



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE SÃO GONÇALO DO AMARANTE/RN
Rua Pastor Cícero Hipólito, nº 23, Santa Terezinha, São Gonçalo do Amarante/RN - CEP: 59.290- 000
Telefone: (84) 3278-3342 | E-mail: iprev@saogoncalo.rn.gov.br CNPJ 11.447.510.0001/28

DATA: 11/10/2019

LOCAL: Sede do IPREV

HORÁRIO: 14h

PAUTA DA 18ª REUNIÃO ORDINÁRIA DO CFA/IPREV

- I. VERIFICAÇÃO DO QUÓRUM REGIMENTAR;**
- II. APRESENTAÇÃO DOS BALANCETES (RECEITAS E DESPESAS) SETEMBRO-2019;**
- III. INVESTIMENTOS;**
- IV. APROVAÇÃO DA POLÍTICA DE INVESTIMENTO;**
- V. INFORMES.**

PRESIDENTE DO CAF/IPREV



FREQUÊNCIA REUNIÃO DO CFA/ IPREV

Instituto de Previdência Municipal de São Gonçalo do Amarante-RN

Data: 11 / 10 / 2019

1.	OTHON MILITAN JUNIOR	FONE (84) 999829426
2.	JOSÉ BATISTA RINGER	FONE ()
3.	Antonio Crispianiano de Sampaio	FONE () 999838349
4.	José Góssio de Nascimento Junior	FONE (84) 99621-1516
5.	Maria de Fátima da Silva Figueiredo	FONE (x) 98822 7113
6.	Erivan Monteiro da Costa	FONE () 98846 7976
7.	Guilherme de Oliveira	FONE ()
8.		FONE ()
9.		FONE ()
10.		FONE ()
11.		FONE ()
12.		FONE ()
13.		FONE ()
14.		FONE ()
15.		FONE ()
16.		FONE ()
17.		FONE ()
18.		FONE ()
19.		FONE ()
20.		FONE ()



ATA DA 18ª REUNIÃO DOS MEMBROS TITULARES E SUPLENTE DO CONSELHO FISCAL E DE ADMINISTRAÇÃO DO IPREV – 2018-2020

Aos onze dias de outubro de dois mil e dezenove, na sede do IPREV, situada à Rua Pastor Cícero Hipólito da Rocha, nº 23, Santa Terezinha, São Gonçalo do Amarante/RN, a partir das 14h10min, teve início a 18ª Reunião Ordinária do Conselho Fiscal Administrativo do IPREV. Diante da ausência justificada da Presidente, Srª Lauriana Martins, houve substituição pelo conselheiro José Basílio que foi escolhido pelos presentes para condução apenas dessa Reunião. Após uma breve mensagem de boas-vindas, O Srº Basílio leu a pauta com os seguintes itens: Verificação do quórum; apresentação dos balancetes (receita e despesas) setembro/2019; investimento; aprovação da política de investimento e informes. O presidente passou a palavra para o Representante da Lema, assessoria de investimento, para fazer a apresentação da Política de Investimento do exercício de 2020. Informou, ainda, que o Comitê de Investimento estava presente para acompanhar a apresentação da Política. Passada a palavra ao Sr. Vitor, foi realizada a análise da carteira do mês de setembro/2019 bem como a evolução do patrimônio nesse período desde janeiro/2018. O representante da assessoria destacou as alterações da portaria MF nº 464 que disciplina normas aplicáveis as avaliações atuárias, destacou a meta atuarial que foi prevista para IPCA + 5,89%. Seguiu a apresentação mostrando o percentual máximo e mínimo de cada seguimento de investigação bem como o alvo para os investimentos de 2020. Encerrada a apresentação da política de investimento, foi dada a oportunidade para questionamento, ato contínuo, os membros do Conselho Fiscal e de Administração aprovaram a Política de Investimento para o exercício de 2020. Na sequência, o Srº Basílio passou a palavra para a Presidente do Instituto, Elaine, a qual foi a responsável pela leitura da Receita e Despesa do mês em tela. Dando continuidade, a Srª Presidente do IPREV, passou a palavra para Diretor financeiro Sr. Vinício, que fez a apresentação do relatório mensal da Lema com as informações dos investimentos, foi possível observar que as aplicações renderam R\$ 1.971.157,53 (um milhão, novecentos e setenta e um mil, cento e cinquenta e sete reais e cinquenta e três centavos). Ressaltou que o Instituto recebeu repasse do COMPREV. As despesas, do referido mês, totalizaram o montante de R\$ 1.163.516,48 (um milhão, cento e sessenta e três mil, quinhentos e dezesseis reais e quarenta e oito centavos), conforme anexo. No momento de análise dos investimentos do mês em tela, finalizamos o mês de setembro/2019 com um saldo de R\$ 109.551.679,08 (Cento e nove milhões, quinhentos e cinquenta e um mil, seiscentos e setenta e nove reais e oito centavos). Finalizando a reunião, os conselheiros fizeram análise dos balancetes e extratos apresentados e aprovaram a prestação de conta do mês de setembro/2019. Por fim, o presidente encerrou a reunião às 15h45min, informando que nossa próxima reunião será dia 11/11/2019.



