

# 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 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.445.030,00	0,92%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	290.246.611,22	18,56%	552	3,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	38.913.901,53	2,49%	334	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	15.796.310,10	1,01%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	194.440.790,47	12,43%	150	14,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	24.646.518,00	1,58%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	116.328.495,05	7,44%	876	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	27.792.753,66	1,78%	93	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	264.700.784,07	16,92%	643	3,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.150.767,93	1,03%	110	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	27.247.826,08	1,74%	695	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	254.965.313,72	16,30%		4,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	15.012.887,92	0,96%	694	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.458,51	0,00%	333	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	D+3	Não há	23.293.780,55	1,49%	56	7,31%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	23.639.899,33	1,51%	4.308	3,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	66.470.835,27	4,25%	207	8,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	21.260.279,18	1,36%	152	1,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	50.787.140,87	3,25%	55.951	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	43.267.225,96	2,77%	52	5,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	31.296.742,44	2,00%	12.245	1,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	3.330.060,00	0,21%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

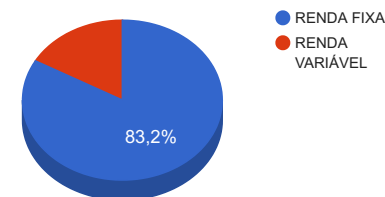
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.564.041.411,86				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			38.429,44	Artigo 6º			
Total			1.564.079.841,30				

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

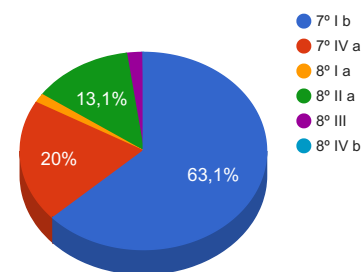
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	987.311.194,10	63,13%	25,00%	52,00%	80,00%	263.921.935,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	313.384.254,16	20,04%	5,00%	20,00%	40,00%	312.232.310,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	46.921.242,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	4,00%	62.561.656,47
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	23.293.780,55	1,49%	0,00%	7,00%	10,00%	133.110.360,64
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	205.425.380,61	13,13%	0,00%	15,00%	20,00%	107.382.901,76
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	31.296.742,44	2,00%	0,00%	2,00%	5,00%	46.905.328,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	15.640.414,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.330.060,00	0,21%	0,00%	0,50%	1,00%	12.310.354,12
Total Carteira		1.564.041.411,86					

RENDA FIXA	1.300.733.877,70	83,16%
RENDA VARIÁVEL	263.345.963,60	16,84%

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 "	987.311.194,10	63,12%	25,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	313.384.254,16	20,04%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	23.293.780,55	1,49%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	205.425.380,61	13,13%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	31.296.742,44	2,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.330.060,00	0,21%	0,00%	1,00%
Total	1.564.041.411,86	100,00%	30,00	174,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	516.325.897,64	33,01%	0,03%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	338.426.593,02	21,64%	0,07%
ITAÚ UNIBANCO	327.012.733,77	20,91%	0,02%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	233.093.577,72	14,90%	0,05%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	105.915.383,75	6,77%	0,01%
ITAÚ DTVM	43.267.225,96	2,77%	0,00%

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
IMA-B 5+	3,73%	26,55%	4,48%	17,54%	44,85%	43,66%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	26,14%	4,42%	17,32%	44,24%	42,79%	0,20%	2,783%	11,11%

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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,67%	10,98%	2,70%	7,61%	17,55%	23,59%	0,20%	1,007%	3,76%
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%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,72%	10,08%	2,72%	7,04%	15,17%	22,45%	0,10%	1,014%	2,86%

IDKA IPCA 2 Anos	1,60%	9,13%	2,72%	6,49%	12,85%	22,46%	-	-	-
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%

IMA Geral ex-C	1,46%	10,53%	2,59%	7,40%	16,57%	22,60%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	11,06%	2,62%	7,89%	17,17%	23,01%	0,30%	0,853%	3,32%

CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,46%	4,66%	1,53%	3,07%	6,28%	13,25%	0,20%	0,014%	0,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,45%	4,55%	1,50%	3,02%	6,11%	13,21%	0,20%	0,008%	0,12%
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%	-	-	-
---------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---	---

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	9,92%	2,51%	6,78%	15,63%	32,86%	0,20%	0,870%	3,15%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	1,51%	-0,81%	1,83%	3,61%	8,37%	0,20%	0,044%	3,94%
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 definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



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

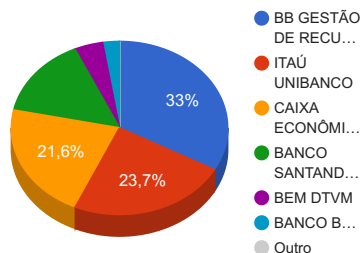
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-	-
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	3,52%	18,94%	3,65%	9,60%	31,81%	40,48%	0,50%	5,034%	14,54%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3,42%	28,77%	8,98%	20,27%	46,74%	60,66%	1,90%	4,841%	14,23%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	2,06%	19,34%	4,74%	12,03%	36,44%	41,00%	2,00%	4,823%	13,05%
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%
BRADESCO SELECTION FI 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%

