



ATA SUMÁRIA DA 54ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTO DO INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE SÃO GONÇALO DO AMARANTE/RN – IPREV

I. DATA, LOCAL E HORA:

Em 12 de setembro de 2019, às 11h00min, no auditório da sede do IPREV situada na Rua Cícero Hipólito da Rocha, 23, Santa Terezinha, São Gonçalo do Amarante/RN.

II. MEMBROS PARTICIPANTES:

- 1 – Elaine Cristina de Souza Araújo – Presidente do IPREV;
- 2 – Vinicio Ferreira da Costa Neto – Diretor Financeiro do IPREV;
- 3 – Haroldo Helinski Holanda – Assessor Contábil do IPREV;
- 4 – Maria Dilma De Medeiros – Servidor da Secretaria Municipal de Finanças (contadora);
- 5 – José Batista Rangel – Servidor da Secretaria Municipal de Finanças (contador); e
- 6 – Eduardo Xavier da Silva – Assessor Jurídico do IPREV.

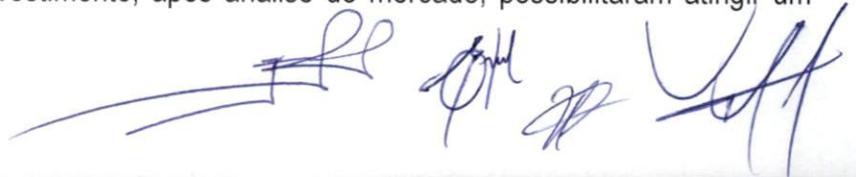
III. PAUTA:

- 1º PONTO: Avaliação do desempenho das aplicações componentes do ativo do Instituto;
- 2º PONTO: Análise da compatibilidade das aplicações de investimento com as obrigações presentes e futuras;
- 3º PONTO: Deliberação do comitê quanto a aplicação dos recursos referentes ao corrente mês.

IV. ASSUNTOS TRATADOS:

A reunião foi presidida pela Sra. Presidente do IPREV, a qual iniciou os trabalhos esclarecendo a pauta para a reunião e, em ato contínuo, concedeu a palavra aos integrantes do comitê para, conjuntamente, realizar análise da carteira de investimentos.

Inicialmente, observou-se que as aplicações feitas no mês de AGOSTO de 2019, a partir da análise deste comitê, obtiveram uma rentabilidade de 0,16% (zero vírgula dezesseis por cento) frente a uma meta atuarial para o mesmo período de 0,62% (zero vírgula sessenta e dois por cento). Destaque-se que as aplicações e remanejamentos autorizados pelo Comitê de Investimento, após análise do mercado, possibilitaram atingir um





retorno de rentabilidade de um total de R\$ 166.748,75 (cento e sessenta e seis mil, setecentos e quarenta e oito reais e setenta e cinco centavos). Malgrado a baixa rentabilidade tida no mês de agosto, muito em decorrência de inesperadas quedas no período que afetaram os investimentos em geral, o IPREV/SGA consegue se manter acima da meta atuarial anual.

Antes da decisão de investimentos para o mês de setembro de 2019 foi lido o relatório da LEMA Economia e Finanças, tendo a consultoria sugerido aplicação nos fundos CAIXA ALOCAÇÃO MACRO e CAIXA RV30, renda variável.

Quanto aos investimentos mensais, o comitê, a unanimidade, decidiu que os valores do Superávit Financeiro mensal serão destinados, seguindo a sugestão da LEMA, ao fundo no **CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP**.

Por sua vez, os valores oriundos do COMPREV disponíveis neste mês de setembro de 2019 foi aberta votação e os membros se posicionaram da seguinte forma: os membros Haroldo, Dilma, Rangel e Elaine votaram na alocação no fundo IMA B, enquanto os membros Vinício e Eduardo votaram para que a alocação foi feita ao fundo SMALL CAPS. Desse modo, por maioria de votos, os valores do COMPREV serão alocados no fundo IMA B.

Para o período, cumpre informar, o comitê decidiu não ser melhor momento para realizar realocações de ativos.

Por fim, não havendo mais assuntos pendentes na pauta, foi declarada encerrada a 54ª reunião ordinária deste comitê.


ELAINE CRISTINA SOUZA DE ARAÚJO
Presidente do IPREV


VINICIO FERREIRA DA COSTA NETO
Diretor Financeiro do IPREV


MARIA DILMA DE MEDEIROS
Servidora da Secretaria Municipal de
Finanças (contadora)


HAROLDO HELINSKI HOLANDA
Assessor Contábil do IPREV


JOSÉ BATISTA RANGEL
Servidor da Secretaria Municipal de Finanças
(contador)


EDUARDO XAVIER DA SILVA
Assessor Jurídico do IPREV

Material de Divulgação
10.740.658/0001-93
Informações referentes a ago/19

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Público Alvo:

Regimes Próprios de Previdência Social instituídos pelos Estados, Municípios e Distrito Federal do Brasil, das Entidades Públicas da Administração Direta, Autarquias, Fundações Públicas, Entidades Fechadas de Previdência Complementar, Fundos de Investimento e Fundos de Investimento em Cotas de Fundos de Investimento administrados pela Administradora, Entidades Abertas de Previdência Complementar, Companhias Seguradoras e Sociedades de Capitalização, previamente cadastrados perante a Administradora.

Objetivo e Política de Investimento:

O objetivo do CAIXA FI Brasil IMA-B Tit Publ RF LP é proporcionar aos cotistas a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por Títulos Públicos Federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice Índice de Mercado ANDIMA série B - IMA-B.

Outras Observações:

Para fins de atendimento das normas destinadas aos RPPS, será procedido ao envio das informações da carteira do FUNDO ao Ministério da Previdência Social na forma e periodicidade por ele estabelecido. Tipo ANBIMA: RENDA FIXA INDEXADOS - Fundos que têm como objetivo acompanhar as variações de indicadores de referência do mercado de Renda Fixa, não admitindo alavancagem.

