

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.841.102,68	1,95%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.285.643,38	6,67%	542	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	3.975.042,39	4,22%	95	0,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	804.539,99	0,85%	140	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	212.727,67	0,23%	78	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	538.534,79	0,57%	165	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	597.447,34	0,63%	45	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	2.106.876,78	2,23%	30	1,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.740.108,27	1,85%	93	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	1.092.381,97	1,16%	115	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.051.100,62	9,60%	630	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.931.526,02	13,72%	940	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.733.905,32	2,90%	351	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.437.502,30	3,65%	78	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	1.312.513,10	1,39%	31.062	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	10.503.959,58	11,14%	300	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.517.560,23	2,67%	733	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	2.024.516,58	2,15%	15.875	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	767.342,54	0,81%	28	1,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	738.339,20	0,78%	51	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2019)

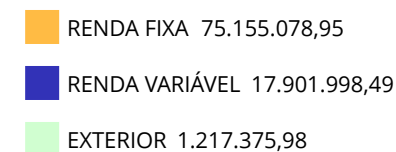
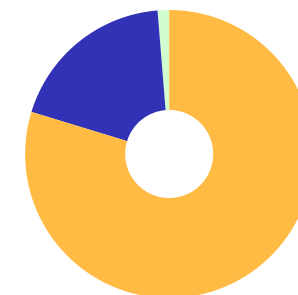
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.099.707,67	1,17%	26	1,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	3.579.156,02	3,80%	31	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	1.964.439,22	2,08%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	70.861,92	0,08%	70	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	3.228.243,37	3,42%	76	1,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	624.339,24	0,66%	92	0,12%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BRASESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.139.614,27	1,21%	431	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.044.576,81	1,11%	2.340	0,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.201.302,87	1,27%	69	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FRANKLIN VALOR E LIQUIDEZ FVL FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.196.015,11	