

# 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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.436.907,54	3,15%	681	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	8.331.357,72	5,91%	608	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.771.308,02	7,64%	913	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	12.518.955,84	8,87%	643	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.798.259,49	7,65%	876	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.535.718,36	2,51%	95	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	7.116.585,06	5,04%	552	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.488.024,23	3,89%	1.389	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.391.144,75	3,11%	937	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.169.501,04	2,96%	963	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.380.783,75	2,40%	124	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.676.965,92	1,19%	226	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	4.231.812,83	3,00%	302	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.201.646,96	0,85%	758	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	550.278,70	0,39%	95	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	381.722,87	0,27%	180	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.173.764,65	2,25%	33	3,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.439.553,25	3,86%	140	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.717.037,17	4,76%	59	1,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.650.981,27	1,17%	333	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.743.884,98	1,95%	76	1,58%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15 du	Não há	1.021.094,69	0,72%	30	1,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

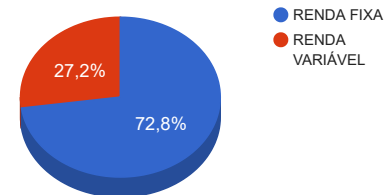
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.785.847,24	1,97%	7.737	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.999.101,72	1,42%	188	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.835.300,13	2,01%	6.208	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	6.929.292,64	4,91%	123	3,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.786.086,59	4,81%	1.824	2,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	Não informado	Não há	2.160.821,89	1,53%	22.060	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.056.941,78	0,75%	1.429	1,21%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	1.677.763,34	1,19%	729	0,60%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.713.924,09	4,76%	77	4,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	508.501,54	0,36%	12.245	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	2.102.997,07	1,49%	3.940	0,84%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	1.785.058,65	1,27%		0,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total</b>			<b>141.068.925,77</b>				

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

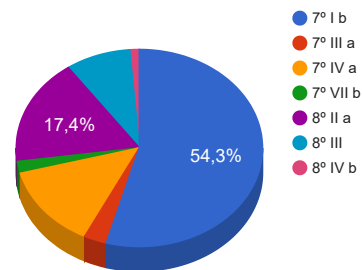
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	76.615.511,72	54,31%	20,00%	40,00%	100,00%	64.453.414,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	4.231.812,83	3,00%	0,00%	10,00%	60,00%	80.409.542,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	19.114.984,87	13,55%	5,00%	25,00%	40,00%	37.312.585,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.743.884,98	1,95%	0,00%	0,00%	5,00%	4.309.561,31
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	24.517.544,90	17,38%	0,00%	15,00%	20,00%	3.696.240,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.060.127,82	8,55%	0,00%	8,00%	10,00%	2.046.764,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.785.058,65	1,27%	0,00%	2,00%	5,00%	5.268.387,64
<b>Total Carteira</b>		<b>141.068.925,77</b>					

RENDA FIXA	102.706.194,40	72,81%
RENDA VARIÁVEL	38.362.731,37	27,19%

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%	5,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	76.615.511,72	54,31%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	4.231.812,83	3,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	19.114.984,87	13,55%	5,00%	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%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	2.743.884,98	1,95%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	24.517.544,90	17,38%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	12.060.127,82	8,55%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.785.058,65	1,27%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>141.068.925,77</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00</b>	<b>335,00</b>

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	53.108.527,19	37,65%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.062.995,28	25,56%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	10.437.967,44	7,40%	1,42%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.356.994,48	6,63%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	8.877.859,06	6,29%	0,00%
META ASSET MANAGEMENT	6.929.292,64	4,91%	3,13%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	6.786.086,59	4,81%	0,01%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.888.844,31	3,47%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.835.300,13	2,01%	0,40%
ZION Invest	1.785.058,65	1,27%	0,36%

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%	-	-	-
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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,85%	19,20%	3,70%	13,01%	30,87%	34,20%	0,20%	1,977%	7,24%
IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
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%
IMA Geral	1,46%	10,72%	2,61%	7,52%	16,78%	23,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	10,29%	2,52%	7,25%	16,39%	22,07%	0,20%	0,808%	3,19%
IMA Geral ex-C	1,46%	10,53%	2,59%	7,40%	16,57%	22,60%	-	-	-

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
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%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,44%	10,32%	2,53%	7,26%	16,33%	22,05%	0,20%	0,803%	3,14%
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%
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%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	4,55%	1,49%	3,02%	6,13%	13,00%	0,20%	0,007%	0,12%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,44%	4,45%	1,47%	2,97%	5,99%	12,76%	0,20%	0,007%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,39%	4,01%	1,32%	2,67%	5,39%	11,49%	0,80%	0,007%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	7,07%	1,80%	4,01%	9,04%	20,73%	-	-	-
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%
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,79%	11,08%	2,41%	7,64%	13,69%	17,54%	0,40%	1,215%	2,63%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,48%	10,44%	2,53%	7,33%	16,59%	-	0,40%	0,855%	3,23%