PARÂMETROS DO FUNDO

| | | | |
|-----------------------|----------|------------------------|-------------------------------------|
| Taxa de Administração | 0,20% | Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados**** |
| Aplicação Inicial | 1.000,00 | Data Início | 08/03/10 |
| Aplicações Adicionais | Não há | Aplicação (déb./conv.) | D0 / D0 |
| Resgate Mínimo | Não há | Resgate (conv./créd.) | D0 / D0 |
| Saldo Mínimo | Não há | Cota Utilizada | Fechamento |
| Liquidez | Diária | Classificação de Risco | Moderado |
| Horário Permitido | 16:00 * | Enquadramento | CMN 3.922/10 Art. 7º, Inciso I, "b" |

* Horário de Brasília

****Descrição do tipo Anbima disponível no Formulário de Informações Complementares

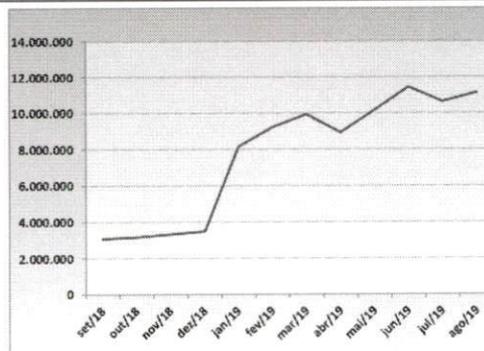
INFORMAÇÕES DE RISCO

| | | | |
|--|---------|--|---------|
| Volatilidade no ano ⁽¹⁾ | 5,0109% | Volatilidade nos últimos 12 m ⁽¹⁾ | 4,8071% |
| Tracking error no ano ⁽²⁾ | 0,2537 | Tracking error nos 12 m ⁽²⁾ | 0,2399 |
| % retornos positivos no ano | 66,07% | % retornos positivos últimos 12 m | 66,49% |
| Índice de Sharpe no ano ⁽³⁾ | | Índice de Sharpe nos 12 m ⁽³⁾ | |

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

| | |
|---------------------|--------|
| | 97,81% |
| ções Compromissadas | 2,19% |

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL (R\$ mil)



Patrimônio Líquido em 30/08/19

11.125.833.676,00

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO - 12 MESES

7.719.698.420,28

Regulamentação:

Instrução CVM 555/14 e alterações posteriores
Regulamento, Formulário de Inf. Complementares e Lâmina de Informações Essenciais disponíveis em www.caixa.gov.br
Portal de educação financeira da ANBIMA - Como investir: www.comoinvestir.com.br

Administrador:

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestor:

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Distribuidor:

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Custodiante:

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Auditor:

KPMG Auditores Independentes

Atendimento ao Cotista:

As informações sobre o Fundo poderão ser consultadas:

I - Diretamente nas Agências e/ou PABs

II - Pela "internet" nos endereços eletrônicos:

a) www.caixa.gov.br

III - SAC: 0800 726 0101

IV - Ouvidoria Caixa: 0800 725 7474

V - Atendimento a pessoas com deficiência auditiva: 0800 882 2492

Supervisão e Fiscalização

Comissão de Valores Mobiliários - CVM

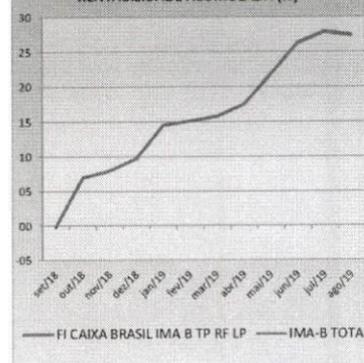
Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.

RENTABILIDADE

| Ano | Fundo | IMA-B TOTAL | % Bench |
|----------|---------|-------------|---------|
| 2014 | 14,318% | 14,544% | 98,45% |
| 2015 | 7,272% | 8,882% | 81,87% |
| 2016 | 24,560% | 24,811% | 98,99% |
| 2017 | 12,550% | 12,794% | 98,09% |
| 2018 | 12,837% | 13,059% | 98,30% |
| Mês | Fundo | IMA-B TOTAL | % Bench |
| set/18 | -0,181% | -0,149% | - |
| out/18 | 7,160% | 7,139% | 100,30% |
| nov/18 | 0,898% | 0,904% | 99,25% |
| dez/18 | 1,630% | 1,649% | 98,79% |
| jan/19 | 4,394% | 4,366% | 100,64% |
| fev/19 | 0,518% | 0,547% | 94,70% |
| mar/19 | 0,560% | 0,580% | 96,59% |
| abr/19 | 1,489% | 1,505% | 98,90% |
| mai/19 | 3,633% | 3,664% | 99,16% |
| jun/19 | 3,694% | 3,734% | 98,92% |
| jul/19 | 1,274% | 1,287% | 98,95% |
| ago/19 | -0,423% | -0,402% | - |
| Ano | 16,057% | 16,221% | 98,99% |
| 12 Meses | 27,298% | 27,526% | 99,17% |

Para o cálculo da rentabilidade é utilizada a cota do último dia útil do mês.
* A utilização do IMA-B TOTAL para comparativo da rentabilidade é mera referência econômica e não parâmetro de objetivo do Fundo.

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



(1) Grau médio de variação da cota do fundo

(2) Grau médio de variação da cota do fundo em relação ao Benchmark

(3) Índice que tem por objetivo ajustar o retorno do fundo pelo seu risco, ou seja, quanto maior o retorno e menor o risco do fundo, melhor será seu índice de Sharpe. Índices com valores menores que zero não têm significado interpretativo, por isso não serão divulgados.

Fonte: SISFIN, ANBIMA, ECONÔMICA, BACEN, BM&FROVESA.

TRIBUTAÇÃO

IR:

15% sobre o rendimento semestral. No resgate, será aplicada alíquota complementar de acordo com o prazo da aplicação, conforme tabela abaixo:

Até 180 dias: 22,5%
De 181 a 360 dias: 20,0%
De 361 a 720 dias: 17,5%
Acima de 720 dias: 15,0%

IOF: 1% ao dia, limitado ao rendimento do Fundo, de acordo com tabela decrescente em função do prazo de aplicação.

As cotistas isentos, imunes ou dispensados de retenção na fonte e do pagamento em separado do imposto de Renda sobre os rendimentos e ganhos auferidos no Fundo não incidirá Tributação.



Material de Divulgação
03.737.188/0001-43
 Informações referentes a ago/19

CARACTERÍSTICAS DO FUNDO

Público Alvo: Pessoas físicas e jurídicas.

