

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.630.338,02	8,72%	1.389	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	46.918.517,20	18,92%	552	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.990.187,44	2,42%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	26.460.118,19	10,67%	643	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	13.092.209,54	5,28%	334	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.365.489,06	0,95%	1.212	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	7.759.101,47	3,13%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.527.172,00	1,02%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	111.226,29	0,04%	876	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	27.414.119,23	11,05%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.949.923,95	0,79%	52	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	514,59	0,00%	364	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.520.492,14	1,42%	729	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.853.148,91	1,15%	140	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.571,08	0,01%	333	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.113.965,22	9,32%	94	2,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	517.152,85	0,21%	695	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.499.752,01	1,01%	110	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	2.394.669,56	0,97%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.402.103,33	1,37%	740	4,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	2.711.021,10	1,09%	14.234	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	2.893.290,56	1,17%	98.534	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

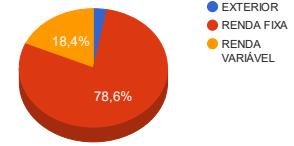
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.837.297,41	0,74%	3.691	0,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	6.705.717,52	2,70%	55.951	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	8.936.017,68	3,60%	4.629	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.623.953,29	2,67%	667	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.097.589,81	0,44%	12.245	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.831.579,37	2,75%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	3.134.076,81	1,26%	910	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.536.303,51	0,62%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5 du	Não há	2.277.806,54	0,92%	151	0,58%	Artigo 9º - A, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	5.054.564,59	2,04%	3.035	7,89%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			244.171.990,27				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.865.423,46				Artigo 6º
Total			248.037.413,73				

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

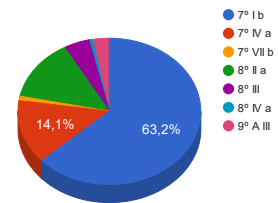
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	154.268.478,44	63,18%	40,00%	55,00%	100,00%	89.903.511,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	34.467.520,75	14,12%	0,00%	20,00%	40,00%	63.201.275,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.394.669,56	0,98%	0,00%	5,00%	5,00%	9.813.929,95
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	73.251.597,08
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	33.109.400,89	13,56%	0,00%	7,00%	20,00%	15.724.997,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.063.245,99	4,53%	0,00%	5,00%	10,00%	13.353.953,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.536.303,51	0,63%	0,00%	0,00%	5,00%	10.672.296,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	12.208.599,51
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	7.332.371,13	3,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.332.371,13
Total Carteira		244.171.990,27					

EXTERIOR	7.332.371,13	3,00%
RENDA FIXA	194.996.092,21	79,86%
RENDA VARIÁVEL	45.708.950,39	18,72%

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%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	154.268.478,44	62,20%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	34.467.520,75	13,90%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	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 "	2.394.669,56	0,97%	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%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	33.109.400,89	13,35%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.063.245,99	4,46%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.536.303,51	0,62%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	7.332.371,13	2,96%	0,00%	0,00%
Total	244.171.990,27	98,44%	40,00	690,00

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	138.251.694,59	55,74%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	58.559.368,47	23,61%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	17.329.396,08	6,99%	0,00%
Itaú Unibanco	9.839.794,33	3,97%	0,00%
Navi Capital	8.936.017,68	3,60%	0,51%
Alaska Asset Management	2.893.290,56	1,17%	0,02%
Moat Capital	2.711.021,10	1,09%	0,03%
BANCO J. SAFRA S/A	2.277.806,54	0,92%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.837.297,41	0,74%	0,00%
FL Asset Management	1.536.303,51	0,62%	1,38%

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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,69%	26,13%	4,34%	17,28%	44,11%	42,62%	0,20%	2,800%	11,12%
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 VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	7,85%	2,09%	5,18%	12,01%	20,16%	0,20%	0,627%	2,11%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	0,53%	-1,01%	1,08%	3,31%	5,59%	0,20%	0,437%	4,36%
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%
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%
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%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,46%	4,64%	1,54%	3,07%	6,21%	13,60%	0,20%	0,012%	0,13%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,45%	4,53%	1,50%	3,02%	6,09%	12,96%	0,15%	0,007%	0,12%