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

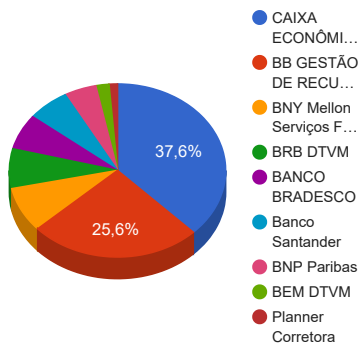
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5,40%	28,91%	4,21%	13,85%	50,25%	31,95%	2,00%	3,938%	16,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,15%	24,76%	2,35%	10,50%	55,71%	-	2,00%	4,601%	23,33%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	2,05%	19,11%	4,58%	11,82%	35,79%	-	2,00%	4,830%	12,92%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,39%	27,31%	7,66%	17,52%	56,80%	57,82%	2,00%	4,534%	18,30%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,39%	3,96%	1,32%	2,76%	7,38%	-	1,60%	0,041%	1,44%
IBX	3,21%	20,50%	4,25%	10,92%	34,84%	42,73%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	2,92%	13,95%	3,76%	7,69%	34,17%	41,33%	2,50%	5,873%	18,16%
SMLL	2,08%	30,58%	9,49%	21,44%	57,29%	45,27%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,76%	25,14%	12,43%	23,11%	58,04%	59,79%	2,00%	8,055%	16,92%
S&P 500	1,72%	18,74%	1,19%	5,02%	2,15%	18,15%	-	-	-
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,17%	21,17%	2,13%	6,92%	-	-	1,20%	4,130%	-
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%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,68%	5,07%	1,49%	3,41%	6,70%	14,31%	1,00%	0,251%	0,53%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,07%	3,81%	1,85%	3,30%	6,79%	-	1,50%	1,125%	1,84%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

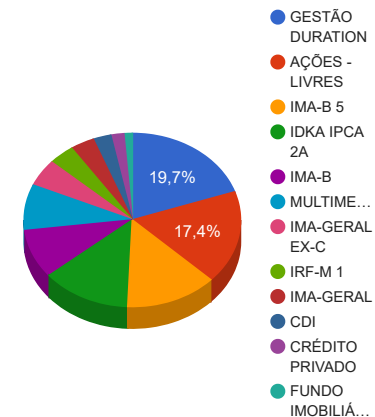
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-0,43%	-	-	-	-	-	2,00%	7,014%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,92%	-11,05%	-14,53%	3,38%	-19,05%	-15,00%	1,60%	31,403%	28,94%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.108.527,19	37,65%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.062.995,28	25,56%
BNY Mellon Serviços Financeiros	11.867.589,84	8,41%
BRB DTVM	10.437.967,44	7,40%
BANCO BRADESCO	9.356.994,48	6,63%
Banco Santander	8.877.859,06	6,29%
BNP Paribas	6.786.086,59	4,81%
BEM DTVM	2.785.847,24	1,97%
Planner Corretora	1.785.058,65	1,27%