1,27%	4.313	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.515.555,79	1,61%	151	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	2.523.166,12	2,68%	12.747	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	611.191,38	0,65%	10.173	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	564.709,25	0,60%	955	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC M...	D+2	02/01/2020	1.116.032,99	1,18%	729	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.431.885,84	2,58%	36	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.927.817,73	3,11%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.005.791,09	1,07%		6,77%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.217.375,98	1,29%	66	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		13.547,94	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			94.274.453,42				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.547,94				Artigo 6º
PL Total			94.288.001,36				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2019)

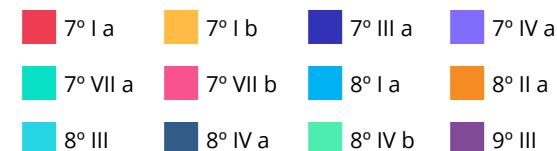
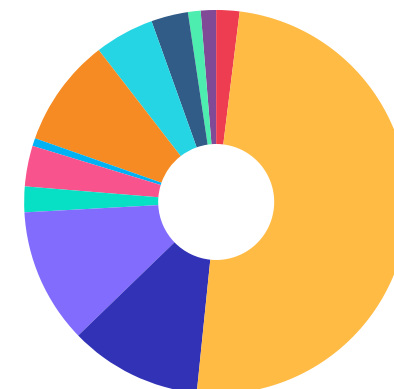
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	1.841.102,68	1,95%	0,00%	3,00%	5,00%	2.872.619,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	46.819.849,94	49,66%	20,00%	41,00%	80,00%	28.599.712,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	10.503.959,58	11,14%	0,00%	5,00%	30,00%	17.778.376,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	10.726.622,24	11,38%	5,00%	20,00%	40,00%	26.983.159,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2.035.301,14	2,16%	0,00%	5,00%	5,00%	2.678.421,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	3.228.243,37	3,42%	0,00%	0,00%	5,00%	1.485.479,30
Total Renda Fixa	100,00%	75.155.078,95	79,72%	25,00%	74,00%	165,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	624.339,24	0,66%	0,00%	0,00%	0,00%	-624.339,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	14.141.168,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	8.620.230,97	9,14%	0,00%	10,00%	15,00%	5.520.937,04
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.723.819,46	5,01%	0,00%	10,00%	10,00%	4.703.625,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.927.817,73	3,11%	0,00%	4,00%	5,00%	1.785.904,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.005.791,09	1,07%	0,00%	2,00%	5,00%	3.707.931,58
Total Renda Variável	30,00%	17.901.998,49	18,99%	0,00%	26,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2019			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.217.375,98	1,29%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.217.375,98
