

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
TÍTULOS PÚBLICOS			268.087.763,46	33,42%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.189.615,48	2,02%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.398.069,34	3,04%	1.212	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.404.466,78	0,80%	1.389	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.727.624,53	1,96%	681	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	10.372.597,50	1,29%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	71.452.767,43	8,91%	643	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.374.495,00	1,29%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.607.062,93	0,95%	267	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.846.255,00	0,85%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.965.431,80	1,74%	608	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	57.694.397,32	7,19%	140	6,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.051.634,15	0,13%	33	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	58.271.861,49	7,26%	114	7,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	32.439.582,50	4,04%		0,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.084,40	0,00%	41	3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	12.779.161,66	1,59%	68	4,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	19.635.981,18	2,45%	66	5,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	7.182.713,83	0,90%	72	2,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.910.961,98	1,48%	152	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	10.404.622,40	1,30%	55.951	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou D+18 (isento de taxa de resgate)	Não há	7.775.091,39	0,97%	1.827	2,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

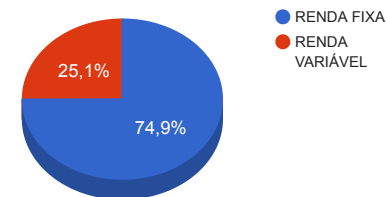
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	7.129.910,05	0,89%	724	10,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.933.175,90	1,11%	5.821	0,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.482.082,12	1,18%	7.737	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	2.904.189,94	0,36%	131	2,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	13.573.378,39	1,69%	12.245	0,47%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	7.902.687,47	0,99%	3.940	3,16%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	12.323.545,60	1,54%	6.069	1,45%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	23.943.850,91	2,98%	214	4,56%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	4.481.434,22	0,56%	729	1,61%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.941.662,10	0,74%	77	4,01%	Artigo 8º, Inciso III
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.110.338,60	1,26%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	8.742.856,05	1,09%		3,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	3.950.647,26	0,49%		0,16%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	11.860.520,71	1,48%		16,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			801.856.520,87				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			398.763,87				Artigo 6º
Total			802.255.284,74				

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

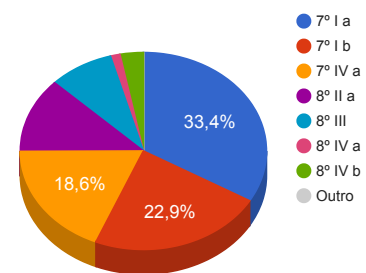
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	268.087.763,46	33,43%	0,00%	20,00%	50,00%	132.840.496,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	183.338.385,79	22,86%	15,00%	15,00%	70,00%	377.961.178,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	481.113.912,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	149.457.475,46	18,64%	10,00%	25,00%	40,00%	171.285.132,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.084,40	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	40.088.741,64
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	98.137.890,45	12,24%	7,00%	10,00%	20,00%	62.233.413,72
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	68.166.558,69	8,50%	7,00%	10,00%	10,00%	12.019.093,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	10.110.338,60	1,26%	2,00%	5,00%	5,00%	29.982.487,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	24.554.024,02	3,06%	2,00%	5,00%	5,00%	15.538.802,02
Total Carteira		801.856.520,87					

RENDA FIXA	601.286.472,98	74,99%
RENDA VARIÁVEL	200.968.811,76	25,06%

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 "	268.087.763,46	33,42%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	183.338.385,79	22,85%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	149.457.475,46	18,63%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.084,40	0,00%	2,00%	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 II, Alínea " a "	98.137.890,45	12,23%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	68.166.558,69	8,50%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	10.110.338,60	1,26%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	24.554.024,02	3,06%	2,00%	5,00%
Total	801.856.520,87	99,95%	45,00	290,00

