

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.307.890,45	2,57%	963	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.038.684,81	10,05%	419	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.279.263,10	1,42%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.476.210,75	2,75%	1.389	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.527.391,37	1,70%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.362.503,62	8,19%	937	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.378.473,00	1,53%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.147.929,78	1,28%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	16.868.549,89	18,76%	643	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.816.236,97	8,69%	913	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	102.358,72	0,11%	1.212	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	80.190,99	0,09%	876	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	798.868,50	0,89%	681	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	809.480,78	0,90%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.192.665,17	1,33%	302	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	D+1	Não há	343.056,62	0,38%	198	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.927.830,50	5,48%		0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.485.264,95	1,65%	350	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.152.945,44	1,28%	758	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.238.016,97	2,49%	62	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.617,14	0,00%	695	0,00%	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	1.181.423,05	1,31%	74	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

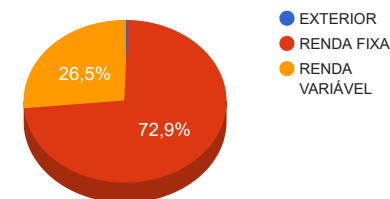
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.493.075,05	1,66%	95	0,34%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.119.843,68	1,25%	6	1,75%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.551.340,78	1,73%	152	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.240.465,10	3,60%	6.172	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	586.086,29	0,65%	55.951	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.844.925,62	3,16%	2.581	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.603.641,36	4,01%	2.880	1,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	1.751.127,22	1,95%	188	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23 DU	Não há	1.045.686,07	1,16%	72	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.137.971,20	1,27%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.241.588,40	2,49%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	3.000.223,72	3,34%	214	0,57%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	237.038,84	0,26%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	536.672,79	0,60%	67	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total			89.907.538,69				

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

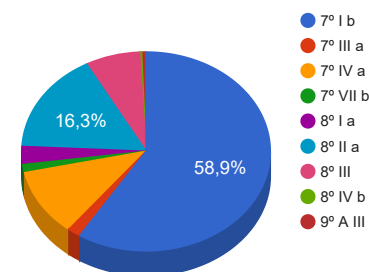
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	52.994.032,73	58,94%	15,00%	27,00%	90,00%	27.922.752,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.535.721,79	1,71%	0,00%	10,00%	60,00%	52.408.801,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	9.806.675,00	10,91%	10,00%	30,00%	40,00%	26.156.340,48
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.495.376,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.181.423,05	1,31%	0,00%	2,00%	5,00%	3.313.953,88
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.612.918,73	2,91%	0,00%	5,00%	10,00%	6.377.835,14
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	14.623.272,44	16,26%	0,00%	10,00%	20,00%	3.358.235,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.379.783,32	7,10%	0,00%	10,00%	10,00%	2.610.970,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	4.495.376,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	237.038,84	0,26%	0,00%	2,00%	5,00%	4.258.338,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	899.075,39
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	536.672,79	0,60%	0,00%	1,00%	5,00%	3.958.704,14
Total Carteira		89.907.538,69					

EXTERIOR	536.672,79	0,60%
RENDA FIXA	65.517.852,57	72,87%
RENDA VARIÁVEL	23.853.013,33	26,53%

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%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	52.994.032,73	58,94%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.535.721,79	1,71%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	9.806.675,00	10,91%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	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 "	1.181.423,05	1,31%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.612.918,73	2,91%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	14.623.272,44	16,26%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.379.783,32	7,10%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	237.038,84	0,26%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 9º - A, Inciso III	536.672,79	0,60%	0,00%	5,00%
Total	89.907.538,69	100,00%	25,00	291,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	66.512.783,85	73,98%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.253.681,49	10,29%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	8.185.101,25	9,10%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	4.330.190,57	4,82%	0,00%
VINCI PARTNERS	1.045.686,07	1,16%	0,00%
SICREDI	343.056,62	0,38%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	237.038,84	0,26%	0,01%