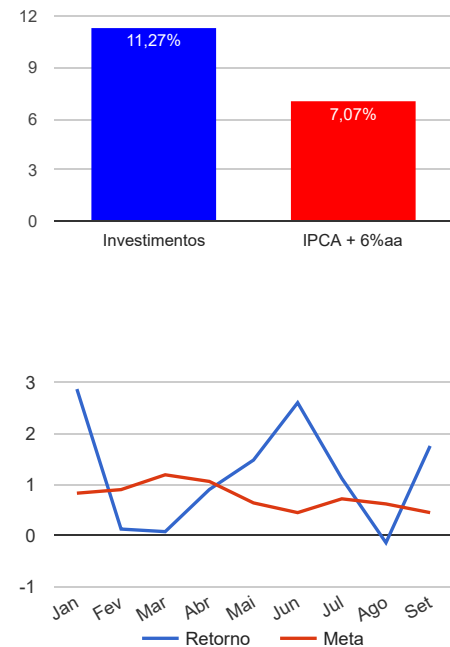
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	27.849.310,91	19,74%
AÇÕES - LIVRES	24.517.544,90	17,38%
IMA-B 5	19.102.665,74	13,54%
IDKA IPCA 2A	18.725.122,60	13,27%
IMA-B	12.838.221,41	9,10%
MULTIMERCADO	12.060.127,82	8,55%
IMA-GERAL EX-C	7.116.585,06	5,04%
IRF-M 1	5.488.024,23	3,89%
IMA-GERAL	5.057.749,67	3,59%
CDI	3.784.629,80	2,68%
CRÉDITO PRIVADO	2.743.884,98	1,95%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.785.058,65	1,27%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	107.384.837,09	31.180.953,25	26.544.255,19	115.232.636,11	3.211.100,96	2,87%	0,83%	344,69%	2,08%
Fevereiro	115.232.636,11	2.089.144,18	559.429,07	116.912.138,93	149.787,71	0,13%	0,90%	14,33%	2,03%
Março	116.912.138,93	2.448.920,14	558.629,09	118.895.200,01	92.770,03	0,08%	1,19%	6,54%	3,35%
Abril	118.895.200,01	5.112.697,92	3.098.745,05	121.999.739,09	1.090.586,21	0,90%	1,06%	85,13%	1,89%
Mai	121.999.739,09	9.144.836,41	7.110.148,95	125.868.007,95	1.833.581,40	1,48%	0,64%	230,75%	5,08%
Junho	125.868.007,95	5.033.637,16	3.001.459,69	131.226.125,05	3.325.939,63	2,60%	0,45%	577,43%	2,80%
Julho	131.226.125,05	6.637.023,81	4.631.917,31	134.722.697,72	1.491.466,17	1,12%	0,72%	154,57%	1,93%
Agosto	134.722.697,72	4.133.900,02	2.078.714,18	136.589.104,19	-188.779,37	-0,14%	0,62%	-22,24%	3,35%
Setembro	136.589.104,19	6.119.484,55	4.071.074,49	141.068.925,77	2.431.411,52	1,75%	0,45%	392,73%	2,15%
Acumulado no ano					13.437.864,26	11,27%	7,07%	159,34%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.053.920,36	0,00	0,00	4.169.501,04	115.580,68	2,85%	1,98%	2,85%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.314.060,14	0,00	0,00	4.436.907,54	122.847,40	2,85%	1,97%	2,85%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.114.678,60	0,00	0,00	4.231.812,83	117.134,23	2,85%	1,98%	2,85%	
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.683.093,52	0,00	0,00	2.743.884,98	60.791,46	2,27%	1,41%	2,27%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.787.357,38	1.500.000,00	0,00	12.518.955,84	231.598,46	1,88%	1,37%	2,12%	
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	6.599.146,25	0,00	0,00	6.717.037,17	117.890,92	1,79%	1,21%	1,79%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.190.453,61	0,00	0,00	8.331.357,72	140.904,11	1,72%	1,01%	1,72%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.589.161,36	0,00	0,00	10.771.308,02	182.146,66	1,72%	1,01%	1,72%	
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.482.450,91	0,00	0,00	3.535.718,36	53.267,45	1,53%	0,84%	1,53%	
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	3.126.259,12	0,00	0,00	3.173.764,65	47.505,53	1,52%	0,88%	1,52%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.011.488,08	0,00	0,00	7.116.585,06	105.096,98	1,50%	0,85%	1,50%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.360.165,20	0,00	0,00	5.439.553,25	79.388,05	1,48%	0,86%	1,48%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.653.121,97	0,00	0,00	1.676.965,92	23.843,95	1,44%	0,81%	1,44%	
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.332.820,07	0,00	0,00	3.380.783,75	47.963,68	1,44%	0,80%	1,44%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.618.059,08	0,00	2.000.000,00	10.798.259,49	180.200,41	1,43%	0,89%	1,41%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.329.474,03	0,00	0,00	4.391.144,75	61.670,72	1,42%	0,82%	1,42%	
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	546.149,59	0,00	0,00	550.278,70	4.129,11	0,76%	0,29%	0,76%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.453.841,84	0,00	0,00	5.488.024,23	34.182,39	0,63%	0,12%	0,63%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.196.310,28	0,00	0,00	1.201.646,96	5.336,68	0,45%	0,01%	0,45%	
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	380.039,72	0,00	0,00	381.722,87	1.683,15	0,44%	0,01%	0,44%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.094.935,41	2.619.484,55	2.071.074,49	1.650.981,27	7.635,80	0,21%	0,01%	0,39%	
<b>Total Renda Fixa</b>						<b>1.740.797,82</b>	<b>1,72%</b>	<b>1,06%</b>	

