

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



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (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 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.975.985,53	3,92%	913	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.474.590,00	1,16%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	13.240.406,94	10,42%	643	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.527.229,28	2,78%	608	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.498.946,47	3,54%	95	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.204.212,68	4,88%	937	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.284.915,99	3,37%	876	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.340.693,05	3,42%	963	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.674.508,03	2,10%	1.212	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.166.754,50	1,71%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.091.994,07	2,43%	1.389	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.358.012,95	4,22%	61	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.068.651,51	1,63%	681	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	100.397,36	0,08%	66	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.486.871,66	6,68%		0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.200.161,07	2,52%	695	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.043.055,55	1,61%	95	1,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.137.278,11	0,89%	116	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.110.389,47	3,23%	110	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.603.033,69	1,26%	758	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	9.706.491,87	7,64%	33	10,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	848.918,50	0,67%	76	0,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

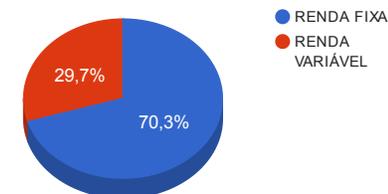
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	5.589.441,85	4,40%	152	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	3.952.390,23	3,11%	55.951	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	1.507.924,27	1,19%	188	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.059.291,57	0,83%	6.208	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.932.374,58	3,88%	207	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.293.873,66	2,59%	5.821	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.287.171,51	2,59%	123	1,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.131.783,46	3,25%	6.069	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.464.586,52	2,73%	77	2,34%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.320.034,09	3,40%	12.245	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRH11	Não se aplica	Não se aplica	2.220.040,00	1,75%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	176.347,45	0,14%	749	0,63%	Desenquadrado - RF
Total			127.078.757,47				

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

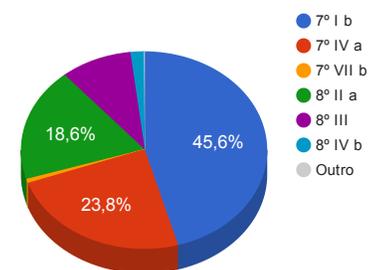
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	58.007.298,36	45,65%	15,00%	25,00%	70,00%	30.947.831,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	76.247.254,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	30.287.281,42	23,83%	10,00%	30,00%	40,00%	20.544.221,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.353.937,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	848.918,50	0,67%	0,00%	0,00%	5,00%	5.505.019,37
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	23.622.467,67	18,59%	7,00%	10,00%	20,00%	1.793.283,82
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.916.404,07	9,38%	7,00%	10,00%	10,00%	791.471,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.353.937,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.220.040,00	1,75%	2,00%	5,00%	5,00%	4.133.897,87
Desenquadrado - RF	0,00%	176.347,45	0,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-176.347,45
Total Carteira		127.078.757,47					

RENDA FIXA	89.319.845,73	70,29%
RENDA VARIÁVEL	37.758.911,74	29,71%

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 " b "	58.007.298,36	45,65%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30.287.281,42	23,83%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	848.918,50	0,67%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	23.622.467,67	18,59%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.916.404,07	9,38%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.220.040,00	1,75%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	176.347,45	0,14%	0,00%	0,00%
Total	127.078.757,47	100,00%	50,00	240,00

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)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.618.446,51	38,26%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	24.624.392,16	19,38%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.263.390,15	13,58%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	15.214.133,94	11,97%	2,08%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.541.710,52	10,66%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.293.873,66	2,59%	0,01%
META ASSET MANAGEMENT	3.287.171,51	2,59%	1,49%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	1.059.291,57	0,83%	0,15%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	176.347,45	0,14%	0,40%

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%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,52%	7,26%	2,23%	4,53%	13,03%	18,68%	0,50%	0,880%	3,59%

IMA-B	2,86%	19,55%	3,77%	13,27%	31,37%	34,72%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,90%	19,45%	3,70%	13,17%	31,74%	34,29%	0,20%	2,006%	7,61%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,85%	19,32%	3,72%	13,15%	31,00%	34,05%	0,20%	1,966%	7,30%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,19%	8,62%	0,74%	7,49%	17,50%	14,69%	0,20%	1,465%	7,90%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	0,50%	-0,99%	1,09%	3,26%	5,53%	0,20%	0,437%	4,35%

IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,72%	10,05%	2,73%	7,05%	15,04%	22,06%	0,18%	1,011%	2,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,72%	10,10%	2,74%	7,07%	15,16%	22,44%	0,20%	1,010%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,72%	10,08%	2,72%	7,04%	15,21%	22,44%	0,20%	1,012%	2,86%

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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	8,36%	2,46%	5,73%	12,10%	20,62%	0,20%	0,887%	1,93%