**ATA DA 18ª REUNIÃO DOS MEMBROS TITULARES E SUPLENTE DO
CONSELHO FISCAL E DE ADMINISTRAÇÃO DO IPREV – 2018-2020**

Gilvan Monteiro da Costa

Gilvan Monteiro da Costa
Conselheiro

Jose Basílio Júnior
Jose Basílio Júnior
Conselheiro

Geraldo Veríssimo de Oliveira
Geraldo Veríssimo de Oliveira
Conselheiro

Othon Militão Júnior
Othon Militão Júnior
Conselheiro

Antônio Crispiniano de Barros
Antônio Crispiniano de Barros
Conselheiro

Maria de Fátima da Silva Firmino
Maria de Fátima da Silva Firmino
Conselheiro



IPREV – Instituto de Previdência Municipal de São Gonçalo do Amarante
Rua Pastor Cicero Hipolito da Rocha nº 23 - Santa Terezinha
São Gonçalo do Amarante RN
CEP: 59.290-731



BALANCETE CONSOLIDADO DA RECEITA

Período 01/09/2019 a 30/09/2019

		Cta Crédito	R\$
Contribuição Servidor Ativo (PMSGa/SAAE/CAM)			R\$ 427.544,65
PREFEITURA MUNICIPAL DE SGA (AGOSTO)		9.197-9	R\$ 409.796,77
SISTEMA AUTÔNOMO DE ÁGUA E ESGOTO (AGOSTO)		9.197-9	R\$ 17.747,88
CÂMARA MUNICIPAL DE SGA (AGOSTO)		9.197-9	3719,67
Contribuição Patronal (PMSGa/SAAE/CAM)			R\$ 577.044,84
PREFEITURA MUNICIPAL DE SGA (AGOSTO)		9.197-9	R\$ 540.694,41
SISTEMA AUTÔNOMO DE ÁGUA E ESGOTO (AGOSTO)		9.197-9	R\$ 36.350,43
CÂMARA MUNICIPAL DE SGA (JULHO)		9.197-9	R\$ 956,96
CÂMARA MUNICIPAL DE SGA (AGOSTO)		9.197-9	R\$ 8.058,13
Demais Contribuições			R\$ 407.328,13
Contribuição Patronal Auxílio Doença (AGOSTO)		9.197-9	R\$ 43.142,13
Contribuição Servidor Inativo		9.140-5	R\$ 1.233,97
Parcelamento 850/2015 (44/60)		9.197-9	R\$ 102.156,84
Parcelamento 1124/2016 (33/60)		9.197-9	R\$ 46.031,70
Parcelamento 2122/2017 (21/60)		9197-9	R\$ 110.374,18
Parcelamento 310/2018 (19/60)		9197-9	R\$ 37.412,78
Parcelamento 548/2019 (02/60)		9197-9	R\$ 21.884,62
Contribuição de Servidor Efetivo		9945-7	R\$ 642,34
Contribuição Patronal de Servidor Efetivo		9.945-7	R\$ 1.356,50
Receita COMPREV		27-6	R\$ 43.093,07
Total Receitas Orçamentárias:			R\$ 1.411.917,62



