

# 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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.208.495,39	1,38%	937	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.686.199,84	4,17%	95	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.227.580,85	5,13%	681	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.431.713,74	10,25%	608	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	3.096.407,70	1,93%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.674.024,65	9,15%	913	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.795.442,44	9,23%	643	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.028.066,84	3,76%	33	6,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	11.508.486,67	7,18%	95	5,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.550.731,95	7,83%	140	1,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.171,29	0,02%	729	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	128.566,31	0,08%	333	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.759.638,39	6,71%		0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	5.863.716,55	3,66%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	198.883,94	0,12%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.622.432,10	2,26%	6.208	1,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.848.441,56	1,78%	2.044	1,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	8.039.017,18	5,01%	5.493	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.213.691,79	2,00%	4.629	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	2.563.228,13	1,60%	188	0,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	3.006.973,41	1,87%	858	2,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.010.506,32	1,88%	1.824	1,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

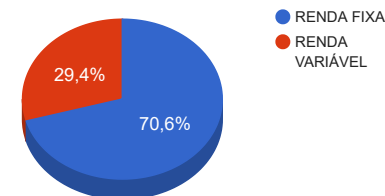
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	2.613.538,08	1,63%	55.951	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.587.382,80	4,11%	77	4,44%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.138.252,37	3,83%	12.245	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.185.741,63	1,99%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	2.371.220,23	1,48%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>Total</b>			<b>160.382.552,15</b>				

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

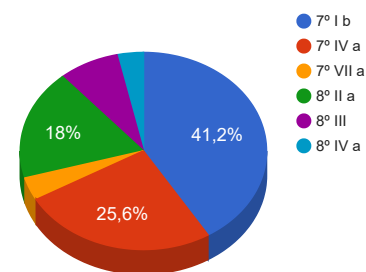
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	66.119.864,61	41,23%	15,00%	25,00%	70,00%	46.147.921,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	96.229.531,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	40.999.661,45	25,56%	10,00%	30,00%	40,00%	23.153.359,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.062.600,49	3,78%	1,00%	5,00%	5,00%	1.956.527,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	28.917.828,57	18,03%	7,00%	12,50%	20,00%	3.158.681,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.725.635,17	7,93%	7,00%	10,00%	10,00%	3.312.620,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.556.961,86	3,46%	2,00%	5,00%	5,00%	2.462.165,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	8.019.127,61
Total Carteira		160.382.552,15					

RENDA FIXA	113.182.126,55	70,57%
RENDA VARIÁVEL	47.200.425,60	29,43%

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 "	66.119.864,61	41,23%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	70,00%
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 "	40.999.661,45	25,56%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.062.600,49	3,78%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	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%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	28.917.828,57	18,03%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	12.725.635,17	7,93%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.556.961,86	3,46%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>160.382.552,15</b>	<b>100,00%</b>	<b>42,00</b>	<b>406,00</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	37.944.781,16	23,66%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.343.101,71	18,92%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	24.123.936,31	15,04%	3,29%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	19.236.931,79	11,99%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	13.373.176,47	8,34%	0,00%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	8.039.017,18	5,01%	0,00%
Aurora Capital	5.863.716,55	3,66%	2,87%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.622.432,10	2,26%	0,51%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	3.213.691,79	2,00%	0,07%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.185.741,63	1,99%	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.010.506,32	1,88%	0,01%
HIX CAPITAL	3.006.973,41	1,87%	0,21%
PERFIN INVESTIMENTOS	2.848.441,56	1,78%	0,05%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	2.371.220,23	1,48%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	198.883,94	0,12%	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%	-	-	-
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%	-	-	-
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%
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%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,57%	9,85%	3,00%	7,50%	16,36%	25,24%	-	-	-
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,53%	9,69%	2,87%	7,44%	16,19%	24,51%	0,20%	0,843%	3,00%
IPCA + 7,00% ao ano	0,53%	7,83%	2,05%	4,50%	10,07%	23,00%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,72%	-10,62%	-4,26%	-2,68%	-0,93%	-25,25%	1,65%	0,494%	12,69%
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 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%