IDKA PRÉ 2 ANOS	1,57%	9,85%	3,00%	7,50%	16,36%	25,24%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,53%	9,69%	2,87%	7,44%	16,19%	24,51%	0,20%	0,843%	3,00%

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

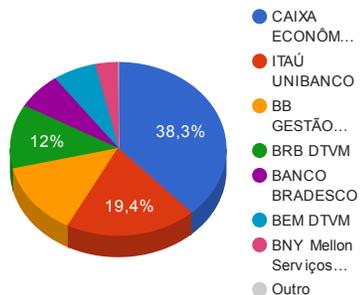
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,64%	5,31%	1,92%	3,72%	7,44%	14,70%	-	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,65%	5,13%	1,88%	3,60%	7,20%	14,19%	0,18%	0,118%	0,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,63%	5,15%	1,86%	3,63%	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%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	0,76%	5,08%	1,61%	3,40%	7,04%	14,75%	0,75%	0,288%	0,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,45%	4,55%	1,50%	3,02%	6,11%	13,21%	0,20%	0,008%	0,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIA DO DI	0,45%	4,56%	1,50%	3,03%	6,14%	13,06%	0,18%	0,021%	0,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI LP	0,45%	4,55%	1,49%	3,02%	6,13%	13,00%	0,20%	0,007%	0,12%
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,27%	13,49%	3,26%	9,91%	17,32%	24,16%	0,20%	1,411%	3,22%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	10,59%	2,06%	7,25%	13,67%	20,84%	0,40%	0,303%	2,74%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,20%	51,80%	75,10%	47,51%	83,01%	131,09%	2,00%	0,059%	79,03%

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%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3,42%	28,77%	8,98%	20,27%	46,74%	60,66%	1,90%	4,841%	14,23%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2,15%	24,76%	2,35%	10,50%	55,71%	-	2,00%	4,601%	23,33%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,94%	17,66%	6,99%	13,09%	34,07%	49,86%	2,00%	5,861%	13,81%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	1,39%	27,31%	7,66%	17,52%	56,80%	57,82%	2,00%	4,534%	18,30%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	0,35%	16,71%	4,89%	11,13%	32,02%	51,15%	1,50%	5,462%	11,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,48%	22,10%	6,10%	15,52%	48,78%	55,68%	2,50%	6,000%	15,22%
IBX	3,21%	20,50%	4,25%	10,92%	34,84%	42,73%	-	-	-
META VALOR FIC AÇÕES	2,92%	13,95%	3,76%	7,69%	34,17%	41,33%	2,50%	5,873%	18,16%
IFIX	1,04%	14,15%	2,21%	8,11%	25,74%	20,86%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,19%	9,97%	7,56%	8,61%	16,23%	0,91%	1,20%	8,675%	6,96%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,51%	13,80%	3,48%	9,25%	19,02%	26,56%	0,50%	0,976%	3,65%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,32%	8,73%	2,25%	5,26%	13,18%	19,89%	1,00%	1,514%	4,15%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,68%	5,07%	1,49%	3,41%	6,70%	14,31%	1,00%	0,251%	0,53%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.618.446,51	38,26%
ITAÚ UNIBANCO	24.624.392,16	19,38%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.263.390,15	13,58%
BRB DTVM	15.214.133,94	11,97%
BANCO BRADESCO	8.609.335,94	6,77%
BEM DTVM	8.226.248,24	6,47%
BNY Mellon Serviços Financeiros	4.346.463,08	3,42%
Orla DTVM	176.347,45	0,14%