IPREV – Instituto de Previdência Municipal de São Gonçalo do Amarante
Rua Pastor Cicero Hipolito da Rocha nº 23 - Santa Terezinha
São Gonçalo do Amarante RN
CEP: 59.290-731



BALANCETE CONSOLIDADO DA DESPESA

Período 01/09/2019 a 30/09/2019

DISCRIMINAÇÃO	DESPESA	Cta Débito	R\$
Tarifas Bancárias	33.90.39.00	9140-5	R\$ 715,89
Tarifas Bancárias	33.90.39.00	9945-7	R\$ 48,35
Tarifas Bancárias	33.90.39.00	71004-4	R\$ 76,39
Tarifas Bancárias	33.90.39.00	0018-7	R\$ 347,52
COSERN (SETEMBRO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 1.005,40
SAAE (SETEMBRO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 82,10
ARIMA (SETEMBRO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 2.000,00
AM SERVIÇOS - IMPRESSORAS (AGOSTO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 331,83
AM SERVIÇOS - SCANNER (AGOSTO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 458,00
AM SERVIÇOS - CPU (AGOSTO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 187,80
LEMA (AGOSTO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 2.500,00
TOPDOWN (AGOSTO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 5.400,00
NATAL TECNOLOGIA (AGOSTO)	33.90.39.00	9.945-7	R\$ 525,00
OI Telemar- Serviço de Telefonia (AGOSTO)	33.90.39.00	9.945-7	R\$ 164,19
TRAMPOLIM ADM. DE BILHETE ELETRÔNICO LTDA (SETEMBRO)	33.90.39.00	9.945-7	R\$ 189,42
PROTÁSIO LOCAÇÃO E TURISMO (AGOSTO)	33.90.39.00	9.945-7	R\$ 1.339,00
AUTO POSTO SÃO TOME LTDA (AGOSTO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 175,50
A HORA CERTA (AGOSTO)	33.90.39.00	9945-7	R\$ 150,00
FOPAG - SERVIDORES IPREV (Vlr Bruto) - (SETEMBRO)	31.90.11.00	9.945-7/71004-4	R\$ 59.349,60
GPS (PATRONAL) - (AGOSTO)	31.90.13.00	9.945-7	R\$ 10.514,19

TOTAL	R\$ 85.560,18
--------------	----------------------

BENEFÍCIOS E ASSISTÊNCIAS AOS SEGURADOS

DESCRIMINAÇÃO	DESPESA	Cta Débito	R\$
Folha de Pagamento - Auxílio Doença (SETEMBRO)	31.90.05.00	9.140-5/18-7	R\$ 186.246,16
Folha de Pagamento - Inativos (SETEMBRO)	31.90.01.00	9.140-5/18-7	R\$ 833.839,69
Folha de Pagamento - Pensões (SETEMBRO)	31.90.03.00	9.140-5/18-7	R\$ 49.539,21
Salario Familia PMSGa (AGOSTO)	31.90.05.00	9.197-9	R\$ 2.572,14
Salario Maternidade PMSGa (AGOSTO)	31.90.05.00	9.197-9	R\$ 5.759,10
TOTAL			R\$ 1.077.956,30

TOTAL ORÇAMENTARIA	R\$ 1.163.516,48
---------------------------	-------------------------

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2019

LEMA
ECONOMIA & FINANÇAS

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

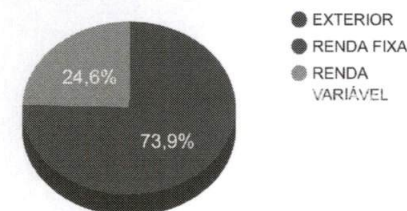
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.153.626,88	8,36%	963	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.871.499,90	4,45%	313	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	18.976.741,02	17,32%	552	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	16.508.528,13	15,07%	1.389	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	94.200,24	0,09%	1.212	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	19.070.063,70	17,41%	643	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.382.528,21	3,09%	419	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.162.064,86	3,80%	74	1,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.710.448,21	3,39%	357	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.054.079,83	0,96%	937	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	7.304.017,87	6,67%	95	1,64%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.075.306,73	4,63%	2.381	4,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.747.379,56	5,25%	4.886	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	219.853,02	0,20%	6.069	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.240.276,13	2,04%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.329.020,65	5,78%	955	1,29%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.637.493,56	1,49%	67	0,28%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			109.537.128,50				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			14.550,58	Artigo 6º			
Total			109.551.679,08				