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
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	268.087.763,46	33,42%	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	135.828.939,92	16,93%	0,03%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	123.573.321,74	15,40%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	113.860.573,24	14,19%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	54.755.166,88	6,83%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	26.317.945,49	3,28%	0,07%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	14.764.710,65	1,84%	3,35%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	12.779.161,66	1,59%	1,78%
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	10.110.338,60	1,26%	5,06%
ZION Invest	8.742.856,05	1,09%	1,78%
Occam Brasil	7.775.091,39	0,97%	0,06%
VINCI PARTNERS	7.182.713,83	0,90%	0,01%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	7.129.910,05	0,89%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	6.993.296,25	0,87%	0,95%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.950.647,26	0,49%	0,19%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BRASIL PLURAL	4.084,40	0,00%	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 LP	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%
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%
IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,76%	10,13%	2,74%	7,11%	15,34%	22,33%	0,20%	1,042%	2,95%
CDI + 3,50% ao ano	0,75%	7,40%	2,46%	4,92%	9,98%	21,35%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	17,45%	-78,34%	-48,80%	-69,48%	-84,66%	-93,30%	0,20%	182,503%	46,03%
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%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	5,10%	1,85%	3,58%	7,18%	14,15%	0,20%	0,115%	0,44%
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%
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 I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,82%	11,42%	2,91%	7,91%	18,25%	24,39%	0,15%	1,080%	3,69%
BRADERCO 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 Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
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%
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%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	1,45%	-0,84%	1,79%	3,54%	8,23%	0,20%	0,044%	3,98%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	1,44%	-0,83%	1,78%	3,51%	8,16%	0,20%	0,044%	3,95%
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%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	2,85%	17,90%	3,34%	9,16%	27,72%	39,42%	1,00%	4,403%	12,04%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	2,58%	18,88%	2,95%	8,79%	31,43%	44,43%	2,00%	4,127%	15,36%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,94%	17,66%	6,99%	13,09%	34,07%	49,86%	2,00%	5,861%	13,81%
OCCAM FIC AÇÕES	0,79%	26,40%	11,64%	17,76%	41,39%	59,18%	3,00%	6,540%	13,35%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,39%	3,96%	1,32%	2,76%	7,38%	-	1,60%	0,041%	1,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,48%	22,10%	6,10%	15,52%	48,78%	55,68%	2,50%	6,000%	15,22%
IBX	3,21%	20,50%	4,25%	10,92%	34,84%	42,73%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1,71%	21,30%	3,60%	12,48%	40,13%	40,18%	2,00%	5,360%	14,65%
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%
IDIV	1,89%	27,02%	7,04%	17,36%	52,83%	44,68%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1,89%	23,81%	4,95%	17,48%	41,88%	31,63%	2,50%	4,912%	12,99%
IPCA + 8,00% ao ano	0,60%	8,58%	2,30%	5,00%	11,09%	25,29%	-	-	-
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,20%	-	-
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-

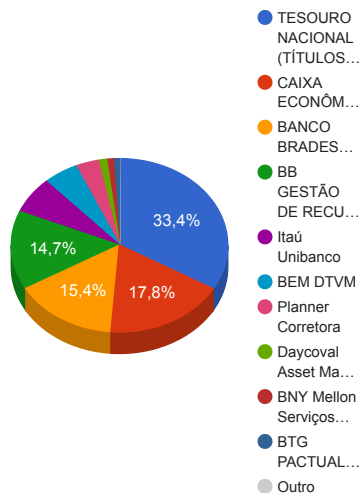
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,51%	13,80%	3,48%	9,25%	19,02%	26,56%	0,50%	0,976%	3,65%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,32%	8,73%	2,25%	5,26%	13,18%	19,89%	1,00%	1,514%	4,15%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,30%	6,51%	2,25%	4,57%	8,42%	16,47%	0,60%	0,833%	0,84%
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%

