

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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	17.547.255,77	3,01%	73	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	46.840.584,36	8,04%	31.370	2,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.235.378,01	1,76%	937	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	24.093.549,29	4,14%	165	3,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	49.345.308,30	8,47%	876	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	33.196.067,73	5,70%	681	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	17.620.832,95	3,02%	204	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	41.813.118,62	7,18%	643	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.685.962,60	2,18%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	87.771.403,12	15,07%	963	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	46.053.470,98	7,90%	350	0,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.660.889,31	0,80%	758	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.267.518,38	0,22%	15.892	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	89.704.116,09	15,40%		1,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.321.676,90	0,23%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	7.659.940,60	1,31%	177	1,33%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.021.109,51	1,38%	1.824	2,97%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	13.900.490,18	2,39%	207	1,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	12.721.261,52	2,18%	7.737	1,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	11.122.359,64	1,91%	52	1,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	8.649.083,06	1,48%	5.493	0,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	7.894.223,20	1,35%	89.300	1,93%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

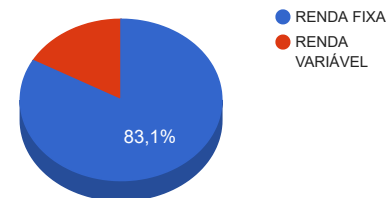
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	16.799.332,02	2,88%	38	4,63%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.946.136,14	1,88%	1.420	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	732.184,66	0,13%		3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
Total			582.603.252,94				

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

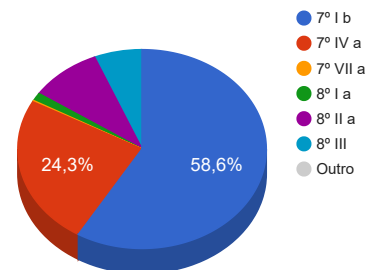
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	341.149.460,75	58,56%	35,00%	48,50%	65,00%	37.542.653,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	141.685.994,76	24,32%	20,00%	35,00%	40,00%	91.355.306,42
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.321.676,90	0,23%	0,00%	0,50%	0,50%	1.591.339,36
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	7.659.940,60	1,31%	2,00%	4,00%	8,00%	38.948.319,64
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	54.414.303,91	9,34%	2,00%	5,00%	10,00%	3.846.021,38
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	35.639.691,36	6,12%	2,00%	6,50%	10,00%	22.620.633,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	732.184,66	0,13%	0,00%	0,50%	1,00%	5.093.847,87
Total Carteira		582.603.252,94					

RENDA FIXA	484.157.132,41	83,10%
RENDA VARIÁVEL	98.446.120,53	16,90%

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 "	341.149.460,75	58,56%	35,00%	65,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	141.685.994,76	24,32%	20,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.321.676,90	0,23%	0,00%	0,50%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	7.659.940,60	1,31%	2,00%	8,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	54.414.303,91	9,34%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	35.639.691,36	6,12%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	732.184,66	0,13%	0,00%	1,00%
Total	582.603.252,94	100,00%	61,00	149,50

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	164.027.747,87	28,15%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	114.294.865,92	19,62%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	89.704.116,09	15,40%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	59.953.961,16	10,29%	0,01%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	46.840.584,36	8,04%	0,13%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	21.335.045,66	3,66%	0,01%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	17.620.832,95	3,02%	0,00%
BANCO J. SAFRA S/A	16.799.332,02	2,88%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	12.721.261,52	2,18%	0,04%
ITAÚ DTVM	11.122.359,64	1,91%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	10.946.136,14	1,88%	0,00%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.021.109,51	1,38%	0,01%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	7.894.223,20	1,35%	0,01%
PETRA Capital	1.321.676,90	0,23%	0,02%