Objetivo e Política de Investimento:

O Fundo tem como objetivo buscar a valorização de suas cotas por meio da aplicação de recursos em carteira diversificada de ativos financeiros, no âmbito do mercado financeiro e de capitais nacional e internacional. O prazo médio da carteira do Fundo será superior a 365 dias, o que poderá proporcionar ao cotista o benefício fiscal da alíquota de IR de até 15%, dependendo do tempo de aplicação.

Demais Observações:

A política de investimento do FUNDO está adequada às normas estabelecidas para os Regimes Próprios de Previdência Social - RPPS.
 Tipo ANBIMA: MULTIMERCADOS BALANCEADOS - Fundos que têm como objetivo buscar retorno no longo prazo por meio da compra de diversas classes de ativos e derivativos, incluindo cotas de Fundos. Estes Fundos possuem estratégia de alocação pré-determinada devendo especificar o mix de investimentos nas diversas classes de ativos, incluindo deslocamentos táticos e/ou políticas de rebalanceamento explícitas. O indicador de desempenho do fundo deverá acompanhar o mix de investimentos explicitado (asset allocation benchmark), não podendo, assim, ser comparado a uma única classe de ativos (por exemplo, 100% (cem por cento) CDI). Não é permitido aos Fundos nesta subcategoria possuir exposição financeira superior a 100% (cem por cento) do seu respectivo patrimônio líquido de forma direta e indireta. Estes Fundos não admitem alavancagem.

PARÂMETROS DO FUNDO

| | | | |
|-----------------------|---------|------------------------|-------------------------------|
| Taxa de Administração | 1,00% | Classificação ANBIMA | Multimercados Balanceados**** |
| Aplicação Inicial | 500,00 | Data Início | 20/06/00 |
| Aplicações Adicionais | 100,00 | Aplicação (déb./conv.) | D0 / D1 *** |
| Resgate Mínimo | 100,00 | Resgate (conv./créd.) | D1 / D3 *** |
| Saldo Mínimo | 100,00 | Cota Utilizada | Fechamento |
| Liquidez | Diária | Classificação de Risco | Arrojado |
| Horário Permitido | 14:30 * | | |

* Horário de Brasília

***Dias úteis contados após a data de solicitação.

****Descrição do tipo Anbima disponível no Formulário de Informações Complementares

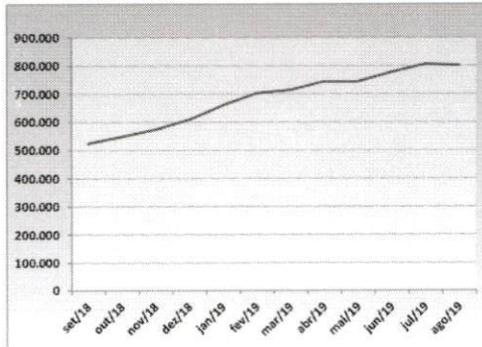
INFORMAÇÕES DE RISCO

| | | | |
|--|---------|--|---------|
| Volatilidade no ano ⁽¹⁾ | 5,6614% | Volatilidade nos últimos 12 m ⁽¹⁾ | 5,5835% |
| Tracking error no ano ⁽²⁾ | | Tracking error nos 12 m ⁽²⁾ | |
| % retornos positivos no ano | 55,95% | % retornos positivos últimos 12 m | 54,79% |
| Índice de Sharpe no ano ⁽³⁾ | | Índice de Sharpe nos 12 m ⁽³⁾ | |

COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA

| | |
|----------------------|--------|
| Ócios Compromissadas | 53,87% |
| NTNB | 45,13% |
| Derivativos | 0,34% |
| Cotas de Fundos | 0,30% |
| Financeiro e Outros | 0,23% |
| | 0,14% |

EVOLUÇÃO PATRIMONIAL (R\$ mil)



RENTABILIDADE

| Ano | Fundo | 70%CDI+30%IBOV | % Bench |
|-----------------|----------------|----------------|---------------|
| 2014 | 6,911% | 6,696% | 103,21% |
| 2015 | 4,956% | 5,273% | 93,99% |
| 2016 | 20,598% | 21,480% | 95,89% |
| 2017 | 13,759% | 15,005% | 91,70% |
| 2018 | 8,104% | 9,005% | 89,99% |
| Mês | Fundo | 70%CDI+30%IBOV | % Bench |
| set/18 | 1,241% | 1,370% | 90,55% |
| out/18 | 3,252% | 3,436% | 94,65% |
| nov/18 | 1,092% | 1,059% | 103,06% |
| dez/18 | -0,270% | -0,196% | - |
| jan/19 | 3,377% | 3,625% | 93,15% |
| fev/19 | -0,311% | -0,212% | - |
| mar/19 | 0,228% | 0,275% | 83,09% |
| abr/19 | 0,735% | 0,658% | 111,72% |
| mai/19 | 0,696% | 0,591% | 117,74% |
| jun/19 | 1,487% | 1,545% | 96,19% |
| jul/19 | 0,622% | 0,649% | 95,96% |
| ago/19 | | | - |
| Ano | 6,994% | 7,303% | 95,77% |
| 12 Meses | 12,760% | 13,479% | 94,67% |

Para o cálculo da rentabilidade é utilizado a cota do último dia útil do mês.
 *A utilização do 70%CDI+30%IBOV para comparativo da rentabilidade é mera referência econômica e não parâmetro de objetivo do Fundo.

RENTABILIDADE ACUMULADA (%)



(1) Grau médio de variação da cota do fundo
 (2) Grau médio de variação da cota do fundo em relação ao Benchmark
 (3) Índice que tem por objetivo ajustar o retorno do fundo pelo seu risco, ou seja, quanto maior o retorno e menor o risco do fundo, melhor será seu índice de Sharpe. Índices com valores menores que zero não têm significado interpretativo, por isso não serão divulgados.

Fonte: SISEFI, ANBIMA, ECONOMÁTICA, BACEN, BM&FBOVESPA

TRIBUTAÇÃO

IR:
 15% sobre o rendimento semestral. No resgate, será aplicada alíquota complementar de acordo com o prazo da aplicação, conforme tabela abaixo:
 Até 180 dias: 22,5%
 De 181 a 365 dias: 20,0%
 De 361 a 720 dias: 17,5%
 Acima de 720 dias: 15,0%

IOF: 1% ao dia, limitado ao rendimento do Fundo, de acordo com tabela decrescente em função do prazo de aplicação.