Total Exterior	10,00%	1.217.375,98	1,29%	0,00%	0,00%	0,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	45.736.747,02	48,51	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.038.372,57	18,07	0,00
PLURAL	5.543.595,24	5,88	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	3.972.104,51	4,21	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	3.437.502,30	3,65	0,00
KPTL	2.927.817,73	3,11	-
MOAT CAPITAL	2.523.166,12	2,68	-
BANCO J. SAFRA S/A	2.431.885,84	2,58	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.843.995,55	1,96	1,13
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	1.841.102,68	1,95	-
ITAÚ UNIBANCO	1.515.555,79	1,61	0,00
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	1.312.513,10	1,39	0,00
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENT...	1.196.015,11	1,27	0,03
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.116.032,99	1,18	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	1.099.707,67	1,17	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	738.339,20	0,78	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	2.319.604,45	2,46	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	40,00
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 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 8º, Inciso III	1.680.742,24	1,78	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

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,23%	8,15%	3,25%	6,43%	15,94%	25,15%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,20%	8,03%	3,25%	6,40%	15,74%	24,48%	1,11%	0,03%
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,17%	8,94%	3,09%	6,43%	15,60%	22,43%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	9,42%	3,30%	6,85%	16,13%	22,79%	1,18%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	4,00%	1,48%	2,98%	6,00%	14,06%	0,01%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	9,38%	2,89%	6,79%	17,02%	23,57%	1,12%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	4,00%	1,48%	2,98%	6,00%	14,09%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,10%	7,06%	2,25%	5,13%	11,98%	20,25%	0,74%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,70%	7,27%	2,05%	5,27%	10,58%	23,22%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	2,60%	0,98%	1,71%	4,66%	1,32%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,62%	6,60%	1,81%	4,78%	9,56%	20,95%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,02%	10,97%	3,78%	8,46%	16,05%	22,03%	1,64%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-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%	37,45%	40,76%	3,61%	0,12%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