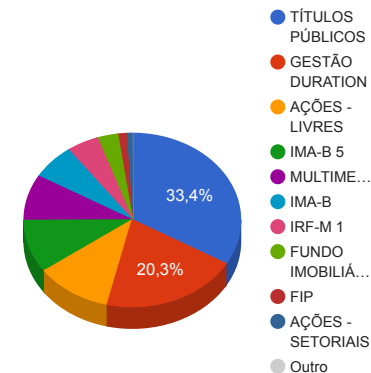
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,43%	27,37%	6,31%	17,10%	56,50%	48,64%	1,72%	6,738%	16,00%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
BRAZILIAN 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	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	268.087.763,46	33,42%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	143.011.653,75	17,83%
BANCO BRADESCO	123.573.321,74	15,40%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	117.811.220,50	14,69%
Itaú Unibanco	54.755.166,88	6,83%
BEM DTVM	41.873.701,01	5,22%
Planner Corretora	27.596.673,01	3,44%
Daycoval Asset Management	10.110.338,60	1,26%
BNY Mellon Serviços Financeiros	7.902.687,47	0,99%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	7.129.910,05	0,89%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	398.763,87	0,05%
GENIAL INVESTIMENTOS	4.084,40	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	268.087.763,46	33,42%
GESTÃO DURATION	162.638.381,40	20,27%
AÇÕES - LIVRES	91.007.980,40	11,34%
IMA-B 5	79.083.548,29	9,86%
MULTIMERCADO	68.166.558,69	8,50%
IMA-B	52.664.332,51	6,56%
IRF-M 1	38.409.599,05	4,79%
FUNDO IMOBILIÁRIO	24.554.024,02	3,06%
FIP	10.110.338,60	1,26%
AÇÕES - SETORIAIS	7.129.910,05	0,89%
DISP. FINANCEIRA	398.763,87	0,05%
FIDC - FECHADO	4.084,40	0,00%



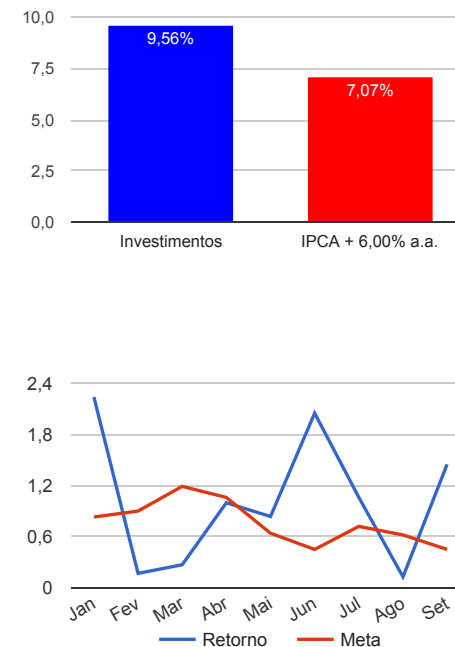
Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7000	3.029,485123	3.546,112806	21.206.395,86	24.822.789,64
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	3.546,112806	29.679.727,38	35.461.128,06
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	3.546,112806	29.808.866,31	35.461.128,06
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	3.546,112806	29.710.101,11	35.461.128,06
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.621,206075	44.449.546,19	54.318.091,13
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.621,206075	38.734.566,65	47.075.678,98
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.621,206075	28.528.215,62	35.487.819,54

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	692.893.064,78	8.215.774,98	1.996.691,35	714.759.218,64	15.647.070,23	2,24%	0,83%	269,13%	2,10%
Fevereiro	714.759.218,64	82.854.012,08	78.787.984,12	720.039.386,61	1.214.140,01	0,17%	0,90%	18,86%	2,51%
Março	720.039.386,61	56.371.812,10	51.173.520,00	727.196.628,33	1.958.949,62	0,27%	1,19%	22,63%	3,76%
Abril	727.196.628,33	5.494.922,73	2.306.000,00	737.669.860,78	7.284.309,72	1,00%	1,06%	94,13%	2,24%
Mai	737.669.860,78	45.591.094,22	37.437.887,36	752.061.163,59	6.238.095,95	0,84%	0,64%	130,55%	3,30%
Junho	752.061.163,59	6.461.848,39	3.317.438,00	770.679.509,04	15.473.935,06	2,05%	0,45%	454,98%	3,01%
Julho	770.679.509,04	6.781.662,56	3.887.000,00	781.781.633,33	8.207.461,73	1,06%	0,72%	146,49%	2,10%
Agosto	781.781.633,33	82.483.623,89	78.436.180,14	786.835.470,56	1.006.393,48	0,13%	0,62%	20,64%	4,01%
Setembro	786.835.470,56	6.045.585,96	2.474.000,00	801.856.520,87	11.449.464,35	1,45%	0,45%	324,38%	2,29%
Acumulado no ano					68.479.820,15	9,56%	7,07%	135,11%	