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

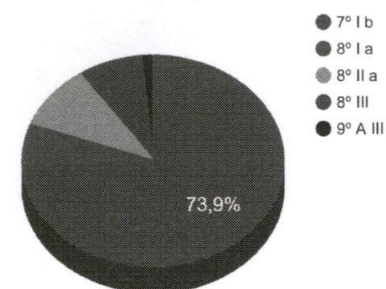
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80.983.780,98	73,93%	40,00%	55,00%	100,00%	28.553.347,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	65.722.277,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	43.814.851,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	16.430.569,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	5.476.856,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	5.476.856,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	7.304.017,87	6,67%	0,00%	3,00%	30,00%	25.557.120,68
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	10.822.686,29	9,88%	0,00%	7,00%	20,00%	11.084.739,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.789.149,80	8,02%	0,00%	5,00%	10,00%	2.164.563,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.476.856,43
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.637.493,56	1,49%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.637.493,56
Total Carteira		109.537.128,50					

EXTERIOR	1.637.493,56	1,49%
RENTA FIXA	80.998.331,56	73,95%
RENTA VARIÁVEL	26.915.853,96	24,57%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 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"	80.983.780,98	73,92%	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"	7.304.017,87	6,67%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "b"	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "a"	10.822.686,29	9,88%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "b"	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	8.789.149,80	8,02%	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	Base: setembro / 2019		Limite	Limite
	Carteira (\$)	Carteira (%)	Inferior (%)	Superior (%)
Artigo 9º - A, Inciso III	1.637.493,56	1,49%	0,00%	0,00%
Total	109.537.128,50	99,99%	40,00	690,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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 - 30/09/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	86.304.122,38	78,78%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.070.941,26	17,41%	0,00%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	4.162.064,86	3,80%	0,04%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,73%	26,55%	4,48%	17,54%	44,85%	43,66%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,69%	26,14%	4,43%	17,29%	44,00%	42,57%	0,20%	2,793%	11,06%
IMA-B	2,86%	19,55%	3,77%	13,27%	31,37%	34,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,85%	19,37%	3,72%	13,12%	31,16%	34,16%	0,20%	1,975%	7,37%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2,79%	17,75%	3,63%	12,35%	27,42%	31,07%	0,20%	1,910%	6,19%
IRF-M 1+	1,87%	11,89%	3,27%	9,07%	20,81%	27,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,85%	11,58%	3,21%	8,89%	20,82%	26,68%	0,20%	1,217%	4,71%
IDKA IPCA 2 Anos	1,60%	9,13%	2,72%	6,49%	12,85%	22,46%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	8,58%	2,46%	5,93%	12,28%	20,88%	0,20%	0,821%	1,92%
IMA Geral ex-C	1,46%	10,53%	2,59%	7,40%	16,57%	22,60%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	11,06%	2,62%	7,89%	17,17%	23,01%	0,30%	0,853%	3,32%
IRF-M	1,44%	9,99%	2,81%	7,53%	16,83%	23,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	9,69%	2,73%	7,34%	16,76%	22,99%	0,20%	0,817%	3,46%
IRF-M 1	0,64%	5,31%	1,92%	3,72%	7,44%	14,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,63%	5,15%	1,86%	3,63%	7,28%	14,32%	0,20%	0,116%	0,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	5,12%	1,85%	3,60%	7,22%	14,20%	0,10%	0,117%	0,47%
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,12%	14,38%	3,11%	10,02%	18,30%	25,15%	0,002	1,371%	3,53%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

