

# 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 LP	D+0	Não há	277.493,58	0,29%	313	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.312.607,88	3,43%	913	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.826.075,50	13,30%	963	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.760.981,23	3,90%	937	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.274.262,63	2,36%	1.389	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.529.780,09	2,62%	876	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.151.685,42	1,19%	267	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.691.315,92	1,75%	95	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	799.135,25	0,83%	334	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.282.743,10	11,70%	681	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.629.836,37	7,91%	643	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.295.198,96	15,86%	114	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	401.136,26	0,42%	350	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.514.749,74	9,86%	271	0,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	274.595,36	0,28%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	893.633,59	0,93%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.056.640,53	4,21%	140	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.396,60	0,01%	110	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.650.694,87	7,93%	114	0,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	5.839,66	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.844.610,15	1,91%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	781.343,89	0,81%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

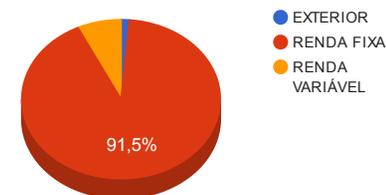
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	1.211.100,79	1,26%	207	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	-0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.041.974,59	3,15%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.648.129,96	2,75%		5,74%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	D+4	Não há	1.290.697,78	1,34%	67	0,22%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total</b>			<b>96.452.659,71</b>				

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

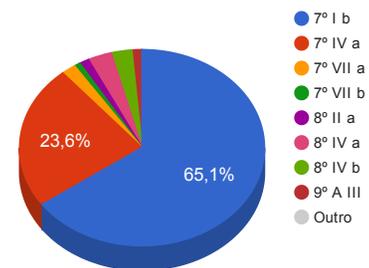
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	62.831.115,93	65,14%	15,00%	25,00%	70,00%	4.685.745,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	57.871.595,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	22.797.846,95	23,64%	10,00%	30,00%	40,00%	15.783.216,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.850.449,81	1,92%	2,00%	4,00%	5,00%	2.972.183,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	781.343,89	0,81%	0,00%	1,00%	5,00%	4.041.289,10
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.211.100,79	1,26%	2,00%	10,00%	20,00%	18.079.431,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	2,00%	10,00%	10,00%	9.645.265,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.041.974,59	3,15%	2,00%	5,00%	5,00%	1.780.658,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.648.129,96	2,75%	2,00%	5,00%	5,00%	2.174.503,03
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.290.697,78	1,34%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.290.697,78
<b>Total Carteira</b>		<b>96.452.659,71</b>					

EXTERIOR	1.290.697,78	1,34%
RENDA FIXA	88.260.756,58	91,51%
RENDA VARIÁVEL	6.901.205,35	7,16%

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 "	62.831.115,93	65,14%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.797.846,95	23,64%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.850.449,81	1,92%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	781.343,89	0,81%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.211.100,79	1,26%	2,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.041.974,59	3,15%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.648.129,96	2,75%	2,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	1.290.697,78	1,34%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>96.452.659,71</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>240,00</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
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	31.464.169,35	32,62%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.371.954,97	32,53%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.126.408,18	25,01%	0,00%
ROMA ASSET	3.041.974,59	3,15%	40,08%
Reditus Investimentos	2.648.129,96	2,75%	-
PETRA Capital	1.844.610,15	1,91%	0,03%
Elleven Gestora de Recursos	1.168.228,95	1,21%	6,24%
SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS	781.343,89	0,81%	8,35%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	5.839,67	0,01%	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%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,84%	19,23%	3,68%	13,06%	30,92%	34,05%	0,30%	1,966%	7,31%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,83%	19,23%	3,68%	13,05%	30,90%	33,78%	0,20%	1,966%	7,31%
IRF-M 1+	1,87%	11,89%	3,27%	9,07%	20,81%	27,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,85%	11,58%	3,21%	8,89%	20,82%	26,68%	0,20%	1,217%	4,71%
IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
BRADESCO 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%
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%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,91%	3,19%	0,76%	4,62%	2,72%	-5,42%	0,70%	3,452%	4,73%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,90%	2,71%	3,78%	5,48%	4,83%	-17,18%	0,70%	2,139%	4,78%
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%