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	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%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	2,84%	19,27%	3,69%	13,09%	31,04%	34,02%	0,20%	1,967%	7,32%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2,59%	18,97%	3,65%	12,69%	30,19%	34,99%	0,40%	1,812%	6,85%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,20%	8,63%	0,39%	7,10%	17,53%	14,83%	0,20%	1,465%	7,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	7,85%	2,09%	5,18%	12,01%	20,16%	0,20%	0,627%	2,11%
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%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
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%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,05%	0,80%	0,22%	0,51%	1,09%	2,62%	5,00%	0,007%	0,06%
SELIC	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,35%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,46%	4,62%	1,52%	3,08%	6,20%	13,18%	0,20%	0,009%	0,12%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,29%	5,64%	1,31%	3,05%	7,10%	16,50%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,15%	-8,65%	-6,51%	-8,22%	-9,30%	-14,10%	0,15%	0,050%	6,02%

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

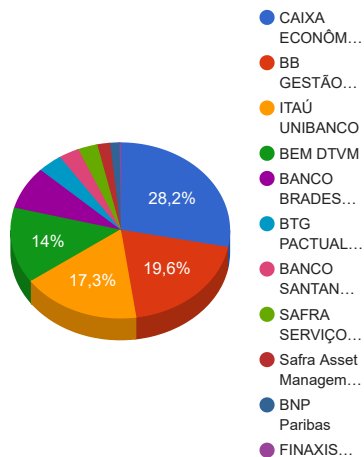
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,12%	14,38%	3,11%	10,02%	18,30%	25,15%	0,002	1,371%	3,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	10,59%	2,06%	7,25%	13,67%	20,84%	0,40%	0,303%	2,74%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,79%	5,05%	0,26%	4,69%	10,78%	10,80%	0,15%	0,984%	5,93%

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

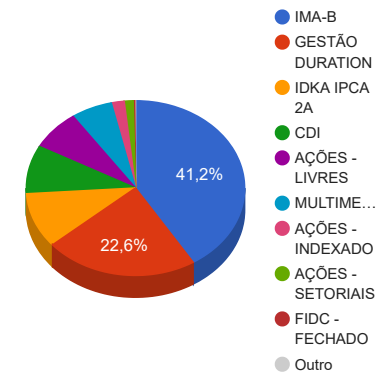
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5,40%	28,91%	4,21%	13,85%	50,25%	31,95%	2,00%	3,938%	16,53%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2,04%	19,70%	4,53%	11,60%	38,21%	40,61%	1,50%	4,656%	14,46%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,25%	26,61%	7,95%	21,60%	52,23%	53,35%	3,00%	5,835%	13,66%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,35%	16,71%	4,89%	11,13%	32,02%	51,15%	1,50%	5,462%	11,91%
IGC	3,13%	23,17%	6,28%	13,72%	38,40%	39,69%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,03%	19,92%	4,24%	10,82%	36,11%	38,02%	1,00%	4,713%	14,63%
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%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2,17%	21,35%	2,15%	6,99%	5,85%	27,76%	1,00%	4,068%	18,17%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,64%	4,95%	1,69%	3,48%	6,99%	13,35%	0,50%	0,301%	0,71%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	103,761%	88,16%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	1,38%	10,17%	2,30%	7,28%	14,27%	19,72%	0,96%	0,907%	2,73%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	164.027.747,87	28,15%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	114.294.865,92	19,62%
ITAÚ UNIBANCO	100.826.475,73	17,31%
BEM DTVM	81.356.559,26	13,96%
BANCO BRADESCO	46.053.470,98	7,90%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	21.335.045,66	3,66%
BANCO SANTANDER	17.620.832,95	3,02%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	16.799.332,02	2,88%
Safra Asset Management	10.946.136,14	1,88%
BNP Paribas	8.021.109,51	1,38%
FINAXIS Corretora	1.321.676,90	0,23%