120% do CDI (Benchmark)	0,60%	5,04%	1,86%	3,74%	7,58%	16,46%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	-0,04%	-	-0,06%	-	-	63,90%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,44%	1,80%	3,21%	1,55%	4,11%	-17,07%	0,94%	0,05%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,37%	2,27%	0,68%	0,72%	2,10%	-6,75%	1,22%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	9,43%	2,91%	6,82%	17,11%	23,69%	1,12%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,16%	9,19%	2,33%	5,80%	15,47%	-	1,18%	0,05%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,04%	15,97%	4,31%	10,63%	26,82%	34,04%	2,22%	0,07%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,50%	16,28%	4,09%	10,27%	30,40%	34,91%	2,70%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	6,70%	2,03%	4,74%	12,02%	19,92%	0,55%	0,02%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,43%	15,95%	4,56%	10,55%	27,06%	32,43%	2,46%	0,08%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,43%	15,90%	4,54%	10,50%	27,09%	32,83%	2,49%	0,08%
CDI (Benchmark)	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,41%	3,43%	1,27%	2,55%	5,15%	11,14%	0,00%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,06%	0,75%	0,26%	0,56%	1,14%	2,82%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,37%	9,13%	2,88%	6,53%	12,18%	16,19%	1,98%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,12%	8,32%	2,62%	6,00%	14,83%	31,60%	0,89%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,13%	12,01%	3,74%	8,33%	16,61%	23,55%	1,74%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,95%	9,26%	2,77%	6,74%	13,64%	30,15%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
Global BDRX (Benchmark)	6,06%	24,78%	11,52%	16,91%	2,97%	60,77%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,02%	24,10%	11,56%	16,53%	2,30%	56,43%	9,29%	0,23%
IBX-50 (Benchmark)	-1,03%	13,42%	3,48%	4,47%	29,07%	40,12%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-0,71%	13,27%	4,08%	4,53%	27,35%	39,13%	11,61%	0,14%
IBX (Benchmark)	-0,16%	16,75%	5,14%	7,34%	34,86%	44,77%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1,42%	22,34%	11,74%	15,18%	49,11%	62,89%	10,87%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-0,08%	23,13%	11,31%	13,04%	54,71%	83,25%	13,02%	-