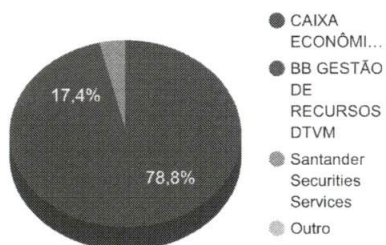
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3,52%	18,71%	3,60%	9,53%	31,29%	39,55%	0,50%	4,992%	14,33%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,85%	6,35%	1,98%	4,70%	12,06%	-	1,60%	0,381%	2,65%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,39%	3,96%	1,32%	2,76%	7,38%	-	1,60%	0,041%	1,44%
SMLL	2,08%	30,58%	9,49%	21,44%	57,29%	45,27%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2,02%	28,59%	9,57%	20,09%	51,57%	39,23%	1,50%	6,763%	15,04%
IDIV	1,89%	27,02%	7,04%	17,36%	52,83%	44,68%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,40%	20,11%	5,72%	11,92%	44,49%	33,57%	1,50%	5,504%	17,50%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,32%	8,73%	2,25%	5,26%	13,18%	19,89%	1,00%	1,514%	4,15%

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

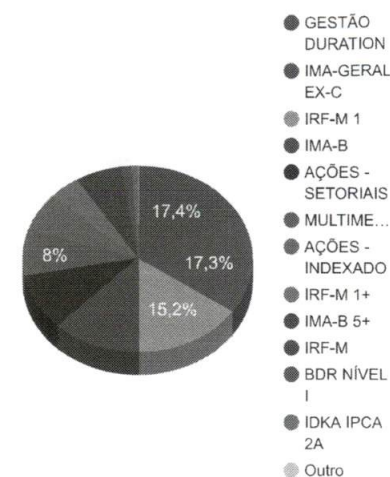
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	2,71%	28,17%	10,43%	13,08%	6,23%	62,44%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2,66%	27,41%	10,26%	12,74%	5,65%	58,09%	0,70%	5,841%	23,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	86.304.122,38	78,78%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.070.941,26	17,41%
Santander Securities Services	4.162.064,86	3,80%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	14.550,58	0,01%



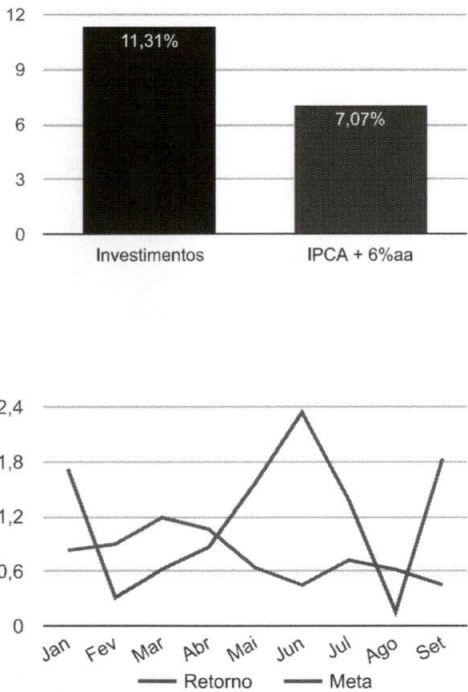
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	19.070.063,70	17,41%
IMA-GERAL EX-C	18.976.741,02	17,32%
IRF-M 1	16.602.728,37	15,16%
IMA-B	13.315.691,74	12,15%
AÇÕES - SETORIAIS	10.822.686,29	9,88%
MULTIMERCADO	8.789.149,80	8,02%
AÇÕES - INDEXADO	7.304.017,87	6,67%
IRF-M 1+	4.871.499,90	4,45%
IMA-B 5+	3.710.448,21	3,39%
IRF-M	3.382.528,21	3,09%
BDR NÍVEL I	1.637.493,56	1,49%
IDKA IPCA 2A	1.054.079,83	0,96%
DISP. FINANCEIRA	14.550,58	0,01%