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 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%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,57%	9,85%	3,00%	7,50%	16,36%	25,24%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,53%	9,69%	2,87%	7,44%	16,19%	24,51%	0,20%	0,843%	3,00%
CDI + 3,50% ao ano	0,75%	7,40%	2,46%	4,92%	9,98%	21,35%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	14,10%	-18,04%	19,29%	-9,95%	-29,83%	-38,78%	0,20%	48,281%	51,95%
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%
BRADESCO 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%
SELIC	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,35%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,46%	4,62%	1,52%	3,08%	6,20%	13,18%	0,20%	0,009%	0,12%
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,30%	2,89%	0,99%	1,96%	-18,22%	-15,71%	1,00%	0,037%	21,27%
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%
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%

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
BRADESCO 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 Variável e Benchmark's - base (setembro / 2019)

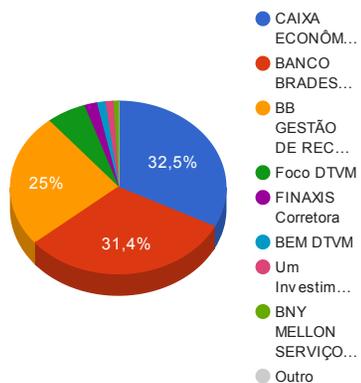
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-	-
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	0,35%	16,71%	4,89%	11,13%	32,02%	51,15%	1,50%	5,462%	11,91%
IFIX	1,04%	14,15%	2,21%	8,11%	25,74%	20,86%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	20,51%	-2,08%	13,25%	17,50%	4,62%	1,50%	0,000%	23,90%
IPCA + 8,00% ao ano	0,60%	8,58%	2,30%	5,00%	11,09%	25,29%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	3,26%	45,12%	10,57%	23,57%	62,86%	-104,29%	0,12%	0,170%	2,44%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

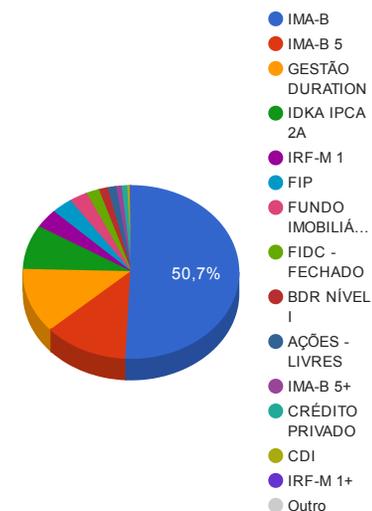
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	2,71%	28,17%	10,43%	13,08%	6,23%	62,44%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	2,66%	27,41%	10,26%	12,74%	5,65%	58,09%	0,70%	5,841%	23,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.371.954,97	32,53%
BANCO BRADESCO	30.253.068,56	31,37%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.126.408,18	25,01%
Foco DTVM	5.690.104,55	5,90%
FINAXIS Corretora	1.844.610,15	1,91%
BEM DTVM	1.211.100,79	1,26%
Um Investimentos	1.168.228,95	1,21%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	781.343,89	0,81%
Genial Investimentos	5.839,66	0,01%
Única Administradora	0,01	0,00%