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(%)
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.477,57	0,00	0,00	4.084,40	606,83	17,45%	182,50%	17,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.292.164,09	0,00	0,00	15.727.624,53	435.460,44	2,85%	1,97%	2,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	64.597.679,44	5.397.000,00	0,00	71.452.767,43	1.458.087,99	2,08%	1,37%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.900.169,59	0,00	0,00	16.189.615,48	289.445,89	1,82%	1,08%	1,82%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	57.265.120,67	0,00	0,00	58.271.861,49	1.006.740,82	1,76%	1,04%	1,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.695.565,27	34.000,00	0,00	13.965.431,80	235.866,53	1,72%	1,01%	1,72%
TÍTULOS PÚBLICOS	263.917.114,32	0,00	0,00	268.087.763,46	4.170.649,14	1,58%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.035.893,08	0,00	0,00	1.051.634,15	15.741,07	1,52%	0,88%	1,52%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	56.848.282,16	4.084,76	0,00	57.694.397,32	842.030,40	1,48%	0,86%	1,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	32.187.639,36	0,00	0,00	32.439.582,50	251.943,14	0,78%	0,30%	0,78%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.560.101,02	0,00	0,00	7.607.062,93	46.961,91	0,62%	0,12%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.823.710,49	0,00	2.474.000,00	6.404.466,78	54.756,29	0,62%	0,12%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.640.523,45	610.501,20	0,00	24.398.069,34	147.044,69	0,61%	0,12%	0,62%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.808.290,00	0,00	0,00	6.846.255,00	37.965,00	0,56%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.317.082,50	0,00	0,00	10.374.495,00	57.412,50	0,56%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.315.770,00	0,00	0,00	10.372.597,50	56.827,50	0,55%	0,04%	0,55%
Total Renda Fixa					9.107.540,14	1,54%	0,86%	

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	10.060.260,20	0,00	0,00	10.404.622,40	344.362,20	3,42%	4,84%	3,42%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	19.091.552,10	0,00	0,00	19.635.981,18	544.429,08	2,85%	4,40%	2,85%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	12.457.615,63	0,00	0,00	12.779.161,66	321.546,03	2,58%	4,13%	2,58%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.762.755,39	0,00	0,00	8.933.175,90	170.420,51	1,94%	5,86%	1,94%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.997.583,63	0,00	0,00	7.129.910,05	132.326,42	1,89%	4,91%	1,89%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.855.225,85	0,00	0,00	2.904.189,94	48.964,09	1,71%	5,36%	1,71%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	13.371.225,75	0,00	0,00	13.573.378,39	202.152,64	1,51%	0,98%	1,51%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	7.081.744,84	0,00	0,00	7.182.713,83	100.968,99	1,43%	6,74%	1,43%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	12.162.748,82	0,00	0,00	12.323.545,60	160.796,78	1,32%	1,51%	1,32%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	11.708.091,44	0,00	0,00	11.860.520,71	152.429,27	1,30%	-	1,30%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	23.636.709,48	0,00	0,00	23.943.850,91	307.141,43	1,30%	0,83%	1,30%
OCCAM FIC AÇÕES	7.714.147,93	0,00	0,00	7.775.091,39	60.943,46	0,79%	6,54%	0,79%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.410.909,61	0,00	0,00	9.482.082,12	71.172,51	0,76%	8,05%	0,76%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	5.901.520,63	0,00	0,00	5.941.662,10	40.141,47	0,68%	0,25%	0,68%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	4.464.131,94	0,00	0,00	4.481.434,22	17.302,28	0,39%	0,04%	0,39%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	7.897.475,30	0,00	0,00	7.902.687,47	5.212,17	0,07%	1,13%	0,07%
LA SHOPPING CENTERS MULTIELABRATÉGIA FIP	10.126.489,92	0,00	0,00	10.110.338,60	-16.151,32	-0,16%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.967.856,40	0,00	0,00	11.910.961,98	-56.894,42	-0,48%	6,00%	-0,48%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	8.914.284,60	0,00	0,00	8.742.856,05	-171.428,55	-1,92%	31,40%	-1,92%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.044.558,09	0,00	0,00	3.950.647,26	-93.910,83	-2,32%	-	0,00%
Total Renda Variável					2.341.924,21	1,18%	5,01%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	264.601.271,61	0,00	3.615.665,56	268.087.763,46	7.102.157,41	2,71%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	53.791.537,35	15.686.076,85	0,00	71.452.767,43	1.975.153,23	2,98%	3,11%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	55.055.036,20	1.226.804,74	0,00	57.694.397,32	1.412.556,38	2,52%	2,53%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	57.394.775,66	0,00	58.271.861,49	877.085,83	1,53%	2,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	31.784.863,76	0,00	0,00	32.439.582,50	654.718,74	2,06%	2,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.132.056,06	31.000,00	0,00	15.727.624,53	564.568,47	3,72%	3,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.139.812,11	0,00	412.401,35	16.189.615,48	462.204,72	2,91%	2,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.355.644,89	610.501,20	0,00	24.398.069,34	431.923,25	1,83%	1,85%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	56.979.734,75	0,00	57.390.715,57	0,00	410.980,82	0,72%	1,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.549.768,01	988.109,23	9.343.000,00	6.404.466,78	209.589,54	1,79%	1,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	13.757.939,17	0,00	13.965.431,80	207.492,63	1,51%	2,74%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.462.755,00	0,00	285.974,25	10.374.495,00	197.714,25	1,90%	-0,84%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.459.777,50	0,00	283.000,03	10.372.597,50	195.820,03	1,89%	-0,83%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.468.953,46	0,00	0,00	7.607.062,93	138.109,47	1,85%	1,85%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.901.950,00	0,00	186.385,56	6.846.255,00	130.690,56	1,91%	-0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	13.183.582,61	0,00	13.280.037,82	0,00	96.455,21	0,73%	1,50%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.028.713,82	0,00	0,00	1.051.634,15	22.920,33	2,23%	2,23%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.976,94	0,00	0,00	4.084,40	-3.892,54	-48,80%	-48,80%
Total Renda Fixa					15.086.248,33	2,58%	