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 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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	3,82%	1,25%	2,54%	5,13%	10,94%	1,00%	0,008%	0,10%
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	7,07%	1,80%	4,01%	9,04%	20,73%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,11%	12,70%	3,15%	8,89%	20,73%	25,99%	0,15%	1,236%	4,70%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,94%	12,31%	3,00%	8,62%	19,93%	25,55%	0,20%	1,183%	4,38%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,66%	9,54%	2,62%	6,45%	14,32%	23,53%	0,20%	0,931%	2,48%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,48%	10,44%	2,53%	7,33%	16,59%	-	0,40%	0,855%	3,23%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

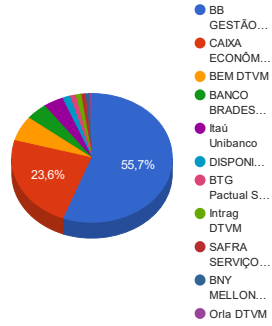
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3,42%	28,77%	8,98%	20,27%	46,74%	60,66%	1,90%	4,841%	14,23%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	3,18%	27,05%	8,95%	18,43%	59,34%	75,81%	1,85%	4,529%	26,37%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2,14%	29,51%	8,11%	21,00%	50,73%	58,13%	2,00%	6,103%	14,47%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,04%	25,35%	6,98%	14,16%	47,58%	71,52%	1,50%	4,762%	16,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,85%	6,35%	1,98%	4,70%	12,06%	-	1,60%	0,381%	2,65%
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	0,31%	17,75%	7,33%	12,81%	31,72%	45,82%	2,00%	5,935%	12,34%
SMLL	2,08%	30,58%	9,49%	21,44%	57,29%	45,27%	-	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2,56%	25,47%	9,30%	18,79%	50,99%	62,77%	1,50%	6,918%	12,52%
S&P 500	1,72%	18,74%	1,19%	5,02%	2,15%	18,15%	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,21%	21,62%	2,21%	7,08%	5,91%	27,87%	1,00%	4,123%	18,35%
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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	7,10%	16,38%	10,97%	9,02%	27,61%	61,61%	2,00%	6,391%	18,91%
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (setembro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	3,21%	20,50%	4,25%	10,92%	34,84%	42,73%	-	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,93%	21,42%	6,77%	6,96%	-2,52%	47,61%	1,60%	6,753%	22,96%
Global BDRX	2,71%	28,17%	10,43%	13,08%	6,23%	62,44%	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,62%	31,54%	8,81%	15,00%	14,42%	69,64%	1,50%	4,369%	20,30%

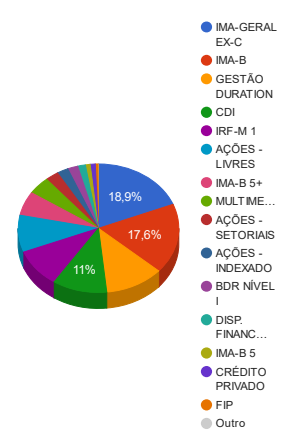
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (setembro / 2019)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	138.251.694,59	55,74%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	58.559.368,47	23,61%
BEM DTVM	15.559.970,97	6,27%
BANCO BRADESCO	10.705.442,79	4,32%
Itaú Unibanco	9.839.794,33	3,97%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.865.423,46	1,56%
BTG Pactual Serviços Financeiros	2.893.290,56	1,17%
Intrag DTVM	2.711.021,10	1,09%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA	2.277.806,54	0,92%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.837.297,41	0,74%
Orla DTVM	1.536.303,51	0,62%



- BB GESTÃO...
- CAIXA ECONÔM...
- BEM DTVM
- BANCO BRADES...
- Itaú Unibanco
- DISPONIL...
- BTG Pactual S...
- Intrag DTVM
- SAFRA SERVIÇO...
- BNY MELLON...
- Orla DTVM