As cotistas isentas ou imunes não incidirá tributação.

Patrimônio Líquido em 30/08/19

800.771.542,47

PATRIMÔNIO LÍQUIDO MÉDIO - 12 MESES

683.576.434,88

Regulamentação:

Instrução CVM 555/14 e alterações posteriores
 Regulamento, Formulário de Inf. Complementares e Lâmina de Informações Essenciais disponíveis em www.caixa.gov.br
 Portal de educação financeira da ANBIMA - Como investir: www.comoinvestir.com.br

Administrador:

Gestor: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
 Distribuidor: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
 Custodiante: BANCO BRADESCO S/A
 Auditor: KPMG Auditores Independentes

Atendimento ao Cotista:

As informações sobre o Fundo poderão ser consultadas:
 I - Diretamente nas Agências e/ou PABX
 II - Pela "internet" nos endereços eletrônicos:
 a) www.caixa.gov.br
 III - SAC: 0800 726 0101
 IV - Ouvidoria Caixa: 0800 725 7474
 V - Atendimento a pessoas com deficiência auditiva: 0800 882 2492
Supervisão e Fiscalização
 Comissão de Valores Mobiliários - CVM
 Serviço de Atendimento ao Cidadão em www.cvm.gov.br.



ESTE DOCUMENTO ESTÁ SUJEITO A MODIFICAÇÕES E TEM CARÁTER EXCLUSIVAMENTE INFORMATIVO, NÃO SE CONSTITUINDO EM ACONSELHAMENTO PARA AQUISIÇÃO DE COTAS DESTES FUNDOS. LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS, SE HOUVER, E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR. RENTABILIDADE OBTIDA NO PASSADO NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RESULTADOS FUTUROS. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO DO FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO - FGC.

Alocação Set/2019 - São Gonçalo do Amarante RN

De: Matheus Crisóstomo (matheus@lemaef.com.br)

Para: financeiro.iprev@yahoo.com

Cc: vitor@lemaef.com.br; patrick@lemaef.com.br; gregorio@lemaef.com.br

Data: terça-feira, 10 de setembro de 2019 12:29 BRT

Conflitos geopolíticos, moratória da Argentina, falta de entendimento entre as principais potências mundiais trouxeram volatilidade aos mercados internacionais. Autoridades monetárias mundiais adotaram posição de maior estímulo monetário em torno de temores de quadros recessivos. Essas incertezas fizeram com que o Dólar se valorizasse bastante em relação as moedas de países emergentes, durante a parte final do mês de agosto.

Já no Brasil, o cenário econômico é mais animador, com dados de crescimento de 0,4% do PIB no segundo trimestre de 2019, aprovação de reformas importantes e o ajuste fiscal do governo brasileiro. Na política monetária o Copom (Comitê de Política Monetária do Banco Central) reduziu a Taxa Selic para o nível mais baixo da história. As projeções para inflação indicam controle diante de balanço de risco mais favorável.

Mesmo com uma perspectiva interna favorável, isso não foi suficiente para manter os bons rendimentos dos investimentos no Brasil. Notícias do cenário externo, com destaque para a Argentina, geraram forte instabilidade econômica. Para os países emergentes que mantêm relações comerciais com a Argentina, como é o caso do Brasil. Esses eventos sobrepuseram o cenário interno e reverteram os resultados dos mercados a partir da metade de agosto.

O cenário de juros baixos é razoavelmente novo para os brasileiros, refletindo um maior desafio aos gestores de recursos dos RPPS. A taxa de juros baixa reflete menores rendimentos em títulos públicos federais pré-fixados (IRF-M1) e fundos de investimentos indexados ao CDI. Por outro lado, a queda dos juros que vinha sendo precificada pelo mercado desde o início do ano favoreceu os títulos públicos atrelados a inflação (IMA-B), que apresentam características mais arrojadas, principalmente os de vencimentos mais longos (IMA-B5+). Foi gerada uma certa pressão inflacionária por conta da forte subida do dólar registrada a partir do dia 15/08, o que fez com que as taxas de juros de médio prazo fossem elevadas, impactando negativamente os títulos públicos federais de característica mais arrojadas.

O retorno do IPREV tem sido muito bom, representando 141,03% da meta até agosto, acreditamos que no atual momento podemos fazer um movimento de encurtar a carteira, alocando os recursos fundos como IRF-M1 e o IMA-B.

Diante do atual cenário brasileiro, o mercado de renda variável tende a se valorizar, beneficiando fundos enquadrados no artigo 8º II "a" (Ações livres) e 8º III (Multimercados). Fundos como o CAIXA ALOCAÇÃO MACRO e CAIXA RV30 se apresentam como boas alternativas.

Estamos disponíveis para esclarecimentos em caso de dúvidas.

Att,



CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP - 03737188000143 - 20190910122253.pdf
72.4kB



CAIXA ALOCACAO MACRO FIC MULTIMERCADO LP - 08070841000187 - 20190910122517.pdf
68.6kB

CARACTERÍSTICAS

Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Custodiante: Banco Bradesco
 Auditor: KPMG
 Taxa de Administração: 1,00%
 Taxa de administração máxima: 1,00%
 Taxa de Performance: Não possui
 Índice de Performance: Não possui

PERFIL DO FUNDO

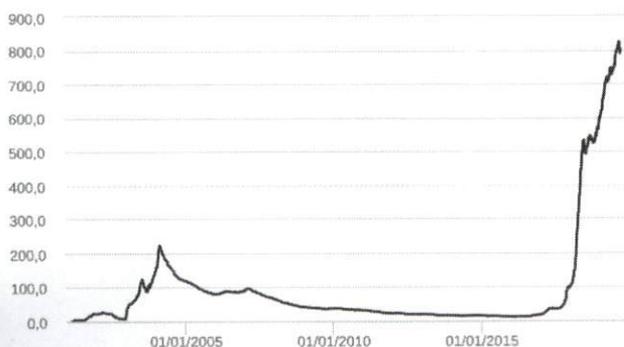
Classificação Quantum: Híbrido
 Classificação Anbima: Multimercados Balanceados
 Público Alvo: Investidores em geral
 Objetivo: Obter ganhos de capital.
 Política de investimento: Aplica seus recursos em carteira diversificada de ativos financeiros, no âmbito do mercado financeiro e de capitais nacional e internacional, não podendo deter mais de 30% em ativos de renda variável.