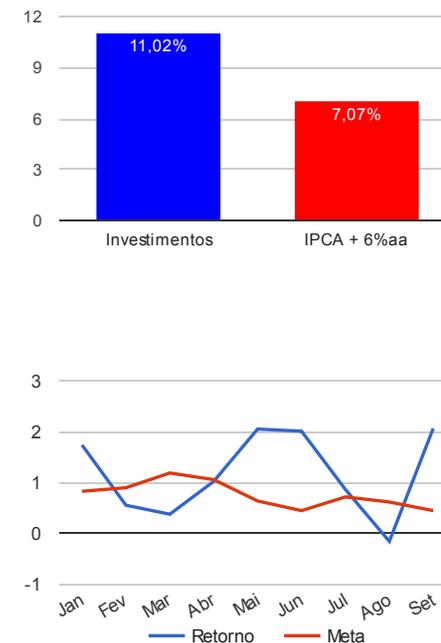
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	48.925.163,90	50,72%
IMA-B 5	12.131.531,70	12,58%
GESTÃO DURATION	11.686.476,90	12,12%
IDKA IPCA 2A	7.982.077,24	8,28%
IRF-M 1	3.425.948,05	3,55%
FIP	3.041.974,59	3,15%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.648.129,96	2,75%
FIDC - FECHADO	1.850.449,81	1,92%
BDR NÍVEL I	1.290.697,78	1,34%
AÇÕES - LIVRES	1.211.100,79	1,26%
IMA-B 5+	799.135,25	0,83%
CRÉDITO PRIVADO	781.343,89	0,81%
CDI	401.136,26	0,42%
IRF-M 1+	277.493,58	0,29%
MULTIMERCADO	0,01	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	78.828.877,72	1.233.485,47	1.621.374,10	79.813.128,50	1.372.139,41	1,74%	0,83%	209,31%	1,92%
Fevereiro	79.813.128,50	10.743.516,43	10.644.425,35	80.356.708,12	444.488,54	0,56%	0,90%	62,11%	1,51%
Março	80.356.708,12	2.401.763,05	1.537.803,44	81.528.777,96	308.110,23	0,38%	1,19%	31,78%	2,58%
Abril	81.528.777,96	2.071.482,80	1.708.070,68	82.732.328,13	840.138,05	1,03%	1,06%	96,83%	1,21%
Mai	82.732.328,13	1.741.188,91	1.680.280,94	84.493.611,71	1.700.375,61	2,05%	0,64%	320,57%	1.499.950,64%
Junho	84.493.611,71	4.824.713,34	3.348.779,30	87.698.989,88	1.729.444,13	2,01%	0,45%	446,71%	1,75%
Julho	87.698.989,88	1.585.010,81	1.737.833,64	88.304.917,52	758.750,47	0,87%	0,72%	119,46%	1,13%
Agosto	88.304.917,52	1.940.905,02	1.745.404,14	88.364.321,13	-136.097,27	-0,15%	0,62%	-24,78%	2,09%
Setembro	88.364.321,13	2.608.906,92	1.756.267,12	91.060.972,90	1.844.011,97	2,07%	0,45%	462,85%	1,59%
Acumulado no ano					8.861.361,14	11,02%	7,07%	155,86%	

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 II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.117,93	0,00	0,00	5.839,66	721,73	14,10%	48,28%	14,10%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	770.566,61	0,00	0,00	799.135,25	28.568,64	3,71%	2,78%	3,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.216,41	0,00	0,00	6.396,60	180,19	2,90%	2,01%	2,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.970.350,83	0,00	0,00	11.282.743,10	312.392,27	2,85%	1,97%	2,85%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.252.083,72	0,00	0,00	9.514.749,74	262.666,02	2,84%	1,97%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.184.318,60	1.304.453,46	0,00	12.826.075,50	337.303,44	2,70%	1,98%	2,85%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	13.589.365,09	1.304.453,46	0,00	15.295.198,96	401.380,41	2,69%	1,97%	2,83%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.471.564,71	0,00	0,00	7.629.836,37	158.271,66	2,12%	1,37%	2,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	272.440,17	0,00	0,00	277.493,58	5.053,41	1,85%	1,22%	1,85%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.518.516,72	0,00	0,00	7.650.694,87	132.178,15	1,76%	1,04%	1,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.256.590,50	0,00	0,00	3.312.607,88	56.017,38	1,72%	1,01%	1,72%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.997.435,53	0,00	0,00	4.056.640,53	59.205,00	1,48%	0,86%	1,48%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.532.252,40	0,00	878.133,56	1.691.315,92	37.197,08	1,47%	0,84%	1,53%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.746.470,17	0,00	38.819,84	3.760.981,23	53.330,90	1,42%	0,82%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.494.549,46	0,00	0,00	2.529.780,09	35.230,63	1,41%	0,89%	1,41%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	272.128,12	0,00	0,00	274.595,36	2.467,24	0,91%	3,45%	0,91%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	885.679,91	0,00	0,00	893.633,59	7.953,68	0,90%	2,14%	0,90%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.183.194,21	0,00	38.819,84	1.151.685,42	7.311,05	0,62%	0,12%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.133.650,23	0,00	878.133,56	2.274.262,63	18.745,96	0,60%	0,12%	0,63%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	399.311,94	0,00	0,00	401.136,26	1.824,32	0,46%	0,01%	0,46%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	778.999,27	0,00	0,00	781.343,89	2.344,62	0,30%	0,04%	0,30%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.847.428,56	0,00	0,00	1.844.610,15	-2.818,41	-0,15%	0,05%	-0,15%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.917.525,37</b>	<b>2,22%</b>	<b>1,52%</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(%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.206.927,86	0,00	0,00	1.211.100,79	4.172,93	0,35%	5,46%	0,35%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,17%	3,26%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.042.815,56	0,00	0,00	3.041.974,59	-840,97	-0,03%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.652.104,95	0,00	0,00	2.648.129,96	-3.974,99	-0,15%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-643,03</b>	<b>-0,01%</b>	<b>1,71%</b>	