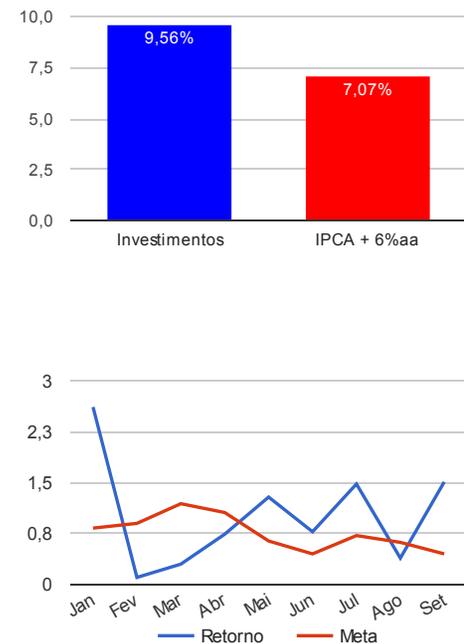
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	31.433.770,47	24,74%
AÇÕES - LIVRES	23.622.467,67	18,59%
IMA-B 5	16.027.982,26	12,61%
IDKA IPCA 2A	14.988.075,14	11,79%
IMA-B	11.994.324,03	9,44%
MULTIMERCADO	11.916.404,07	9,38%
CDI	7.983.528,42	6,28%
IRF-M 1	5.866.899,46	4,62%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.220.040,00	1,75%
CRÉDITO PRIVADO	1.025.265,95	0,81%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	106.357.825,78	7.728.849,03	6.774.629,06	110.118.337,44	2.806.291,69	2,62%	0,83%	314,45%	1,99%
Fevereiro	110.118.337,44	2.527.768,76	1.547.700,70	111.213.080,08	114.674,58	0,10%	0,90%	11,53%	2,36%
Março	111.213.080,08	1.560.630,70	718.884,05	112.390.132,85	335.306,12	0,30%	1,19%	25,07%	3,34%
Abril	112.390.132,85	8.140.343,39	7.038.736,83	114.332.284,75	840.545,34	0,74%	1,06%	69,90%	1,85%
Mai	114.332.284,75	10.581.791,67	9.298.965,83	117.103.777,28	1.488.666,69	1,29%	0,64%	200,98%	4,22%
Junho	117.103.777,28	11.812.666,31	10.953.598,85	118.878.755,91	915.911,17	0,78%	0,45%	172,41%	2,26%
Julho	118.878.755,91	11.653.107,46	12.645.300,64	119.646.225,30	1.759.662,57	1,48%	0,72%	204,38%	1,92%
Agosto	119.646.225,30	2.075.144,56	1.177.165,58	121.011.842,65	467.638,37	0,39%	0,62%	62,51%	3,62%
Setembro	121.011.842,65	1.667.746,69	597.082,07	123.927.235,85	1.844.728,58	1,51%	0,45%	338,38%	1,91%
Acumulado no ano					10.573.425,11	9,56%	7,07%	135,17%	

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(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.994.603,07	0,00	0,00	4.110.389,47	115.786,40	2,90%	2,01%	2,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.996.950,50	14.750,51	0,00	2.068.651,51	56.950,50	2,83%	1,97%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.998.503,58	228.091,97	0,00	4.340.693,05	114.097,50	2,70%	1,98%	2,85%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	830.110,50	0,00	0,00	848.918,50	18.808,00	2,27%	1,41%	2,27%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.442.949,00	0,00	0,00	1.474.590,00	31.641,00	2,19%	1,47%	2,19%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	12.718.379,15	247.532,24	0,00	13.240.406,94	274.495,55	2,12%	1,37%	2,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.467.575,01	0,00	0,00	3.527.229,28	59.654,27	1,72%	1,01%	1,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	4.860.357,36	413.970,14	0,00	5.358.012,95	83.685,45	1,59%	1,01%	1,72%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.172.411,21	728.401,83	0,00	4.975.985,53	75.172,49	1,53%	1,01%	1,72%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	4.431.167,49	0,00	0,00	4.498.946,47	67.778,98	1,53%	0,84%	1,53%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.561.203,22	0,00	0,00	9.706.491,87	145.288,65	1,52%	0,88%	1,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.117.078,64	0,00	0,00	6.204.212,68	87.134,04	1,42%	0,82%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.225.242,72	0,00	0,00	4.284.915,99	59.673,27	1,41%	0,89%	1,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.932.255,88	35.000,00	550.000,00	8.486.871,66	69.615,78	0,78%	0,30%	0,78%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	2.027.725,15	0,00	0,00	2.043.055,55	15.330,40	0,76%	0,29%	0,76%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.151.786,00	0,00	0,00	2.166.754,50	14.968,50	0,70%	0,44%	0,70%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	99.747,82	0,00	0,00	100.397,36	649,54	0,65%	0,12%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.072.735,46	0,00	0,00	3.091.994,07	19.258,61	0,63%	0,12%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.658.045,45	0,00	0,00	2.674.508,03	16.462,58	0,62%	0,12%	0,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.185.805,78	0,00	0,00	3.200.161,07	14.355,29	0,45%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.628.862,87	0,00	33.082,07	1.603.033,69	7.252,89	0,45%	0,01%	0,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1.218.954,54	35.000,00	122.034,59	1.137.278,11	5.358,16	0,43%	0,02%	0,45%

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(%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	175.994,69	0,00	0,00	176.347,45	352,76	0,20%	0,06%	0,20%
Total Renda Fixa					1.353.770,61	1,54%	0,92%	