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%
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%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,48%	10,44%	2,53%	7,33%	16,59%	-	0,40%	0,855%	3,23%
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 Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-1,19%	6,37%	-2,19%	8,17%	-27,81%	153.566.770.499,00%	0,72%	1,080%	34,37%



## 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 DUNAMIS FIC AÇÕES	3,42%	28,77%	8,98%	20,27%	46,74%	60,66%	1,90%	4,841%	14,23%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,39%	22,03%	3,73%	14,40%	43,43%	38,81%	1,85%	4,027%	12,54%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2,76%	20,51%	7,03%	12,55%	40,79%	41,14%	2,00%	4,923%	14,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2,15%	24,76%	2,35%	10,50%	55,71%	-	2,00%	4,601%	23,33%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,39%	27,31%	7,66%	17,52%	56,80%	57,82%	2,00%	4,534%	18,30%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,25%	26,61%	7,95%	21,60%	52,23%	53,35%	3,00%	5,835%	13,66%

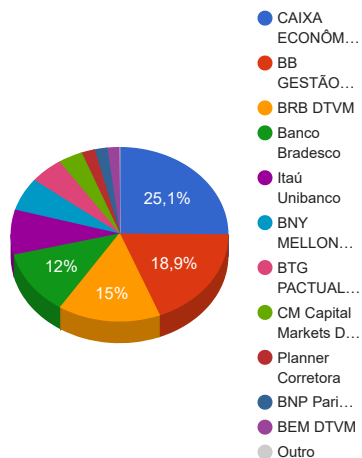
IPCA + 8,00% ao ano	0,60%	8,58%	2,30%	5,00%	11,09%	25,29%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

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%

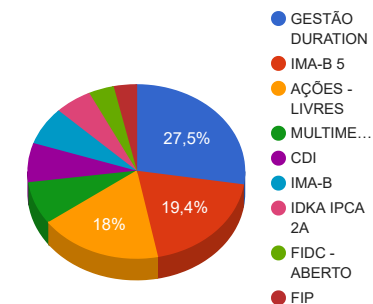
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3,92%	34,47%	11,91%	23,53%	53,24%	39,04%	2,00%	4,885%	13,40%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.316.001,39	25,14%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.343.101,71	18,92%
BRB DTVM	24.123.936,31	15,04%
Banco Bradesco	19.236.931,79	11,99%
Itaú Unibanco	13.373.176,47	8,34%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	9.843.097,30	6,14%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	8.039.017,18	5,01%
CM Capital Markets DTVM	5.863.716,55	3,66%
Planner Corretora	3.185.741,63	1,99%
BNP Paribas	3.010.506,32	1,88%
BEM DTVM	2.848.441,56	1,78%
Santander Securities Services	198.883,94	0,12%



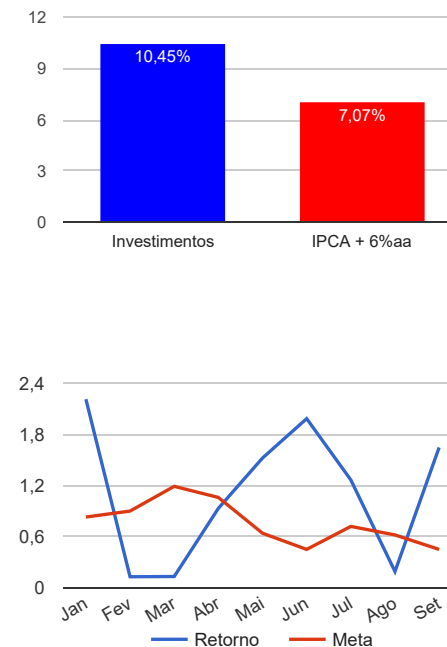
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	44.133.879,62	27,52%
IMA-B 5	31.105.738,39	19,39%
AÇÕES - LIVRES	28.917.828,57	18,03%
MULTIMERCADO	12.725.635,17	7,93%
CDI	11.661.224,27	7,27%
IMA-B	11.323.988,55	7,06%
IDKA IPCA 2A	8.894.695,23	5,55%
FIDC - ABERTO	6.062.600,49	3,78%
FIP	5.556.961,86	3,46%



## Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	146.458.485,09	4.258.701,74	3.477.204,61	150.498.104,38	3.258.122,16	2,21%	0,83%	266,08%	1,66%
Fevereiro	150.498.104,38	29.163.354,34	28.363.666,48	151.493.308,15	195.515,91	0,13%	0,90%	14,43%	1,98%
Março	151.493.308,15	2.839.786,38	3.012.544,51	151.520.465,58	199.915,56	0,13%	1,19%	11,06%	2,71%
Abril	151.520.465,58	7.816.188,97	7.834.190,96	152.914.794,10	1.412.330,51	0,93%	1,06%	87,97%	1,42%
Mai	152.914.794,10	31.137.710,98	32.463.049,20	153.917.527,83	2.328.071,95	1,52%	0,64%	237,64%	5,91%
Junho	153.917.527,83	2.166.805,89	2.341.115,97	156.797.884,11	3.054.666,36	1,98%	0,45%	440,69%	1,82%
Julho	156.797.884,11	17.178.334,01	17.228.410,46	158.732.463,40	1.984.655,74	1,27%	0,72%	174,77%	1,49%
Agosto	158.732.463,40	2.384.094,34	2.656.027,51	158.763.373,43	302.843,20	0,19%	0,62%	30,74%	3,18%
Setembro	158.763.373,43	12.628.654,30	13.623.327,31	160.382.552,15	2.613.851,73	1,65%	0,45%	368,68%	1,64%
Acumulado no ano					15.349.973,12	10,45%	7,07%	147,68%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.999.778,75	0,00	0,00	8.227.580,85	227.802,10	2,85%	1,97%	2,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.488.529,00	0,00	0,00	14.795.442,44	306.913,44	2,12%	1,37%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.037.419,03	0,00	0,00	3.096.407,70	58.988,67	1,94%	1,18%	1,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.153.812,34	0,00	0,00	16.431.713,74	277.901,40	1,72%	1,01%	1,72%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.458.427,34	46.352,25	80.000,00	14.674.024,65	249.245,06	1,72%	1,01%	1,72%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	5.937.837,55	0,00	0,00	6.028.066,84	90.229,29	1,52%	0,88%	1,52%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.367.559,17	0,00	0,00	12.550.731,95	183.172,78	1,48%	0,86%	1,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.676.073,29	0,00	0,00	10.759.638,39	83.565,10	0,78%	0,30%	0,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.172.387,68	488.000,00	1.480.000,00	2.208.495,39	28.107,71	0,77%	0,82%	1,42%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	11.422.130,82	0,00	0,00	11.508.486,67	86.355,85	0,76%	0,29%	0,76%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	5.821.905,93	0,00	0,00	5.863.716,55	41.810,62	0,72%	0,49%	0,72%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	11.601.295,91	6.593.379,18	11.593.021,73	6.686.199,84	84.546,48	0,46%	0,84%	1,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.176,85	17.249,41	23.337,66	24.171,29	82,69	0,17%	0,01%	0,37%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	91.590,87	483.673,46	446.967,92	128.566,31	269,90	0,05%	0,01%	0,39%
BBIF MASTER FIDC LP	201.278,44	0,00	0,00	198.883,94	-2.394,50	-1,19%	1,08%	-1,19%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.716.596,59</b>	<b>1,46%</b>	<b>0,93%</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	2.856.336,15	0,00	0,00	3.010.506,32	154.170,17	5,40%	3,94%	5,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.613.538,08	113.538,08	4,54%	4,84%	3,42%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.893.681,09	0,00	0,00	3.006.973,41	113.292,32	3,92%	4,89%	3,92%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.754.948,12	0,00	0,00	2.848.441,56	93.493,44	3,39%	4,03%	3,39%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	3.127.352,86	0,00	0,00	3.213.691,79	86.338,93	2,76%	4,92%	2,76%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.563.228,13	63.228,13	2,53%	4,60%	2,15%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.046.833,43	0,00	0,00	6.138.252,37	91.418,94	1,51%	0,98%	1,51%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.572.679,83	0,00	0,00	3.622.432,10	49.752,27	1,39%	4,53%	1,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.939.639,19	0,00	0,00	8.039.017,18	99.377,99	1,25%	5,84%	1,25%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.542.878,89	0,00	0,00	6.587.382,80	44.503,91	0,68%	0,25%	0,68%
W7 MULTIELABOR FIP	3.191.003,55	0,00	0,00	3.185.741,63	-5.261,92	-0,16%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.377.817,35	0,00	0,00	2.371.220,23	-6.597,12	-0,28%	-	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>897.255,14</b>	<b>1,94%</b>	<b>3,58%</b>	