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(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.257.242,02	0,00	0,00	1.290.697,78	33.455,76	2,66%	5,84%	2,66%
				Total Exterior	33.455,76	2,66%	5,84%	

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.741.146,33	3.067.411,38	0,00	15.295.198,96	486.641,25	3,43%	3,68%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.352.998,76	3.067.411,37	0,00	12.826.075,50	405.665,37	3,44%	3,72%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.877.556,35	0,00	0,00	11.282.743,10	405.186,75	3,72%	3,72%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.177.249,78	0,00	0,00	9.514.749,74	337.499,96	3,68%	3,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.399.362,94	0,00	0,00	7.629.836,37	230.473,43	3,11%	3,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.446.533,75	0,00	0,00	7.650.694,87	204.161,12	2,74%	2,74%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.956.649,62	0,00	0,00	4.056.640,53	99.990,91	2,53%	2,53%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.823.059,92	0,00	154.233,22	3.760.981,23	92.154,53	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.224.907,77	0,00	0,00	3.312.607,88	87.700,11	2,72%	2,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.821.538,63	0,00	2.619.752,45	2.274.262,63	72.476,45	1,81%	1,86%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.499.237,17	0,00	878.133,56	1.691.315,92	70.212,31	2,81%	2,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.468.995,85	0,00	0,00	2.529.780,09	60.784,24	2,46%	2,46%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.009.545,98	0,00	1.895.852,11	1.151.685,42	37.991,55	1,80%	1,85%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	765.281,62	0,00	0,00	799.135,25	33.853,63	4,42%	4,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	268.873,07	0,00	0,00	277.493,58	8.620,51	3,21%	3,21%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	773.709,39	0,00	0,00	781.343,89	7.634,50	0,99%	0,99%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	886.830,30	0,00	0,00	893.633,59	6.803,29	0,77%	3,78%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	395.118,69	0,00	0,00	401.136,26	6.017,57	1,52%	1,52%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	272.531,79	0,00	0,00	274.595,36	2.063,57	0,76%	0,76%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.895,17	0,00	0,00	5.839,66	944,49	19,29%	19,29%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.168,17	0,00	0,00	6.396,60	228,43	3,70%	3,70%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.972.972,42	0,00	0,00	1.844.610,15	-128.362,27	-6,51%	-6,51%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.528.741,70</b>	<b>2,95%</b>	

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 (%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.154.626,89	0,00	0,00	1.211.100,79	56.473,90	4,89%	4,89%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	10,57%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.044.563,40	0,00	0,00	3.041.974,59	-2.588,81	-0,09%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.725.078,93	0,00	0,00	2.648.129,96	-76.948,97	-2,82%	-2,08%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-23.063,88</b>	<b>1,20%</b>	

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 (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.170.623,96	0,00	0,00	1.290.697,78	120.073,82	10,26%	10,26%
				<b>Total Exterior</b>	120.073,82	10,26%	