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 (%)
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	8.938.732,87	0,00	0,00	10.110.338,60	1.171.605,73	13,11%	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8.433.585,17	0,00	0,00	9.482.082,12	1.048.496,95	12,43%	12,43%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7.613.303,99	2.000.000,00	0,00	10.404.622,40	791.318,41	9,05%	8,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.226.636,67	0,00	0,00	11.910.961,98	684.325,31	6,10%	6,10%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	19.000.903,57	0,00	0,00	19.635.981,18	635.077,61	3,34%	3,34%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.349.366,70	0,00	0,00	8.933.175,90	583.809,20	6,99%	6,99%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	23.416.557,61	0,00	0,00	23.943.850,91	527.293,30	2,25%	2,25%
OCCAM FIC AÇÕES	3.636.109,16	3.615.665,56	0,00	7.775.091,39	523.316,67	10,59%	11,64%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	13.117.006,30	0,00	0,00	13.573.378,39	456.372,09	3,48%	3,48%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	6.756.511,33	0,00	0,00	7.182.713,83	426.202,50	6,31%	6,31%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	12.413.074,78	0,00	0,00	12.779.161,66	366.086,88	2,95%	2,95%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.793.863,85	0,00	0,00	7.129.910,05	336.046,20	4,95%	4,95%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	12.052.027,35	0,00	0,00	12.323.545,60	271.518,25	2,25%	2,25%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	7.759.469,96	0,00	0,00	7.902.687,47	143.217,51	1,85%	1,85%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.803.142,28	0,00	0,00	2.904.189,94	101.047,66	3,60%	3,60%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	5.854.462,26	0,00	0,00	5.941.662,10	87.199,84	1,49%	1,49%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	4.423.040,53	0,00	0,00	4.481.434,22	58.393,69	1,32%	1,32%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	12.327.845,36	0,00	0,00	11.860.520,71	-467.324,65	-3,79%	0,00%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.631.865,08	0,00	0,00	3.950.647,26	-681.217,82	-14,71%	0,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	10.228.570,15	0,00	0,00	8.742.856,05	-1.485.714,10	-14,53%	-14,53%
Total Renda Variável					5.577.071,23	2,90%	