## 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	14.348.518,52	0,00	0,00	14.795.442,44	446.923,92	3,11%	3,11%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.917.906,14	76.864,92	0,00	16.431.713,74	436.942,68	2,74%	2,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.359.520,05	1.132.906,00	200.000,00	14.674.024,65	381.598,60	2,67%	2,72%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.241.372,75	0,00	0,00	12.550.731,95	309.359,20	2,53%	2,53%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	11.450.039,47	6.593.379,18	11.593.021,73	6.686.199,84	235.802,92	1,79%	2,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.542.479,72	0,00	0,00	10.759.638,39	217.158,67	2,06%	2,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.040.646,21	0,00	8.227.580,85	186.934,64	2,32%	3,72%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA	11.326.180,43	0,00	0,00	11.508.486,67	182.306,24	1,61%	1,61%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	5.896.685,36	0,00	0,00	6.028.066,84	131.381,48	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.288.172,51	2.027.073,75	9.227.000,00	2.208.495,39	120.249,13	1,74%	2,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.082.244,22	0,00	76.864,92	3.096.407,70	91.028,40	3,00%	3,00%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.124.862,60	0,00	350.073,76	5.863.716,55	88.927,71	1,49%	-4,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.097.824,35	0,00	6.162.078,49	0,00	64.254,14	1,05%	2,46%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.329.973,22	0,00	2.340.646,21	0,00	10.672,99	0,46%	1,54%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	354.217,63	3.043.597,03	3.271.057,92	128.566,31	1.809,57	0,15%	1,32%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.196,44	276.615,56	287.022,25	24.171,29	381,54	0,36%	1,25%
BBIF MASTER FIDC LP	203.334,52	0,00	0,00	198.883,94	-4.450,58	-2,19%	-2,19%
Total Renda Fixa					2.901.281,25	2,44%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.447.184,29	0,00	0,00	8.039.017,18	591.832,89	7,95%	7,95%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.686.899,34	0,00	0,00	3.006.973,41	320.074,07	11,91%	11,91%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.364.795,99	0,00	0,00	3.622.432,10	257.636,11	7,66%	7,66%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	3.002.670,12	0,00	0,00	3.213.691,79	211.021,67	7,03%	7,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.138.252,37	138.252,37	2,30%	3,48%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.888.776,74	0,00	0,00	3.010.506,32	121.729,58	4,21%	4,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.613.538,08	113.538,08	4,54%	8,98%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.745.904,63	0,00	0,00	2.848.441,56	102.536,93	3,73%	3,73%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.490.706,37	0,00	0,00	6.587.382,80	96.676,43	1,49%	1,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.563.228,13	63.228,13	2,53%	2,35%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.371.108,87	0,00	0,00	2.371.220,23	111,36	0,00%	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.202.309,83	0,00	0,00	3.185.741,63	-16.568,20	-0,52%	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>2.000.069,42</b>	<b>4,73%</b>	