RETORNO (%)

| | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | ago/19 | jul/19 | jun/19 | mai/19 | abr/19 | mar/19 | fev/19 | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 |
|--------------------|--------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 621,42 | 7,81 | 14,52 | 21,34 | 37,85 | 0,29 | 0,62 | 1,49 | 0,70 | 0,74 | 0,23 | -0,31 | 3,38 | -0,27 | 1,09 | 3,25 | 1,24 |
| % do Meta Atuarial | 76,78 | 115,53 | 150,91 | 101,00 | 119,86 | 47,47 | 85,92 | 330,09 | 108,60 | 69,38 | 19,14 | -34,68 | 406,04 | -43,90 | 432,34 | 337,95 | 134,53 |
| CDI | 833,81 | 4,30 | 6,35 | 13,67 | 27,43 | 0,50 | 0,57 | 0,47 | 0,54 | 0,52 | 0,47 | 0,49 | 0,54 | 0,49 | 0,49 | 0,54 | 0,47 |
| Dólar | 103,92 | 4,91 | -2,41 | 29,17 | 24,98 | 9,92 | -1,76 | -2,75 | -0,12 | 1,25 | 4,23 | 2,37 | -5,75 | 0,30 | 3,92 | -7,15 | -3,18 |
| Euro | 140,41 | 1,14 | -6,80 | 19,94 | 23,78 | 8,53 | -3,85 | -0,80 | -0,59 | 1,00 | 2,78 | 1,55 | -5,55 | 1,33 | 3,96 | -9,47 | -2,95 |
| Ibovespa | 508,58 | 17,12 | 37,78 | 45,32 | 75,73 | -0,67 | 0,84 | 4,06 | 0,70 | 0,98 | -0,18 | -1,86 | 10,82 | -1,81 | 2,38 | 10,19 | 3,48 |
| IGP-M | 273,81 | 4,14 | 4,83 | 14,35 | 12,39 | -0,67 | 0,40 | 0,80 | 0,45 | 0,92 | 1,26 | 0,88 | 0,01 | -1,08 | -0,49 | 0,89 | 1,52 |

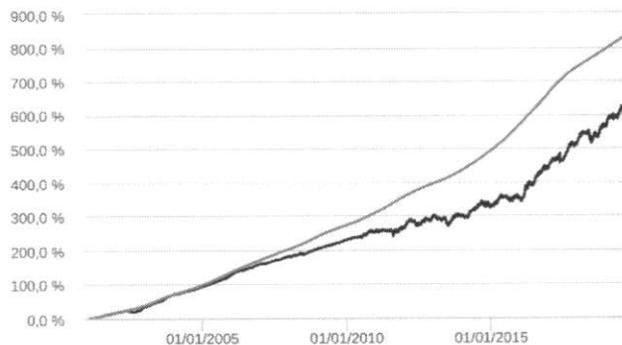
GRÁFICOS

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/02/2001 a 06/09/2019 (diária)



■ Fundo

Retorno Acumulado - 05/02/2001 a 06/09/2019 (diária)



■ Fundo

■ CDI

HISTÓRICO

PL Médio 12 meses: R\$ 677.225.165,30
 Início do Fundo: 20/06/2000
 Máximo Retorno Mensal: 5,38% (mar/2016)
 Mínimo Retorno Mensal: -3,02% (jun/2013)
 Nº de Meses com Retorno Positivo: 179
 Nº de Meses com Retorno Negativo: 43
 Retorno Acumulado Desde o Início: 621,42%
 Volatilidade Desde o Início: 4,48%

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação mínima: R\$ 500,00
 Movimentação mínima: R\$ 100,00
 Saldo mínimo: R\$ 100,00
 Contato: gepot@caixa.gov.br
 Disponibilidade dos recursos aplicados: D+0
 Conversão de cota para aplicação: D+0
 Conversão de cota para resgate: D+1 du
 Disponibilidade dos recursos resgatados: D+3 du

CARACTERÍSTICAS

Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Custodiante: Caixa Econômica Federal
 Auditor: KPMG
 Taxa de Administração: 0,50%
 Taxa de administração máxima: 2,00%
 Taxa de Performance: Não possui
 Índice de Performance: Não possui

PERFIL DO FUNDO

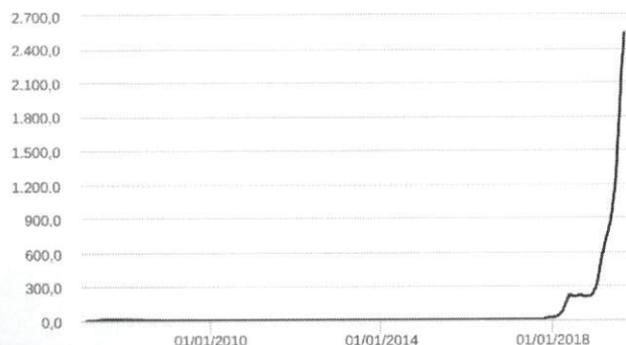
Classificação Quantum: Híbrido
 Classificação Anbima: Multimercados Macro
 Público Alvo: Investidores em geral
 Objetivo: Buscar rentabilidade que supere a variação do CDI.
 Política de investimento: Aplica em fundos que invistam em carteira diversificada de ativos financeiros e demais modalidades operacionais disponíveis no âmbito do mercado financeiro e de capitais, nacional e internacional, com prazo médio superior a 365 dias.