FRANKLIN VALOR E LIQUIDEZ FVL FIC AÇÕES	1,64%	17,27%	8,82%	8,21%	38,65%	47,34%	11,92%	0,15%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,62%	25,58%	11,49%	13,42%	52,97%	56,48%	12,08%	0,17%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-0,74%	-	-	-	-	-	10,76%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,58%	22,68%	11,81%	15,01%	47,57%	64,39%	11,81%	0,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,36%	5,45%	2,13%	4,21%	11,87%	-	0,49%	0,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,40%	3,56%	1,42%	2,70%	7,96%	-	0,11%	0,01%

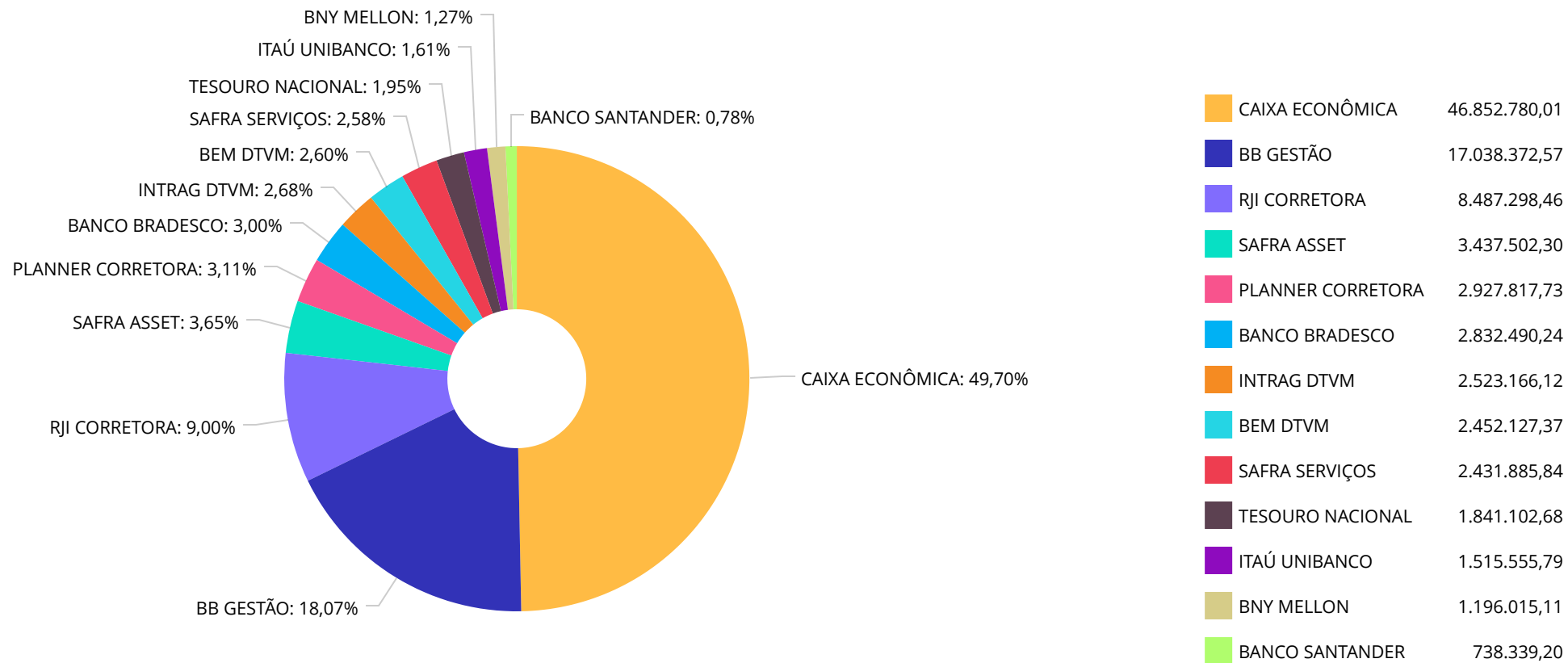
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-1,45%	18,77%	7,06%	6,78%	4,09%	27,70%	11,80%	0,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,61%	12,10%	4,31%	8,13%	18,20%	26,34%	2,03%	0,04%
IFIX (Benchmark)	-0,11%	12,97%	4,07%	9,12%	24,18%	27,48%	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-

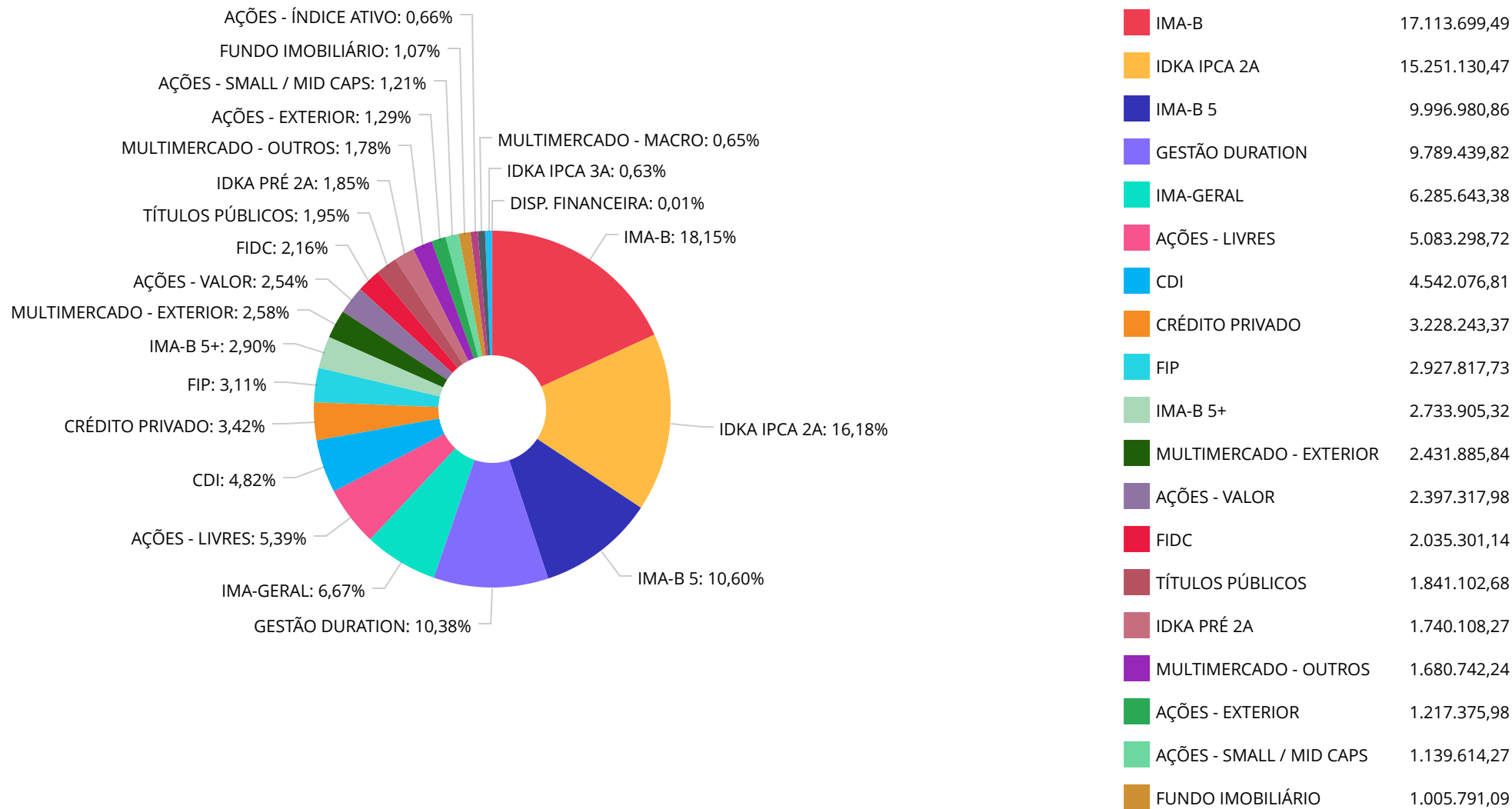
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,06%	24,78%	11,52%	16,91%	2,97%	60,77%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,02%	24,10%	11,56%	16,53%	2,30%	56,43%	9,29%	0,23%

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



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



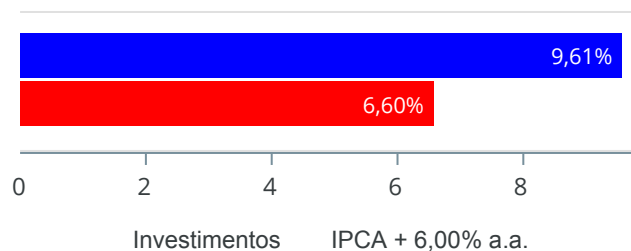
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	19/11/2004	500	1251,54178000	3.682,205365	625.770,89	1.841.102,68	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2019

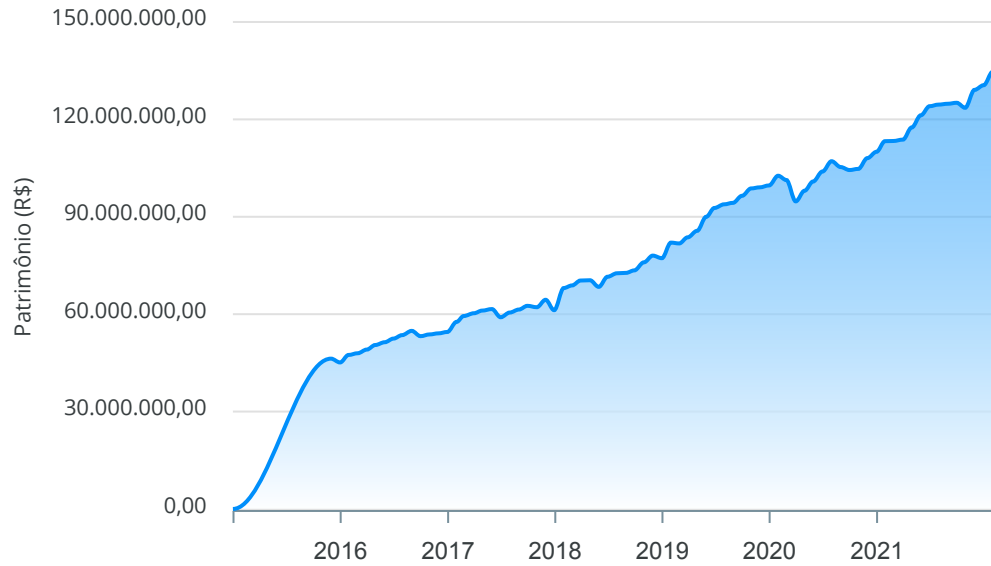
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	77.199.363,05	3.821.014,47	919.959,39	81.993.721,80	1.893.303,67	1.893.303,67	2,36%	2,36%	0,83%	0,83%	284,22%	1,64%
Fevereiro	81.993.721,80	3.358.688,37	4.082.548,21	81.544.355,71	274.493,75	2.167.797,42	0,33%	2,71%	0,90%	1,73%	156,02%	1,80%
Março	81.544.355,71	8.942.270,75	7.181.325,02	83.597.856,75	292.555,31	2.460.352,73	0,35%	3,07%	1,19%	2,95%	104,01%	3,42%
Abril	83.597.856,75	2.398.368,72	1.279.397,12	85.623.264,19	906.435,84	3.366.788,57	1,07%	4,17%	1,06%	4,04%	103,22%	1,57%
Mai	85.623.264,19	5.288.532,55	2.321.640,94	89.953.595,32	1.363.439,52	4.730.228,09	1,54%	5,77%	0,64%	4,71%	122,67%	2,19%
Junho	89.953.595,32	2.863.716,90	2.370.558,98	92.643.814,57	2.197.061,33	6.927.289,42	2,43%	8,34%	0,45%	5,18%	161,12%	2,07%
Julho	92.643.814,57	2.015.970,68	2.090.306,19	93.693.041,08	1.123.562,02	8.050.851,44	1,21%	9,66%	0,72%	5,94%	162,58%	1,71%
Agosto	93.693.041,08	5.397.651,99	4.779.746,59	94.274.453,42	-36.493,06	8.014.358,38	-0,04%	9,61%	0,62%	6,60%	145,73%	2,96%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



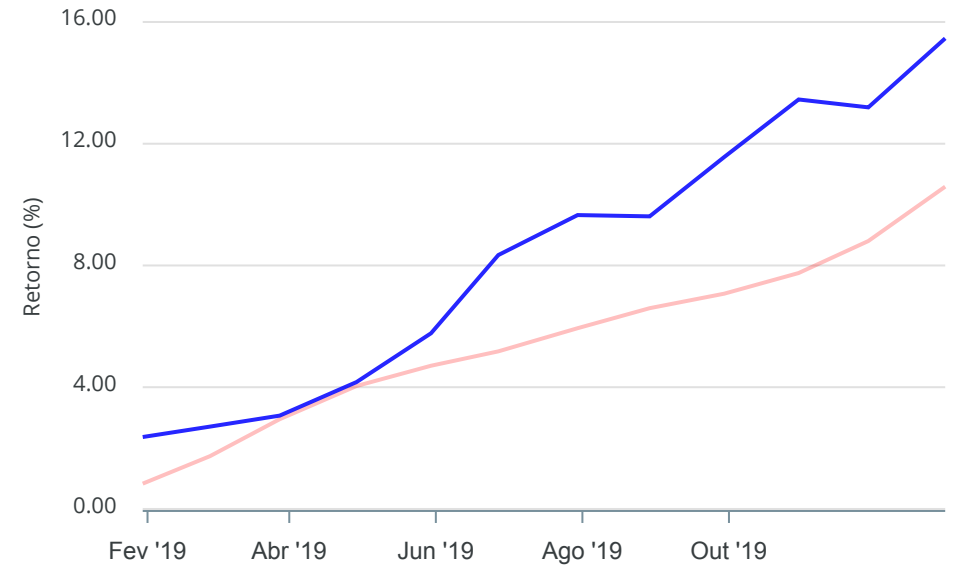