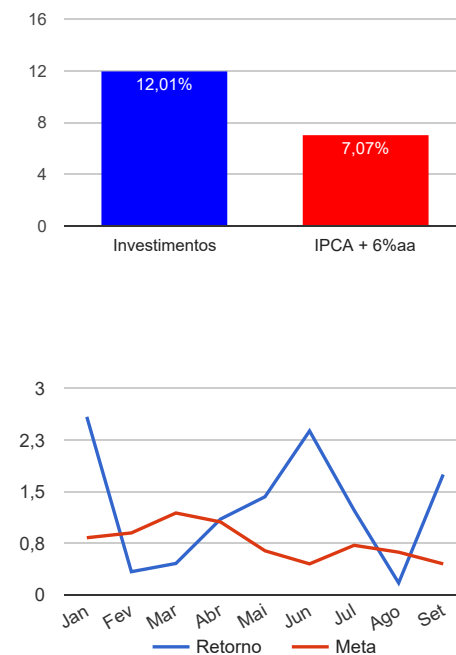
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	239.755.655,82	41,15%
GESTÃO DURATION	131.517.234,71	22,57%
IDKA IPCA 2A	59.580.686,31	10,23%
CDI	51.981.878,67	8,92%
AÇÕES - LIVRES	43.291.944,27	7,43%
MULTIMERCADO	35.639.691,36	6,12%
AÇÕES - INDEXADO	11.122.359,64	1,91%
AÇÕES - SETORIAIS	7.659.940,60	1,31%
FIDC - FECHADO	1.321.676,90	0,23%
FIP	732.184,66	0,13%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	538.729.092,52	21.785.926,14	19.097.109,18	555.430.520,81	14.012.611,33	2,59%	0,83%	311,21%	1,69%
Fevereiro	555.430.520,81	13.821.182,46	16.963.205,64	554.155.790,33	1.867.292,70	0,34%	0,90%	37,54%	2,05%
Março	554.155.790,33	13.527.269,34	15.455.000,00	554.755.533,29	2.527.473,62	0,46%	1,19%	38,21%	2,65%
Abril	554.755.533,29	21.417.421,87	24.269.913,04	558.006.665,96	6.103.623,84	1,10%	1,06%	103,84%	1,45%
Mai	558.006.665,96	158.509.980,17	162.570.394,26	561.903.405,98	7.957.154,11	1,43%	0,64%	222,58%	2,00%
Junho	561.903.405,98	117.642.497,78	114.656.980,36	578.350.119,01	13.461.195,61	2,38%	0,45%	529,15%	2,07%
Julho	578.350.119,01	15.505.341,29	24.765.000,00	576.205.310,49	7.114.850,19	1,23%	0,72%	169,86%	1,47%
Agosto	576.205.310,49	17.079.580,16	18.312.535,42	575.970.608,97	998.253,74	0,17%	0,62%	27,92%	2,97%
Setembro	575.970.608,97	36.296.553,05	39.738.806,90	582.603.252,94	10.074.897,82	1,75%	0,45%	391,71%	1,81%
Acumulado no ano					64.117.352,96	12,01%	7,07%	169,79%	

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	85.338.335,29	0,00	0,00	87.771.403,12	2.433.067,83	2,85%	1,98%	2,85%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	17.133.432,19	0,00	0,00	17.620.832,95	487.400,76	2,84%	1,97%	2,84%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.998.444,11	280.331,87	0,00	33.196.067,73	917.291,75	2,84%	1,97%	2,85%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	45.658.195,80	0,00	0,00	46.840.584,36	1.182.388,56	2,59%	1,81%	2,59%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.170.274,40	0,00	0,00	17.547.255,77	376.981,37	2,20%	1,47%	2,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	27.383.363,05	13.613.706,11	0,00	41.813.118,62	816.049,46	1,99%	1,37%	2,12%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.462.652,80	0,00	0,00	12.685.962,60	223.309,80	1,79%	0,98%	1,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.647.281,71	0,00	12.000.000,00	49.345.308,30	698.026,59	1,15%	0,89%	1,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.835.920,27	0,00	0,00	24.093.549,29	257.629,02	1,08%	0,63%	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	89.007.425,97	0,00	0,00	89.704.116,09	696.690,12	0,78%	0,30%	0,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.880.650,63	21.134.996,69	15.922.458,34	10.235.378,01	142.189,03	0,55%	0,82%	1,42%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	45.844.025,15	0,00	0,00	46.053.470,98	209.445,83	0,46%	0,01%	0,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.859.419,35	0,00	220.000,00	4.660.889,31	21.469,96	0,44%	0,01%	0,45%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.267.518,38	0,00	1.267.518,38	0,00	0,00%	0,01%	0,05%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.323.696,31	0,00	0,00	1.321.676,90	-2.019,41	-0,15%	0,05%	-0,15%
Total Renda Fixa					8.459.920,67	1,78%	1,13%	