RETORNO (%)

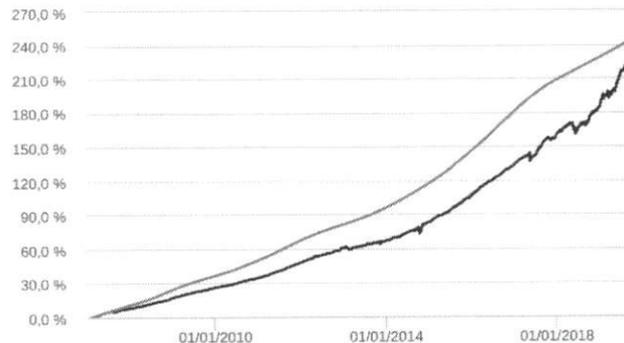
| | Início | Ano | 12 meses | 24 meses | 36 meses | ago/19 | jul/19 | jun/19 | mai/19 | abr/19 | mar/19 | fev/19 | jan/19 | dez/18 | nov/18 | out/18 | set/18 |
|--------------------|--------|--------|----------|----------|----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|
| Fundo | 218,75 | 12,38 | 19,00 | 26,66 | 42,29 | 0,61 | 1,32 | 2,32 | 1,96 | 1,19 | 0,48 | 0,00 | 3,68 | 0,96 | 0,81 | 2,76 | 0,81 |
| % do Meta Atuarial | 69,71 | 183,22 | 197,49 | 126,17 | 133,95 | 97,61 | 182,85 | 515,92 | 305,55 | 112,72 | 39,98 | -0,80 | 442,39 | 156,93 | 320,30 | 286,72 | 87,76 |
| CDI | 241,89 | 4,30 | 6,35 | 13,67 | 27,43 | 0,50 | 0,57 | 0,47 | 0,54 | 0,52 | 0,47 | 0,49 | 0,54 | 0,49 | 0,49 | 0,54 | 0,47 |
| Dólar | 92,72 | 4,91 | -2,41 | 29,17 | 24,98 | 9,92 | -1,76 | -2,75 | -0,12 | 1,25 | 4,23 | 2,37 | -5,75 | 0,30 | 3,92 | -7,15 | -3,18 |
| Euro | 63,40 | 1,14 | -6,80 | 19,94 | 23,78 | 8,53 | -3,85 | -0,80 | -0,59 | 1,00 | 2,78 | 1,55 | -5,55 | 1,33 | 3,96 | -9,47 | -2,95 |
| Ibovespa | 129,69 | 17,12 | 37,78 | 45,32 | 75,73 | -0,67 | 0,84 | 4,06 | 0,70 | 0,98 | -0,18 | -1,86 | 10,82 | -1,81 | 2,38 | 10,19 | 3,48 |
| IGP-M | 110,75 | 4,14 | 4,83 | 14,35 | 12,39 | -0,67 | 0,40 | 0,80 | 0,45 | 0,92 | 1,26 | 0,88 | 0,01 | -1,08 | -0,49 | 0,89 | 1,52 |

GRÁFICOS

Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 02/02/2007 a 06/09/2019 (diária)



Retorno Acumulado - 02/02/2007 a 06/09/2019 (diária)



■ Fundo

HISTÓRICO

PL Médio 12 meses: R\$ 813.295.174,55
 Início do Fundo: 01/02/2007
 Máximo Retorno Mensal: 3,68% (jan/2019)
 Mínimo Retorno Mensal: -1,92% (mai/2018)
 Nº de Meses com Retorno Positivo: 143
 Nº de Meses com Retorno Negativo: 7
 Retorno Acumulado Desde o Início: 218,75%
 Volatilidade Desde o Início: 2,11%

■ Fundo

■ CDI

INFORMAÇÕES OPERACIONAIS

Aplicação mínima: R\$ 50.000,00
 Movimentação mínima: R\$ 100,00
 Saldo mínimo: R\$ 100,00
 Contato: gepot@caixa.gov.br
 Disponibilidade dos recursos aplicados: D+0
 Conversão de cota para aplicação: D+1 du
 Conversão de cota para resgate: D+1 du
 Disponibilidade dos recursos resgatados: D+3 du

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2019

LEMA
ECONOMIA & FINANÇAS

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

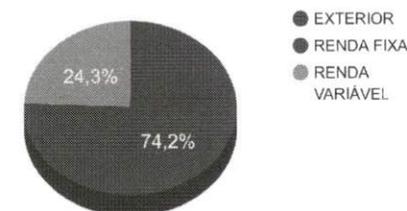
| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|------------------|------------------------------------|
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 4.049.164,10 | 3,77% | 73 | 1,80% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 3.578.473,68 | 3,33% | 351 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 1.039.275,98 | 0,97% | 940 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 8.857.021,18 | 8,24% | 962 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+3 | Não há | 18.696.494,49 | 17,40% | 542 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 4.782.785,47 | 4,45% | 308 | 0,22% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 16.405.704,09 | 15,27% | 1.390 | 0,14% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 57.700,76 | 0,05% | 1.214 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 3.335.056,32 | 3,10% | 417 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 18.674.478,46 | 17,38% | 630 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 7.055.961,02 | 6,57% | 95 | 1,65% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 5.005.007,71 | 4,66% | 2.045 | 4,90% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 5.589.911,41 | 5,20% | 4.051 | 1,21% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | D+2 | 02/01/2020 | 2.231.626,69 | 2,08% | 729 | 0,80% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | D+2 | 01/10/2020 | 6.275.714,48 | 5,84% | 955 | 1,29% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | D+4 | Não há | 1.595.048,61 | 1,48% | 66 | 0,28% | Artigo 9º - A, Inciso III |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 107.229.424,45 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 234.647,05 | | | | Artigo 6º |
| Total | | | 107.464.071,50 | | | | |

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

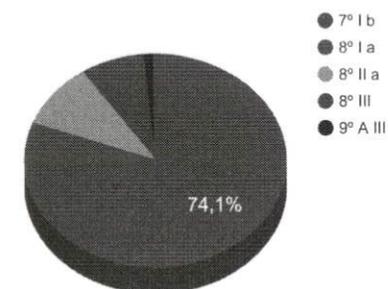
| Artigos | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|-------------|----------------|------------|------------------------|--------|------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 79.476.154,53 | 74,12% | 40,00% | 55,00% | 100,00% | 27.753.269,92 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 60,00% | 64.337.654,67 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 40,00% | 42.891.769,78 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 15,00% | 16.084.413,67 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 5.361.471,22 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 3,00% | 5,00% | 5.361.471,22 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 30,00% | 7.055.961,02 | 6,58% | 0,00% | 3,00% | 30,00% | 25.112.866,32 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00% | 10.594.919,12 | 9,88% | 0,00% | 7,00% | 20,00% | 10.850.965,77 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 8.507.341,17 | 7,93% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 2.215.601,28 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 5.361.471,22 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00% | 1.595.048,61 | 1,49% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -1.595.048,61 |
| Total Carteira | | 107.229.424,45 | | | | | |

| | | |
|----------------|---------------|--------|
| EXTERIOR | 1.595.048,61 | 1,49% |
| RENDA FIXA | 79.710.801,58 | 74,34% |
| RENDA VARIÁVEL | 26.158.221,31 | 24,39% |