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%
Maio	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%
Setembro	107.229.424,45	1.660.930,66	1.324.384,14	109.537.128,50	1.971.157,53	1,83%	0,45%	410,36%	1,88%
Acumulado no ano					10.985.912,12	11,31%	7,07%	159,86%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.578.473,68	0,00	0,00	3.710.448,21	131.974,53	3,69%	2,79%	3,69%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.857.021,18	43.093,07	0,00	9.153.626,88	253.512,63	2,85%	1,98%	2,85%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	4.049.164,10	0,00	0,00	4.162.064,86	112.900,76	2,79%	1,91%	2,79%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	18.674.478,46	0,00	0,00	19.070.063,70	395.585,24	2,12%	1,37%	2,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.782.785,47	0,00	0,00	4.871.499,90	88.714,43	1,85%	1,22%	1,85%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.696.494,49	0,00	0,00	18.976.741,02	280.246,53	1,50%	0,85%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.039.275,98	0,00	0,00	1.054.079,83	14.803,85	1,42%	0,82%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.335.056,32	0,00	0,00	3.382.528,21	47.471,89	1,42%	0,82%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.405.704,09	0,00	0,00	16.508.528,13	102.824,04	0,63%	0,12%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	57.700,76	1.356.412,83	1.324.384,14	94.200,24	4.470,79	0,32%	0,12%	0,62%
Total Renda Fixa					1.432.504,69	1,80%	1,11%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	7.055.961,02	0,00	0,00	7.304.017,87	248.056,85	3,52%	4,99%	3,52%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.589.911,41	43.051,07	0,00	5.747.379,56	114.417,08	2,03%	6,76%	2,02%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.005.007,71	0,00	0,00	5.075.306,73	70.299,02	1,40%	5,50%	1,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.275.714,48	0,00	0,00	6.329.020,65	53.306,17	0,85%	0,38%	0,85%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	218.373,69	0,00	219.853,02	1.479,33	0,68%	1,51%	1,32%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.231.626,69	0,00	0,00	2.240.276,13	8.649,44	0,39%	0,04%	0,39%
Total Renda Variável					496.207,89	1,88%	3,94%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	1.595.048,61	0,00	0,00	1.637.493,56	42.444,95	2,66%	5,84%	2,66%
Total Exterior					42.444,95	2,66%	5,84%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.501.591,29	1.000.000,00	0,00	19.070.063,70	568.472,41	3,07%	3,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.245.226,38	250.000,00	0,00	18.976.741,02	481.514,64	2,61%	2,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.206.604,03	0,00	0,00	16.508.528,13	301.924,10	1,86%	1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.812.421,69	2.043.093,07	0,00	9.153.626,88	298.112,12	3,50%	3,72%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	4.016.335,00	0,00	0,00	4.162.064,86	145.729,86	3,63%	3,63%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.729.565,67	1.000.000,00	0,00	4.871.499,90	141.934,23	3,00%	3,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.587.484,08	2.000.000,00	0,00	3.710.448,21	122.964,13	3,77%	4,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.961.135,23	0,00	7.000.000,00	1.054.079,83	92.944,60	2,52%	2,46%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.292.685,99	0,00	0,00	3.382.528,21	89.842,22	2,73%	2,73%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	526.526,65	3.131.272,83	3.578.984,14	94.200,24	15.384,90	1,08%	1,85%
Total Renda Fixa					2.258.823,21	2,85%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.204.708,43	43.051,07	0,00	5.747.379,56	499.620,06	9,58%	9,57%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.800.564,42	0,00	0,00	5.075.306,73	274.742,31	5,72%	5,72%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4.302.461,89	2.775.700,95	0,00	7.304.017,87	225.855,03	3,20%	3,60%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.206.083,46	0,00	0,00	6.329.020,65	122.937,19	1,98%	1,98%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.211.085,03	0,00	0,00	2.240.276,13	29.191,10	1,32%	1,32%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	612.631,14	0,00	632.029,81	0,00	19.398,67	3,17%	3,59%
CAIXA IBOVESPA FIC AÇÕES	583.490,41	0,00	598.642,36	0,00	15.151,95	2,60%	2,64%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	218.373,69	0,00	219.853,02	1.479,33	0,68%	2,25%
Total Renda Variável					1.188.375,64	5,05%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.485.157,26	0,00	0,00	1.637.493,56	152.336,30	10,26%	10,26%
Total Exterior					152.336,30	10,26%	