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	7.610.342,78	0,00	0,00	8.021.109,51	410.766,73	5,40%	3,94%	5,40%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7.434.332,39	0,00	0,00	7.659.940,60	225.608,21	3,03%	4,71%	3,03%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	16.441.874,31	0,00	0,00	16.799.332,02	357.457,71	2,17%	4,07%	2,17%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.899.938,71	0,00	0,00	11.122.359,64	222.420,93	2,04%	4,66%	2,04%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	7.786.729,82	0,00	0,00	7.894.223,20	107.493,38	1,38%	0,91%	1,38%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.542.163,46	0,00	0,00	8.649.083,06	106.919,60	1,25%	5,84%	1,25%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.625.775,74	0,00	0,00	12.721.261,52	95.485,78	0,76%	8,05%	0,76%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.876.686,45	0,00	0,00	10.946.136,14	69.449,69	0,64%	0,30%	0,64%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	13.852.595,16	0,00	0,00	13.900.490,18	47.895,02	0,35%	5,46%	0,35%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.980.220,00	0,00	1.250.942,89	732.184,66	2.907,55	0,15%	103,76%	-63,03%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	10.376.833,12	0,00	10.345.405,67	0,00	-31.427,45	-0,30%	2,87%	-0,04%
Total Renda Variável					1.614.977,15	1,49%	5,11%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	83.438.036,01	1.199.690,68	0,00	87.771.403,12	3.133.676,43	3,71%	3,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	87.893.643,79	0,00	0,00	89.704.116,09	1.810.472,30	2,06%	2,06%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	45.189.007,65	0,00	0,00	46.840.584,36	1.651.576,71	3,65%	3,65%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.026.024,50	0,00	12.000.000,00	49.345.308,30	1.319.283,80	2,20%	2,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	34.204.624,68	13.613.706,11	7.150.000,00	41.813.118,62	1.144.787,83	2,95%	3,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.073.596,37	6.004.445,05	0,00	33.196.067,73	1.118.026,31	3,63%	3,72%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	45.362.607,97	0,00	0,00	46.053.470,98	690.863,01	1,52%	1,52%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	16.993.984,86	0,00	0,00	17.620.832,95	626.848,09	3,69%	3,69%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.478.630,12	0,00	483.338,28	17.547.255,77	551.963,93	3,22%	0,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.245.101,18	0,00	651.873,35	24.093.549,29	500.321,46	2,09%	2,09%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.653.647,20	0,00	318.858,68	12.685.962,60	351.174,08	2,82%	0,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.556.674,61	46.796.114,28	49.339.923,45	10.235.378,01	222.512,57	0,83%	2,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.859.908,10	0,00	1.276.000,00	4.660.889,31	76.981,21	1,45%	1,49%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.267.518,38	0,00	1.267.518,38	0,00	0,00%	0,22%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.413.649,43	0,00	0,00	1.321.676,90	-91.972,53	-6,51%	-6,51%
Total Renda Fixa					13.106.515,20	2,78%	

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	11.314.586,95	0,00	0,00	12.721.261,52	1.406.674,57	12,43%	12,43%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	13.252.307,27	0,00	0,00	13.900.490,18	648.182,91	4,89%	4,89%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.012.337,09	0,00	0,00	8.649.083,06	636.745,97	7,95%	7,95%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	1.482.606,06	0,00	1.250.942,89	732.184,66	500.521,49	33,76%	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.639.858,14	0,00	0,00	11.122.359,64	482.501,50	4,53%	4,53%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	16.445.011,62	0,00	0,00	16.799.332,02	354.320,40	2,15%	2,15%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.696.776,60	0,00	0,00	8.021.109,51	324.332,91	4,21%	4,21%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7.348.692,52	0,00	0,00	7.659.940,60	311.248,08	4,24%	4,24%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.764.642,48	0,00	0,00	10.946.136,14	181.493,66	1,69%	1,69%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	7.716.470,93	0,00	0,00	7.894.223,20	177.752,27	2,30%	2,30%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	10.287.692,88	0,00	10.345.405,67	0,00	57.712,79	0,56%	0,83%
Total Renda Variável					5.081.486,55	4,84%	