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(%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.438.566,25	0,00	0,00	6.786.086,59	347.520,34	5,40%	3,94%	5,40%
META VALOR FI AÇÕES	6.732.419,41	0,00	0,00	6.929.292,64	196.873,23	2,92%	5,87%	2,92%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.034.524,44	0,00	0,00	1.056.941,78	22.417,34	2,17%	4,13%	2,17%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	2.117.362,61	0,00	0,00	2.160.821,89	43.459,28	2,05%	4,83%	2,05%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	500.928,27	0,00	0,00	508.501,54	7.573,27	1,51%	0,98%	1,51%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.796.358,72	0,00	0,00	2.835.300,13	38.941,41	1,39%	4,53%	1,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.764.936,67	0,00	0,00	2.785.847,24	20.910,57	0,76%	8,05%	0,76%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.668.565,28	0,00	0,00	6.713.924,09	45.358,81	0,68%	0,25%	0,68%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1.671.285,69	0,00	0,00	1.677.763,34	6.477,65	0,39%	0,04%	0,39%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.101.610,05	0,00	0,00	2.102.997,07	1.387,02	0,07%	1,13%	0,07%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.999.101,72	-898,28	-0,04%	4,60%	2,15%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.025.500,48	0,00	0,00	1.021.094,69	-4.405,79	-0,43%	7,01%	-0,43%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	1.820.059,80	0,00	0,00	1.785.058,65	-35.001,15	-1,92%	31,40%	-1,92%
Total Renda Variável					690.613,70	1,83%	5,07%	

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	10.683.113,31	1.500.000,00	0,00	12.518.955,84	335.842,53	2,88%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.488.802,50	0,00	2.000.000,00	10.798.259,49	309.456,99	2,48%	2,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.486.141,47	0,00	0,00	10.771.308,02	285.166,55	2,72%	2,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.109.336,78	0,00	0,00	8.331.357,72	222.020,94	2,74%	2,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.935.013,30	0,00	0,00	7.116.585,06	181.571,76	2,62%	2,62%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.277.568,97	0,00	0,00	4.436.907,54	159.338,57	3,72%	3,72%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4.080.933,55	0,00	0,00	4.231.812,83	150.879,28	3,70%	3,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.019.940,43	0,00	0,00	4.169.501,04	149.560,61	3,72%	3,72%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.305.475,33	0,00	0,00	5.439.553,25	134.077,92	2,53%	2,53%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.584.996,30	4.000.000,00	0,00	6.717.037,17	132.040,87	2,01%	2,41%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.285.828,51	0,00	0,00	4.391.144,75	105.316,24	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.387.653,87	0,00	0,00	5.488.024,23	100.370,36	1,86%	1,86%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.437.047,09	0,00	0,00	3.535.718,36	98.671,27	2,87%	2,87%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.657.266,53	0,00	0,00	2.743.884,98	86.618,45	3,26%	3,26%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.297.223,50	0,00	0,00	3.380.783,75	83.560,25	2,53%	2,53%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	3.104.592,58	0,00	0,00	3.173.764,65	69.172,07	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.635.707,95	0,00	0,00	1.676.965,92	41.257,97	2,52%	2,52%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.521.030,81	7.890.408,38	8.781.705,98	1.650.981,27	21.248,06	0,53%	1,32%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.183.960,74	0,00	0,00	1.201.646,96	17.686,22	1,49%	1,49%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	541.561,72	0,00	0,00	550.278,70	8.716,98	1,61%	1,61%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	376.185,31	0,00	0,00	381.722,87	5.537,56	1,47%	1,47%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.698.111,45</b>	<b>2,70%</b>	

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 (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.477.797,56	0,00	0,00	2.785.847,24	308.049,68	12,43%	12,43%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.511.691,72	0,00	0,00	6.786.086,59	274.394,87	4,21%	4,21%
META VALOR FI AÇÕES	6.678.047,05	0,00	0,00	6.929.292,64	251.245,59	3,76%	3,76%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.633.646,74	0,00	0,00	2.835.300,13	201.653,39	7,66%	7,66%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.615.390,54	0,00	0,00	6.713.924,09	98.533,55	1,49%	1,49%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	2.066.128,37	0,00	0,00	2.160.821,89	94.693,52	4,58%	4,58%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.064.885,22	0,00	0,00	2.102.997,07	38.111,85	1,85%	1,85%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.034.853,50	0,00	0,00	1.056.941,78	22.088,28	2,13%	2,13%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1.655.901,85	0,00	0,00	1.677.763,34	21.861,49	1,32%	1,32%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.021.094,69	21.094,69	2,11%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	500.000,00	0,00	508.501,54	8.501,54	1,70%	3,48%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.999.101,72	-898,28	-0,04%	2,35%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.088.401,95	0,00	0,00	1.785.058,65	-303.343,30	-14,53%	-14,53%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.035.986,87</b>	<b>2,90%</b>	