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Base: agosto / 2019 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|---------------------|--------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 100,00% |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 79.476.154,53 | 73,96% | 40,00% | 100,00% |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 100,00% |
| Artigo 7º, Inciso II | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 40,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 40,00% |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 20,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 7.055.961,02 | 6,57% | 0,00% | 30,00% |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 30,00% |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 10.594.919,12 | 9,86% | 0,00% | 20,00% |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 20,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 8.507.341,17 | 7,92% | 0,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |

| Artigos | Carteira (\$) | Carteira (%) | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|---------------------------|----------------|--------------|---------------------|---------------------|
| Artigo 9º - A, Inciso III | 1.595.048,61 | 1,48% | 0,00% | 0,00% |
| Total | 107.229.424,45 | 99,78% | 40,00 | 690,00 |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DE SÃO GONÇALO DO AMARANTE
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/08/2019

| Gestão | Valor | % s/ Carteira | % s/ PL Gestão |
|-----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 84.426.065,10 | 78,56% | 0,02% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 18.754.195,25 | 17,45% | 0,00% |
| BANCO DO NORDESTE DO BRASIL | 4.049.164,10 | 3,77% | 0,04% |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IRF-M 1 | 0,55% | 4,63% | 1,86% | 3,55% | 7,40% | 14,81% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,52% | 4,50% | 1,81% | 3,45% | 7,24% | 14,42% | 0,20% | 0,181% | 0,46% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,52% | 4,47% | 1,80% | 3,42% | 7,19% | 14,31% | 0,10% | 0,181% | 0,47% |
| IRF-M | 0,26% | 8,42% | 3,54% | 6,63% | 16,67% | 23,59% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,20% | 8,15% | 3,46% | 6,42% | 16,48% | 23,01% | 0,20% | 1,066% | 3,46% |
| IMA Geral ex-C | 0,17% | 8,94% | 3,09% | 6,43% | 15,60% | 22,43% | - | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,08% | 9,42% | 3,30% | 6,85% | 16,13% | 22,79% | 0,30% | 1,176% | 3,39% |
| IPCA | 0,11% | 2,54% | 0,31% | 1,77% | 3,43% | 7,77% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | -0,13% | 12,00% | 3,74% | 8,33% | 16,60% | 23,55% | 0,002 | 1,744% | 3,51% |
| IRF-M 1+ | 0,10% | 9,83% | 4,13% | 7,74% | 20,45% | 27,07% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,05% | 9,55% | 4,07% | 7,54% | 20,31% | 26,46% | 0,20% | 1,556% | 4,70% |
| IDKA IPCA 2 Anos | 0,08% | 7,42% | 2,35% | 5,52% | 12,59% | 21,63% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,10% | 7,06% | 2,25% | 5,13% | 11,98% | 20,25% | 0,20% | 0,743% | 1,87% |
| IMA-B 5+ | -0,77% | 22,00% | 5,82% | 13,81% | 38,20% | 41,83% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,79% | 21,65% | 5,75% | 13,61% | 37,44% | 40,76% | 0,20% | 3,613% | 11,78% |
| IMA-B | -0,40% | 16,22% | 4,65% | 10,75% | 27,53% | 33,35% | - | - | - |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | -0,35% | 14,56% | 4,31% | 9,92% | 23,97% | 29,64% | 0,20% | 2,338% | 6,45% |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,42% | 16,06% | 4,57% | 10,60% | 27,30% | 32,79% | 0,20% | 2,483% | 7,74% |
| Não definido | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

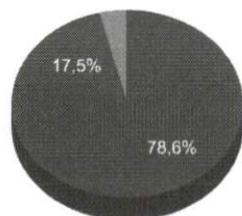
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IDIV | 2,23% | 24,66% | 8,32% | 13,12% | 50,25% | 50,69% | - | - | - |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 0,72% | 18,45% | 7,85% | 7,86% | 41,81% | 35,60% | 1,50% | 10,564% | 17,81% |
| SMLL | 0,48% | 27,92% | 14,76% | 19,08% | 51,06% | 47,54% | - | - | - |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 0,68% | 26,04% | 14,28% | 17,42% | 45,37% | 42,46% | 1,50% | 11,894% | 16,07% |
| Ibovespa | -0,67% | 15,07% | 4,23% | 5,81% | 31,90% | 42,77% | - | - | - |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 0,40% | 3,56% | 1,42% | 2,70% | 7,96% | - | 1,60% | 0,106% | 1,45% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 0,36% | 5,45% | 2,13% | 4,21% | 11,87% | - | 1,60% | 0,487% | 2,66% |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | -0,69% | 14,68% | 4,07% | 5,60% | 31,15% | 41,26% | 0,50% | 11,532% | 14,32% |

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (agosto / 2019)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| Global BDRX | 6,06% | 24,78% | 11,52% | 16,91% | 2,97% | 60,77% | - | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | 6,02% | 24,10% | 11,56% | 16,53% | 2,30% | 56,43% | 0,70% | 9,287% | 22,94% |

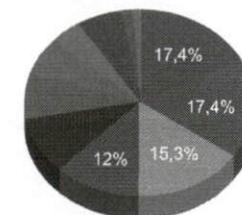
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (agosto / 2019)

| Administrador | Valor | % |
|-------------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 84.426.065,10 | 78,56% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 18.754.195,25 | 17,45% |
| Santander Securities Services | 4.049.164,10 | 3,77% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 234.647,05 | 0,22% |



- CAIXA ECONÔMI...
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- Santander Securities Services
- DISPONIB...

| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|---------------|--------|
| IMA-GERAL EX-C | 18.696.494,49 | 17,40% |
| GESTÃO DURATION | 18.674.478,46 | 17,38% |
| IRF-M 1 | 16.463.404,85 | 15,32% |
| IMA-B | 12.906.185,28 | 12,01% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 10.594.919,12 | 9,86% |
| MULTIMERCADO | 8.507.341,17 | 7,92% |
| AÇÕES - INDEXADO | 7.055.961,02 | 6,57% |
| IRF-M 1+ | 4.782.785,47 | 4,45% |
| IMA-B 5+ | 3.578.473,68 | 3,33% |
| IRF-M | 3.335.056,32 | 3,10% |
| BDR NÍVEL I | 1.595.048,61 | 1,48% |
| IDKA IPCA 2A | 1.039.275,98 | 0,97% |
| DISP. FINANCEIRA | 234.647,05 | 0,22% |