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	2,86%	19,55%	3,77%	13,27%	31,37%	34,72%	-	-	-
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%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,85%	19,20%	3,70%	13,01%	30,87%	34,20%	0,20%	1,977%	7,24%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,20%	8,63%	0,39%	7,10%	17,53%	14,83%	0,20%	1,465%	7,91%
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%
IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
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%
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%
IRF-M	1,44%	9,99%	2,81%	7,53%	16,83%	23,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	9,69%	2,73%	7,34%	16,76%	22,99%	0,20%	0,817%	3,46%
IRF-M 1	0,64%	5,31%	1,92%	3,72%	7,44%	14,70%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,70%	5,39%	1,94%	3,83%	7,52%	14,63%	0,20%	0,180%	0,50%
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%

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
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,48%	4,67%	1,54%	3,11%	6,24%	13,16%	0,20%	0,028%	0,12%
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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	4,55%	1,49%	3,02%	6,13%	13,00%	0,20%	0,007%	0,12%
SELIC	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,35%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,46%	4,62%	1,52%	3,08%	6,20%	13,18%	0,20%	0,009%	0,12%
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	7,07%	1,80%	4,01%	9,04%	20,73%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,67%	10,64%	2,73%	7,32%	16,87%	33,32%	0,20%	0,983%	3,35%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	1,39%	-0,88%	1,77%	3,50%	8,13%	0,20%	0,044%	4,04%
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 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%
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%

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3,52%	18,71%	3,60%	9,53%	31,29%	39,55%	0,50%	4,992%	14,33%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3,42%	28,77%	8,98%	20,27%	46,74%	60,66%	1,90%	4,841%	14,23%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2,15%	24,76%	2,35%	10,50%	55,71%	-	2,00%	4,601%	23,33%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1,72%	35,36%	9,44%	20,30%	69,55%	52,78%	2,00%	7,093%	20,50%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,43%	27,37%	6,31%	17,10%	56,50%	48,64%	1,72%	6,738%	16,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,85%	6,35%	1,98%	4,70%	12,06%	-	1,60%	0,381%	2,65%
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%
IGCT	3,14%	20,58%	4,43%	11,19%	37,38%	43,52%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	3,07%	19,97%	4,21%	10,77%	36,54%	42,23%	0,90%	4,740%	14,74%
ICON	2,64%	42,35%	17,30%	33,49%	54,64%	29,25%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2,51%	41,47%	17,48%	33,38%	52,49%	23,87%	1,60%	6,438%	16,65%
IDIV	1,89%	27,02%	7,04%	17,36%	52,83%	44,68%	-	-	-
BRABESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,78%	13,62%	1,20%	6,19%	29,40%	40,71%	1,50%	5,179%	12,92%
IFIX	1,04%	14,15%	2,21%	8,11%	25,74%	20,86%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-

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

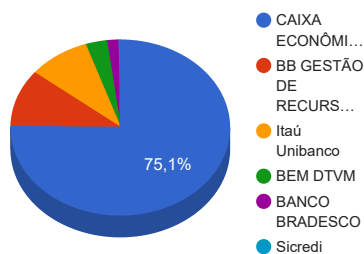
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,30%	6,51%	2,25%	4,57%	8,42%	16,47%	0,60%	0,833%	0,84%

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

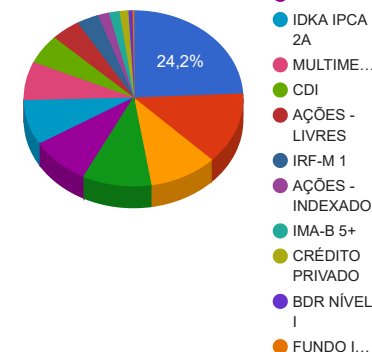
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	2,71%	28,17%	10,43%	13,08%	6,23%	62,44%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2,66%	27,41%	10,26%	12,74%	5,65%	58,09%	0,70%	5,841%	23,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	67.558.469,92	75,14%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.490.720,33	10,56%
Itaú Unibanco	8.185.101,25	9,10%
BEM DTVM	2.844.925,62	3,16%
BANCO BRADESCO	1.485.264,95	1,65%
Sicredi	343.056,62	0,38%