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	211.706,41	0,00	0,00	212.727,67	1.021,26	0,48%	0,48%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.096.773,87	0,00	0,00	2.106.876,78	10.102,91	0,48%	0,48%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.165.153,02	0,00	2.170.918,01	0,00	5.764,99	0,27%	0,52%	0,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.701.773,19	154.102,98	1.348.520,54	2.517.560,23	10.204,60	0,26%	0,41%	0,00%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.736.690,59	0,00	0,00	1.740.108,27	3.417,68	0,20%	0,20%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	552.311,08	0,00	14.728,04	538.534,79	951,75	0,17%	0,17%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	824.571,52	0,00	21.008,81	804.539,99	977,28	0,12%	0,12%	0,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.918.603,52	0,00	0,00	12.931.526,02	12.922,50	0,10%	0,10%	0,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.280.321,56	0,00	0,00	6.285.643,38	5.321,82	0,08%	0,08%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.075.720,38	0,00	103.100,34	3.975.042,39	2.422,35	0,06%	0,06%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	612.381,93	0,00	15.265,79	597.447,34	331,20	0,05%	0,05%	1,12%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	2.023.732,19	0,00	2.024.516,58	784,39	0,04%	0,06%	0,00%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	70.839,06	0,00	0,00	70.861,92	22,86	0,03%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	3.228.746,99	0,00	0,00	3.228.243,37	-503,62	-0,02%	-0,02%	1,64%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.313.028,39	0,00	0,00	1.312.513,10	-515,29	-0,04%	-0,04%	2,22%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	1.965.226,93	0,00	0,00	1.964.439,22	-787,71	-0,04%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.062.837,39	0,00	0,00	9.051.100,62	-11.736,77	-0,13%	-0,13%	1,74%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	768.575,53	0,00	0,00	767.342,54	-1.232,99	-0,16%	-0,18%	1,18%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.103.777,25	0,00	0,00	1.099.707,67	-4.069,58	-0,37%	-0,37%	1,22%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	741.111,47	0,00	0,00	738.339,20	-2.772,27	-0,37%	-0,37%	1,98%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	1.097.089,89	0,00	0,00	1.092.381,97	-4.707,92	-0,43%	-0,43%	2,46%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.595.044,34	0,00	0,00	3.579.156,02	-15.888,32	-0,44%	-0,44%	0,94%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	