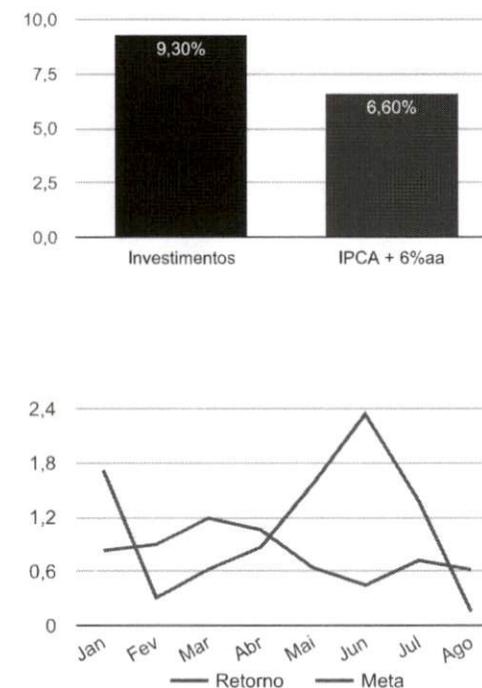


- IMA-GERAL EX-C
- GESTÃO DURATION
- IRF-M 1
- IMA-B
- AÇÕES - SETORIAIS
- MULTIME...
- AÇÕES - INDEXADO
- IRF-M 1+
- IMA-B 5+
- IRF-M
- BDR NÍVEL I
- IDKA IPCA 2A
- DISP. FINANCE...

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|---------------|---------------|----------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro | 94.068.096,09 | 3.999.840,37 | 3.523.385,24 | 96.173.379,33 | 1.628.828,11 | 1,72% | 0,83% | 207,16% | 1,15% |
| Fevereiro | 96.173.379,33 | 19.021.010,82 | 19.088.614,69 | 96.405.274,98 | 299.499,52 | 0,31% | 0,90% | 34,78% | 1,43% |
| Março | 96.405.274,98 | 10.421.973,44 | 9.036.000,00 | 98.401.298,73 | 610.050,31 | 0,62% | 1,19% | 52,26% | 2,75% |
| Abril | 98.401.298,73 | 1.808.180,95 | 1.100.100,00 | 99.967.714,51 | 858.334,83 | 0,87% | 1,06% | 81,74% | 1,53% |
| Mai | 99.967.714,51 | 14.221.435,99 | 13.143.600,00 | 102.629.401,61 | 1.583.851,11 | 1,57% | 0,64% | 244,67% | 2,26% |
| Junho | 102.629.401,61 | 2.266.488,24 | 2.015.944,89 | 105.285.758,05 | 2.405.813,09 | 2,34% | 0,45% | 519,27% | 2,04% |
| Julho | 105.285.758,05 | 6.974.626,59 | 6.352.672,17 | 107.369.341,34 | 1.461.628,87 | 1,38% | 0,72% | 190,56% | 1,59% |
| Agosto | 107.369.341,34 | 3.825.934,36 | 4.132.600,00 | 107.229.424,45 | 166.748,75 | 0,16% | 0,62% | 25,03% | 3,10% |
| Acumulado no ano | | | | | 9.014.754,59 | 9,30% | 6,60% | 141,03% | |

Acumulado no Ano



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

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|--------------|-------------------------|------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 16.320.029,57 | 0,00 | 0,00 | 16.405.704,09 | 85.674,52 | 0,52% | 0,18% | 0,52% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 471.057,68 | 715.934,36 | 1.132.600,00 | 57.700,76 | 3.308,72 | 0,28% | 0,18% | 0,52% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.328.508,96 | 0,00 | 0,00 | 3.335.056,32 | 6.547,36 | 0,20% | 1,07% | 0,20% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.031.544,98 | 0,00 | 3.000.000,00 | 1.039.275,98 | 7.731,00 | 0,19% | 0,74% | 0,10% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 18.571.254,37 | 110.000,00 | 0,00 | 18.696.494,49 | 15.240,12 | 0,08% | 1,18% | 0,08% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 4.780.595,13 | 0,00 | 0,00 | 4.782.785,47 | 2.190,34 | 0,05% | 1,56% | 0,05% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 18.698.694,05 | 0,00 | 0,00 | 18.674.478,46 | -24.215,59 | -0,13% | 1,74% | -0,13% |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | 4.063.536,47 | 0,00 | 0,00 | 4.049.164,10 | -14.372,37 | -0,35% | 2,34% | -0,35% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.902.716,00 | 1.000.000,00 | 0,00 | 8.857.021,18 | -45.694,82 | -0,51% | 2,48% | -0,42% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.618.113,36 | 1.000.000,00 | 0,00 | 3.578.473,68 | -39.639,68 | -1,10% | 3,61% | -0,79% |
| | | | | Total Renda Fixa | -3.230,40 | -0,00% | 1,43% | |

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

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|--------------|----------|-----------------------------|------------------|--------------|---------------|----------------|
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | 4.969.076,45 | 0,00 | 0,00 | 5.005.007,71 | 35.931,26 | 0,72% | 10,56% | 0,72% |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 5.552.050,51 | 0,00 | 0,00 | 5.589.911,41 | 37.860,90 | 0,68% | 11,89% | 0,68% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO | 2.222.775,45 | 0,00 | 0,00 | 2.231.626,69 | 8.851,24 | 0,40% | 0,11% | 0,40% |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 6.253.320,55 | 0,00 | 0,00 | 6.275.714,48 | 22.393,93 | 0,36% | 0,49% | 0,36% |
| CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES | 6.081.632,73 | 1.000.000,00 | 0,00 | 7.055.961,02 | -25.671,71 | -0,36% | 11,53% | -0,69% |
| | | | | Total Renda Variável | 79.365,62 | 0,30% | 7,80% | |

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

| Ativos de Investimentos no Exterior | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|---------------|------------|----------|----------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | 1.504.435,08 | 0,00 | 0,00 | 1.595.048,61 | 90.613,53 | 6,02% | 9,29% | 6,02% |
| | | | | Total Exterior | 90.613,53 | 6,02% | 9,29% | |