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%

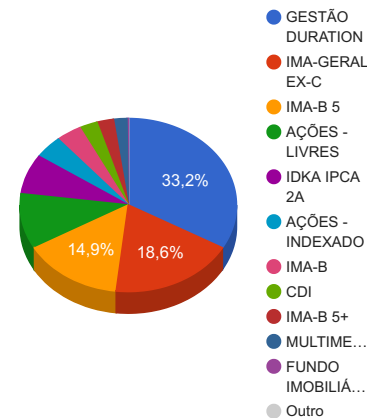
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,51%	13,80%	3,48%	9,25%	19,02%	26,56%	0,50%	0,976%	3,65%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	516.325.897,64	33,01%
ITAÚ UNIBANCO	370.279.959,73	23,67%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	338.426.593,02	21,64%
BANCO SANTANDER	233.093.577,72	14,90%
BEM DTVM	66.470.835,27	4,25%
BANCO BRADESCO	39.444.548,48	2,52%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	38.429,44	0,00%

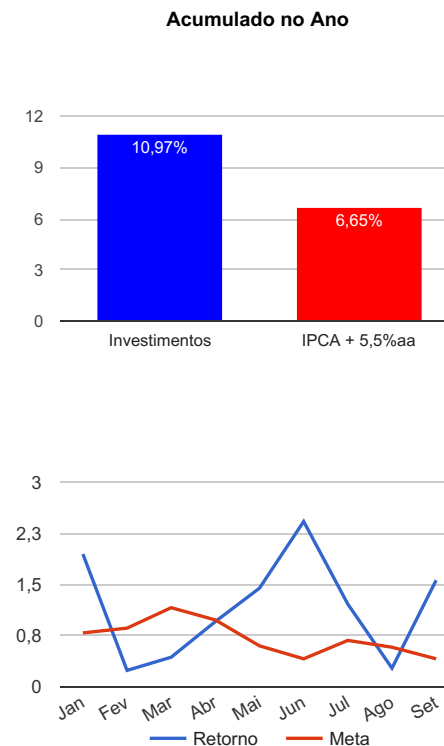


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	519.666.097,79	33,23%
IMA-GERAL EX-C	290.246.611,22	18,56%
IMA-B 5	233.532.338,47	14,93%
AÇÕES - LIVRES	162.158.154,65	10,37%
IDKA IPCA 2A	116.328.495,05	7,44%
AÇÕES - INDEXADO	66.561.006,51	4,26%
IMA-B	59.739.831,69	3,82%
CDI	42.268.172,51	2,70%
IMA-B 5+	38.913.901,53	2,49%
MULTIMERCADO	31.296.742,44	2,00%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.330.060,00	0,21%
DISP. FINANCEIRA	38.429,44	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.318.859.470,03	161.471.399,07	151.927.382,57	1.354.259.056,04	25.855.569,51	1,95%	0,79%	246,37%	1,19%
Fevereiro	1.354.259.056,04	152.907.674,76	143.288.887,74	1.367.150.993,59	3.273.150,53	0,24%	0,86%	27,98%	2,24%
Março	1.367.150.993,59	87.352.835,56	75.367.034,05	1.385.117.934,89	5.981.139,79	0,43%	1,16%	37,47%	2,90%
Abril	1.385.117.934,89	59.389.879,60	48.622.013,83	1.409.232.075,90	13.346.275,24	0,96%	0,98%	97,59%	1,64%
Mai	1.409.232.075,90	140.590.825,29	130.504.659,48	1.439.852.510,25	20.534.268,54	1,45%	0,60%	241,48%	2,05%
Junho	1.439.852.510,25	281.485.978,38	270.774.482,31	1.485.739.287,62	35.175.281,30	2,42%	0,41%	584,98%	2,17%
Julho	1.485.739.287,62	50.832.695,90	40.088.725,93	1.514.629.550,65	18.146.293,06	1,21%	0,68%	178,12%	1,59%
Agosto	1.514.629.550,65	35.721.341,47	25.212.860,13	1.529.289.190,42	4.151.158,43	0,27%	0,58%	47,01%	2,82%
Setembro	1.529.289.190,42	34.351.392,12	23.656.036,30	1.564.041.411,86	24.056.865,62	1,56%	0,41%	383,83%	1,54%
Acumulado no ano					150.520.002,02	10,97%	6,65%	164,96%	