9.397.099,65	1.157.816,82	0,00	10.503.959,58	-50.956,89	-0,48%	-0,43%	2,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.755.606,85	0,00	0,00	2.733.905,32	-21.701,53	-0,79%	-0,79%	3,61%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.408.410,93	2.062.000,00	0,00	3.437.502,30	-32.908,63	-0,95%	-0,50%	2,70%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.887.736,56	0,00	0,00	1.841.102,68	-46.633,88	-2,47%	-	-
Total Renda Fixa	73.571.138,30	5.397.651,99	3.673.541,53	75.155.078,95	-140.169,81	-0,19%		1,46%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
FRANKLIN VALOR E LIQUIDEZ FVL FIC AÇÕES	1.176.692,90	0,00	0,00	1.196.015,11	19.322,21	1,64%	1,64%	11,92%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.182.144,12	0,00	0,00	1.201.302,87	19.158,75	1,62%	1,62%	12,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.492.014,15	0,00	0,00	1.515.555,79	23.541,64	1,58%	1,58%	11,81%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.123.644,56	0,00	0,00	1.139.614,27	15.969,71	1,42%	1,42%	10,87%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	607.511,41	0,00	0,00	611.191,38	3.679,97	0,61%	0,61%	2,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	1.111.606,50	0,00	0,00	1.116.032,99	4.426,49	0,40%	0,40%	0,11%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	562.694,18	0,00	0,00	564.709,25	2.015,07	0,36%	0,36%	0,49%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.104.007,85	0,00	1.106.205,06	0,00	2.197,21	0,20%	0,46%	0,13%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	2.525.065,04	0,00	0,00	2.523.166,12	-1.898,92	-0,08%	-0,08%	13,02%
HAZ FII - ATCR11	1.006.557,93	0,00	0,00	1.005.791,09	-766,84	-0,08%	0,00%	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.932.884,13	0,00	0,00	2.927.817,73	-5.066,40	-0,17%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	628.783,47	0,00	0,00	624.339,24	-4.444,23	-0,71%	-0,71%	11,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.052.351,50	0,00	0,00	1.044.576,81	-7.774,69	-0,74%	-0,74%	10,76%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2.467.727,28	0,00	0,00	2.431.885,84	-35.841,44	-1,45%	-1,45%	11,80%
Total Renda Variável	18.973.685,02	0,00	1.106.205,06	17.901.998,49	34.518,53	0,18%		10,07%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.148.217,76	0,00	0,00	1.217.375,98	69.158,22	6,02%	6,02%	9,29%
Total Exterior	1.148.217,76	0,00	0,00	1.217.375,98	69.158,22	6,02%		9,29%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma **OPINIÃO** que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.