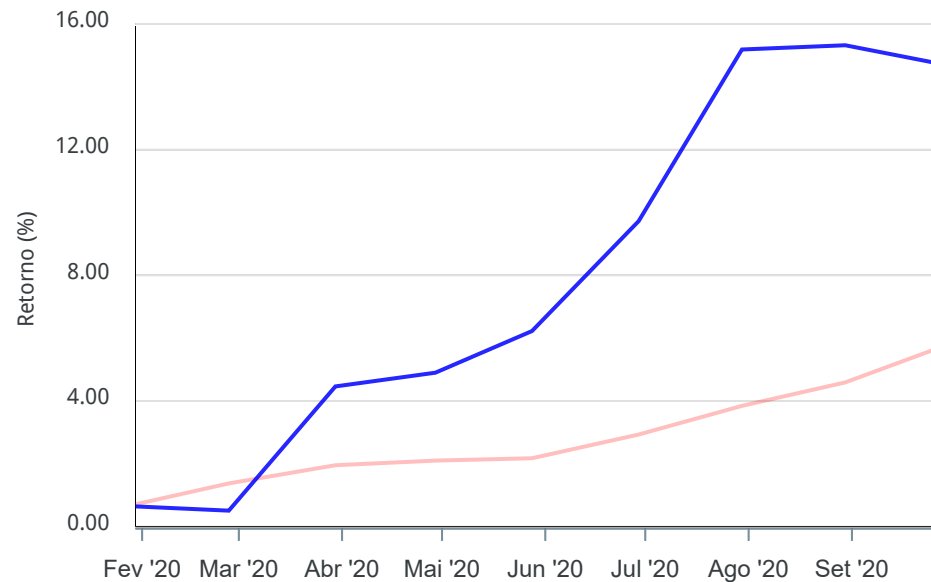
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Julho/2020
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	5.084.143,79	1.108.267,02	0,00	6.590.185,11	397.774,30	6,42%	7,28%	3,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.088.961,48	1.500.000,00	0,00	2.739.947,46	150.985,98	5,83%	7,29%	3,79%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.986.372,25	500.000,00	0,00	2.587.961,46	101.589,21	4,09%	4,38%	2,27%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.063.634,62	27.350.000,00	23.950.000,00	9.158.429,68	694.795,06	2,14%	7,49%	3,82%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	145.432,55	0,00	0,00	148.144,09	2.711,54	1,86%	1,86%	0,84%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.588.506,21	30.020.000,00	24.140.000,00	9.064.728,92	596.222,71	1,83%	6,59%	3,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.612.000,00	305.000,00	0,00	2.948.437,44	31.437,44	1,08%	1,13%	1,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.910.251,40	0,00	95.000,00	1.833.580,38	18.328,98	0,96%	0,98%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.071.483,24	0,00	2.000.000,00	2.103.177,17	31.693,93	0,78%	1,50%	1,45%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.171.622,25	0,00	0,00	6.213.194,39	41.572,14	0,67%	0,67%	0,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	33.965,68	60.000,00	0,00	94.098,93	133,25	0,14%	0,24%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.056.080,94	0,00	1.057.017,77	0,00	936,83	0,09%	0,23%	0,15%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.101.279,42	10.000.000,00	11.950.000,00	157.393,87	6.114,45	0,05%	0,61%	0,07%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.040.046,99	18.900.000,00	26.750.000,00	1.200.555,82	10.508,83	0,04%	0,55%	0,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	77.234,98	29.830,06	81.696,69	25.399,08	30,73	0,03%	0,12%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	192.285,67	430.254,27	525.018,14	97.619,90	98,10	0,02%	0,03%	0,00%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	142.627,80	19.488.393,72	19.167.312,64	463.947,56	238,68	0,00%	0,02%	0,00%
Total Renda Fixa	43.365.929,27	109.691.745,07	109.716.045,24	45.426.801,26	2.085.172,16	1,36%		2,67%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/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	1.248.000,00	0,00	0,00	1.384.000,00	136.000,00	10,90%	10,90%	11,49%
Total Renda Variável	1.248.000,00	0,00	0,00	1.384.000,00	136.000,00	10,90%		11,49%