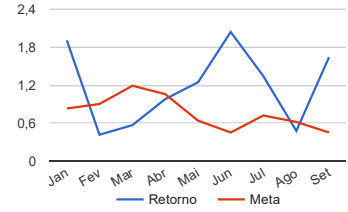
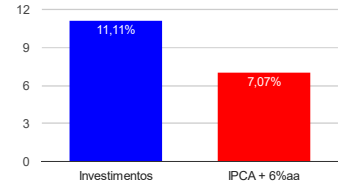
Sub-segmento	Valor	%
IMA-GERAL EX-C	46.918.517,20	18,92%
IMA-B	43.663.160,15	17,60%
GESTÃO DURATION	29.313.267,10	11,82%
CDI	27.164.695,88	10,95%
IRF-M 1	23.995.827,08	9,67%
AÇÕES - LIVRES	23.083.344,27	9,31%
IMA-B 5+	15.042.133,49	6,06%
MULTIMERCADO	11.063.245,99	4,46%
AÇÕES - SETORIAIS	6.623.953,29	2,67%
AÇÕES - INDEXADO	5.679.909,87	2,29%
BDR NÍVEL I	5.054.564,59	2,04%
DISP. FINANCEIRA	3.865.423,46	1,56%
IMA-B 5	2.527.172,00	1,02%
CRÉDITO PRIVADO	2.394.669,56	0,97%
FIP	1.536.303,51	0,62%
IDKA IPCA 2A	111.226,29	0,04%



- IMA-GERAL EX-C
- IMA-B
- GESTÃO DURATION
- CDI
- IRF-M 1
- AÇÕES - LIVRES
- IMA-B 5+
- MULTIME...
- AÇÕES - SETORIAIS
- AÇÕES - INDEXADO
- BDR NÍVEL I
- DISP. FINANC...
- IMA-B 5
- CRÉDITO PRIVADO
- FIP
- Outro

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

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(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.624.170,24	0,00	0,00	13.092.209,54	468.039,30	3,71%	2,78%	3,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.880.468,96	0,00	0,00	1.949.923,95	69.454,99	3,69%	2,80%	3,69%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.429.335,98	0,00	0,00	2.499.752,01	70.416,03	2,90%	2,01%	2,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	25.911.235,27	0,00	0,00	26.460.118,19	548.882,92	2,12%	1,37%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.599.130,70	0,00	0,00	7.759.101,47	159.970,77	2,11%	1,24%	2,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.891.861,70	0,00	0,00	27.414.119,23	522.257,53	1,94%	1,18%	1,94%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2.355.648,40	0,00	0,00	2.394.669,56	39.021,16	1,66%	0,93%	1,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.225.629,42	0,00	0,00	46.918.517,20	692.887,78	1,50%	0,85%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	109.677,31	0,00	0,00	111.226,29	1.548,98	1,41%	0,89%	1,41%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.318.069,39	500.000,00	0,00	2.853.148,91	35.079,52	1,24%	0,86%	1,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.926.135,19	0,00	0,00	5.990.187,44	64.052,25	1,08%	0,63%	1,08%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.509.592,00	0,00	0,00	2.527.172,00	17.580,00	0,70%	0,44%	0,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.495.612,59	0,00	0,00	21.630.338,02	134.725,43	0,63%	0,12%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.350.928,59	0,00	0,00	2.365.489,06	14.560,47	0,62%	0,12%	0,62%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	23.008.399,82	0,00	0,00	23.113.965,22	105.565,40	0,46%	0,01%	0,46%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	512,28	0,00	0,00	514,59	2,31	0,45%	0,01%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	531.443,13	0,00	16.669,68	517.152,85	2.379,40	0,45%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	12.521,65	0,00	0,00	12.571,08	49,43	0,39%	0,01%	0,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.116.193,65	2.773.428,19	2.383.661,40	3.520.492,14	14.531,70	0,25%	0,01%	0,37%
Total Renda Fixa					2.961.005,37	1,57%	0,93%	

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	6.483.778,12	0,00	0,00	6.705.717,52	221.939,40	3,42%	4,84%	3,42%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	2.627.406,30	0,00	0,00	2.711.021,10	83.614,80	3,18%	4,53%	3,18%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6.458.731,97	0,00	0,00	6.623.953,29	165.221,32	2,56%	6,92%	2,56%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.066.213,73	0,00	0,00	3.134.076,81	67.863,08	2,21%	4,12%	2,21%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.798.832,10	0,00	0,00	1.837.297,41	38.465,31	2,14%	6,10%	2,14%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.756.982,58	0,00	0,00	8.936.017,68	179.035,10	2,04%	4,76%	2,04%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.081.243,06	0,00	0,00	1.097.589,81	16.346,75	1,51%	0,98%	1,51%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	462.453,26	2.398.000,00	0,00	2.893.290,56	32.837,30	1,15%	6,39%	7,10%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.774.040,39	0,00	0,00	6.831.579,37	57.538,98	0,85%	0,38%	0,85%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.391.539,77	0,00	0,00	3.402.103,33	10.563,56	0,31%	5,93%	0,31%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.536.407,96	0,00	0,00	1.536.303,51	-104,45	-0,01%	-	-
Total Renda Variável					873.321,15	1,95%	4,52%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.958.896,10	0,00	0,00	5.054.564,59	95.668,49	1,93%	6,75%	1,93%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.263.862,11	0,00	0,00	2.277.806,54	13.944,43	0,62%	4,37%	0,62%
				Total Exterior	109.612,92	1,52%	6,01%	