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(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.522.750,94	0,00	0,00	38.913.901,53	1.391.150,59	3,71%	2,78%	3,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	15.695.813,63	0,00	0,00	16.150.767,93	454.954,30	2,90%	2,01%	2,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	259.209.888,75	0,00	0,00	264.700.784,07	5.490.895,32	2,12%	1,37%	2,12%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	191.150.919,49	0,00	0,00	194.440.790,47	3.289.870,98	1,72%	1,01%	1,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.335.836,49	0,00	0,00	27.792.753,66	456.917,17	1,67%	1,01%	1,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	285.960.279,56	0,00	0,00	290.246.611,22	4.286.331,66	1,50%	0,85%	1,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.565.934,56	0,00	0,00	15.796.310,10	230.375,54	1,48%	0,87%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	114.898.774,91	0,00	193.000,00	116.328.495,05	1.622.720,14	1,41%	0,89%	1,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	252.985.116,79	0,00	0,00	254.965.313,72	1.980.196,93	0,78%	0,30%	0,78%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.345.240,00	0,00	0,00	14.445.030,00	99.790,00	0,70%	0,44%	0,70%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.509.844,00	0,00	0,00	24.646.518,00	136.674,00	0,56%	0,04%	0,56%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.073.365,90	5.000,00	135.106,37	15.012.887,92	69.628,39	0,46%	0,01%	0,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	279.924,60	0,00	281.059,49	0,00	1.134,89	0,41%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.429,19	0,00	0,00	7.458,51	29,32	0,39%	0,01%	0,39%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	25.704.185,63	24.475.000,00	23.025.870,44	27.247.826,08	94.510,89	0,19%	0,01%	0,45%
Total Renda Fixa					19.605.180,12	1,53%	0,91%	

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(%)
BRDESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	22.501.272,37	0,00	0,00	23.293.780,55	792.508,18	3,52%	5,03%	3,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	49.106.236,89	0,00	0,00	50.787.140,87	1.680.903,98	3,42%	4,84%	3,42%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	23.162.851,13	0,00	0,00	23.639.899,33	477.048,20	2,06%	4,82%	2,06%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	42.401.983,60	0,00	0,00	43.267.225,96	865.242,36	2,04%	4,66%	2,04%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.291.000,00	0,00	21.000,00	3.330.060,00	60.060,00	1,82%	8,68%	1,19%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	20.976.904,18	9.871.392,12	0,00	31.296.742,44	448.446,14	1,45%	0,98%	1,51%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	66.241.805,84	0,00	0,00	66.470.835,27	229.029,43	0,35%	5,46%	0,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	21.361.831,97	0,00	0,00	21.260.279,18	-101.552,79	-0,48%	6,00%	-0,48%
Total Renda Variável					4.451.685,50	1,72%	4,67%	

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	235.841.844,24	21.006.482,46	0,00	264.700.784,07	7.852.457,37	3,11%	3,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	282.841.291,20	0,00	0,00	290.246.611,22	7.405.320,02	2,62%	2,62%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	189.290.244,31	0,00	0,00	194.440.790,47	5.150.546,16	2,72%	2,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	249.819.422,29	0,00	0,00	254.965.313,72	5.145.891,43	2,06%	2,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	113.721.777,52	0,00	193.000,00	116.328.495,05	2.799.717,53	2,46%	2,46%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.133.478,90	18.179.041,06	0,00	38.913.901,53	1.601.381,57	4,34%	4,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.757.445,38	0,00	704.004,11	27.792.753,66	739.312,39	2,71%	2,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	15.574.001,89	0,00	0,00	16.150.767,93	576.766,04	3,70%	3,70%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.847.020,00	0,00	670.988,00	24.646.518,00	470.486,00	1,91%	-0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.811.701,40	0,00	406.470,46	15.796.310,10	391.079,16	2,51%	2,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	28.282.582,99	71.699.000,00	73.062.772,53	27.247.826,08	329.015,62	0,65%	1,50%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.589.560,00	0,00	384.616,44	14.445.030,00	240.086,44	1,66%	-0,99%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.772.507,97	149.513,85	135.106,37	15.012.887,92	225.972,47	1,52%	1,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.051.066,99	0,00	13.056.604,96	0,00	5.537,97	0,04%	1,85%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	277.034,93	0,00	281.059,49	0,00	4.024,56	1,45%	1,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.361,34	0,00	0,00	7.458,51	97,17	1,32%	1,32%
Total Renda Fixa					32.937.691,90	2,61%	

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 DUNAMIS FIC AÇÕES	46.601.366,03	0,00	0,00	50.787.140,87	4.185.774,84	8,98%	8,98%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	63.371.285,67	0,00	0,00	66.470.835,27	3.099.549,60	4,89%	4,89%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	41.390.241,04	0,00	0,00	43.267.225,96	1.876.984,92	4,53%	4,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	20.038.803,76	0,00	0,00	21.260.279,18	1.221.475,42	6,10%	6,10%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	22.570.970,86	0,00	0,00	23.639.899,33	1.068.928,47	4,74%	4,74%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	20.578.082,33	9.871.392,12	0,00	31.296.742,44	847.267,99	3,42%	3,48%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	22.474.166,58	0,00	0,00	23.293.780,55	819.613,97	3,65%	3,65%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.096.030,00	0,00	63.000,00	3.330.060,00	297.030,00	9,64%	7,56%
Total Renda Variável					13.416.625,21	5,52%	