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(%)
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.821.577,81	0,00	0,00	3.952.390,23	130.812,42	3,42%	4,84%	3,42%
META VALOR FIC AÇÕES	3.193.777,26	0,00	0,00	3.287.171,51	93.394,25	2,92%	5,87%	2,92%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.476.146,37	0,00	0,00	1.507.924,27	31.777,90	2,15%	4,60%	2,15%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.231.035,58	0,00	0,00	3.293.873,66	62.838,08	1,94%	5,86%	1,94%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.194.000,00	0,00	14.000,00	2.220.040,00	40.040,00	1,82%	8,68%	1,19%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.255.694,45	0,00	0,00	4.320.034,09	64.339,64	1,51%	0,98%	1,51%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	1.044.742,74	0,00	0,00	1.059.291,57	14.548,83	1,39%	4,53%	1,39%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.077.872,23	0,00	0,00	4.131.783,46	53.911,23	1,32%	1,51%	1,32%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.441.180,01	0,00	0,00	3.464.586,52	23.406,51	0,68%	0,25%	0,68%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	4.915.379,79	0,00	0,00	4.932.374,58	16.994,79	0,35%	5,46%	0,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.616.140,63	0,00	0,00	5.589.441,85	-26.698,78	-0,48%	6,00%	-0,48%
Total Renda Variável					505.364,87	1,36%	4,25%	

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	11.090.476,15	1.768.505,20	0,00	13.240.406,94	381.425,59	3,04%	3,11%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.494.939,29	0,00	0,00	9.706.491,87	211.552,58	2,23%	2,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.622.596,52	1.456.366,12	1.770.000,00	8.486.871,66	177.909,02	1,97%	2,06%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	8.337.308,43	0,00	4.000.000,00	4.498.946,47	161.638,04	2,77%	2,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.577.746,24	483.115,78	0,00	6.204.212,68	143.350,66	2,44%	2,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.983.416,00	856.077,27	2.000.000,00	4.975.985,53	136.492,26	2,56%	2,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	4.812.700,25	413.970,14	0,00	5.358.012,95	131.342,56	2,59%	2,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.391.946,36	18.216,49	2.000.000,00	3.527.229,28	117.066,43	2,81%	2,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	4.228.091,97	0,00	4.340.693,05	112.601,08	2,66%	3,72%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	4.001.740,00	0,00	4.110.389,47	108.649,47	2,72%	3,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.166.966,79	15.165,23	0,00	4.284.915,99	102.783,97	2,46%	2,46%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	100.709,83	0,00	0,00	176.347,45	75.637,62	75,10%	75,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.025.501,20	0,00	2.000.000,00	3.091.994,07	66.492,87	1,78%	1,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.490.037,07	0,00	1.871.300,62	2.674.508,03	55.771,58	1,72%	1,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.014.750,51	0,00	2.068.651,51	53.901,00	2,67%	3,72%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.463.740,00	0,00	35.369,85	1.474.590,00	46.219,85	3,21%	0,74%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	889.821,56	2.271.410,94	0,00	3.200.161,07	38.928,57	1,28%	1,50%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.188.434,00	0,00	57.692,47	2.166.754,50	36.012,97	1,66%	-0,99%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	2.010.691,46	0,00	0,00	2.043.055,55	32.364,09	1,61%	1,61%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	822.120,00	0,00	0,00	848.918,50	26.798,50	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.641.891,16	0,00	63.082,07	1.603.033,69	24.224,60	1,49%	1,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1.807.080,05	105.000,00	797.642,43	1.137.278,11	22.840,49	1,41%	1,50%

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 (%)
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	36.778,40	70.000,00	8.000,00	100.397,36	1.618,96	1,60%	1,88%
				Total Renda Fixa	2.265.622,76	2,63%	

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 (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.724.191,53	0,00	500.000,00	5.589.441,85	365.250,32	6,34%	6,10%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.626.642,11	0,00	0,00	3.952.390,23	325.748,12	8,98%	8,98%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	4.702.376,89	0,00	0,00	4.932.374,58	229.997,69	4,89%	4,89%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.078.609,37	0,00	0,00	3.293.873,66	215.264,29	6,99%	6,99%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.064.020,00	0,00	42.000,00	2.220.040,00	198.020,00	9,64%	7,56%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.174.783,37	0,00	0,00	4.320.034,09	145.250,72	3,48%	3,48%
META VALOR FI AÇÕES	3.167.983,68	0,00	0,00	3.287.171,51	119.187,83	3,76%	3,76%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.040.750,03	0,00	0,00	4.131.783,46	91.033,43	2,25%	2,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	983.952,20	0,00	0,00	1.059.291,57	75.339,37	7,66%	7,66%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.413.740,26	0,00	0,00	3.464.586,52	50.846,26	1,49%	1,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.473.273,79	0,00	0,00	1.507.924,27	34.650,48	2,35%	2,35%
Total Renda Variável					1.850.588,51	5,10%	