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 (%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.617.179,22	4.137.491,71	0,00	46.918.517,20	1.163.846,27	2,54%	2,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.288.722,50	0,00	680.525,39	27.414.119,23	805.922,12	3,00%	3,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	25.660.840,99	0,00	0,00	26.460.118,19	799.277,20	3,11%	3,11%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.978.514,30	5.600.000,00	0,00	13.092.209,54	513.695,24	4,08%	4,42%
CDB - BRADESCO S.A.	4.749.592,83	8.762.334,01	14.008.659,33	0,00	496.732,49	3,69%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.172.817,97	21.484.912,09	21.394.220,97	21.630.338,02	366.828,93	1,53%	1,86%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	22.764.303,22	0,00	0,00	23.113.965,22	349.662,00	1,54%	1,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.522.265,88	0,00	0,00	7.759.101,47	236.835,59	3,15%	3,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.027.866,58	0,00	162.070,08	5.990.187,44	124.390,94	2,09%	2,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.792.493,57	0,00	13.537.491,71	2.365.489,06	110.487,20	1,68%	1,85%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.410.482,44	0,00	0,00	2.499.752,01	89.269,57	3,70%	3,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.868.743,02	0,00	0,00	1.949.923,95	81.180,93	4,34%	4,34%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2.333.449,77	0,00	0,00	2.394.669,56	61.219,79	2,62%	2,62%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.294.418,09	500.000,00	0,00	2.853.148,91	58.730,82	2,29%	2,53%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.553.036,00	0,00	68.247,04	2.527.172,00	42.383,04	1,68%	-1,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.942.220,49	15.424.566,38	13.888.278,85	3.520.492,14	41.984,12	0,62%	1,25%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.585,37	21.462.468,01	21.484.912,09	12.571,08	33.429,79	1,04%	1,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	569.903,77	0,00	60.813,71	517.152,85	8.062,79	1,49%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	108.553,80	0,00	0,00	111.226,29	2.672,49	2,46%	2,46%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00	6.406.800,00	6.408.339,71	0,00	1.539,71	0,02%	1,51%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	506,99	0,00	0,00	514,59	7,60	1,50%	1,50%
				Total Renda Fixa	5.388.158,63	2,85%	

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 (%)
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.352.828,23	0,00	0,00	8.936.017,68	583.189,45	6,98%	6,98%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6.060.154,12	0,00	0,00	6.623.953,29	563.799,17	9,30%	9,30%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	6.408.339,71	0,00	6.705.717,52	297.377,81	4,64%	8,98%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.169.625,68	0,00	0,00	3.402.103,33	232.477,65	7,33%	7,33%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.711.021,10	211.021,10	8,44%	8,95%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.699.497,43	0,00	0,00	1.837.297,41	137.799,98	8,11%	8,11%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.698.880,30	0,00	0,00	6.831.579,37	132.699,07	1,98%	1,98%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.066.349,93	0,00	0,00	3.134.076,81	67.726,88	2,21%	2,21%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.060.686,01	0,00	0,00	1.097.589,81	36.903,80	3,48%	3,48%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	2.863.537,78	0,00	2.893.290,56	29.752,78	0,48%	10,97%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.536.564,85	0,00	0,00	1.536.303,51	-261,34	-0,02%	-
				Total Renda Variável	2.292.486,35	5,74%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.733.923,13	0,00	0,00	5.054.564,59	320.641,46	6,77%	6,77%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.093.293,43	0,00	0,00	2.277.806,54	184.513,11	8,81%	8,81%
				Total Exterior	505.154,57	7,40%	