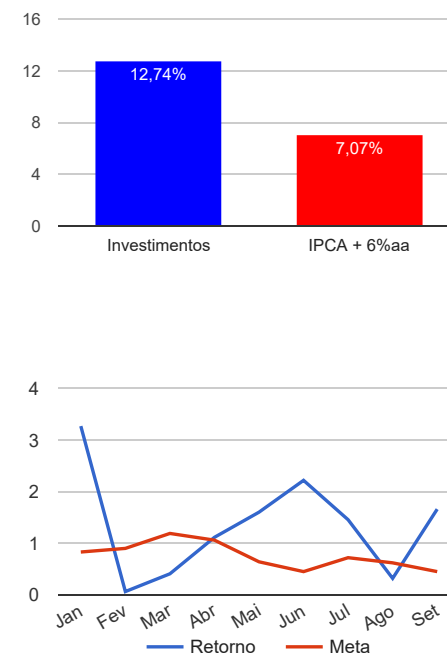
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	21.796.380,39	24,24%
AÇÕES - SETORIAIS	11.854.561,83	13,19%
IRF-M	9.038.684,81	10,05%
IMA-B 5	8.964.166,75	9,97%
IMA-B	7.915.559,37	8,80%
IDKA IPCA 2A	7.442.694,61	8,28%
MULTIMERCADO	6.379.783,32	7,10%
CDI	4.878.844,50	5,43%
AÇÕES - LIVRES	3.888.554,29	4,33%
IRF-M 1	2.921.626,09	3,25%
AÇÕES - INDEXADO	1.493.075,05	1,66%
IMA-B 5+	1.378.473,00	1,53%
CRÉDITO PRIVADO	1.181.423,05	1,31%
BDR NÍVEL I	536.672,79	0,60%
FUNDO IMOBILIÁRIO	237.038,84	0,26%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	80.445.558,00	1.132.453,93	2.697.847,21	81.511.600,07	2.631.435,35	3,27%	0,83%	393,34%	2,09%
Fevereiro	81.511.600,07	7.523.087,89	6.241.455,76	82.845.672,69	52.440,49	0,06%	0,90%	7,07%	2,57%
Março	82.845.672,69	1.690.098,38	2.423.381,46	82.449.984,44	337.594,83	0,41%	1,19%	34,14%	3,51%
Abril	82.449.984,44	3.101.558,79	2.930.697,93	83.541.954,06	921.108,76	1,11%	1,06%	105,22%	1,99%
Mai	83.541.954,06	6.457.581,22	6.220.787,61	85.121.083,24	1.342.335,57	1,60%	0,64%	250,09%	2,28%
Junho	85.121.083,24	3.192.211,70	3.012.029,79	87.194.189,63	1.892.924,48	2,22%	0,45%	492,76%	2,12%
Julho	87.194.189,63	3.657.107,79	4.747.191,23	87.373.372,00	1.269.265,81	1,46%	0,72%	200,99%	1,70%
Agosto	87.373.372,00	5.164.990,88	4.869.069,46	87.948.854,62	279.561,20	0,32%	0,62%	51,39%	3,21%
Setembro	87.948.854,62	4.122.826,01	3.632.974,99	89.907.538,69	1.468.833,05	1,66%	0,45%	371,92%	1,88%
Acumulado no ano					10.195.499,54	12,74%	7,07%	180,14%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.243.914,56	0,00	0,00	2.307.890,45	63.975,89	2,85%	1,98%	2,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	776.749,74	0,00	0,00	798.868,50	22.118,76	2,85%	1,97%	2,85%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.159.652,86	0,00	0,00	1.192.665,17	33.012,31	2,85%	1,98%	2,85%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.251.779,69	0,00	0,00	1.279.263,10	27.483,41	2,20%	1,47%	2,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	16.518.632,34	0,00	0,00	16.868.549,89	349.917,55	2,12%	1,37%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	795.008,48	0,00	0,00	809.480,78	14.472,30	1,82%	1,08%	1,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.684.061,63	0,00	0,00	7.816.236,97	132.175,34	1,72%	1,01%	1,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.502.375,66	0,00	0,00	1.527.391,37	25.015,71	1,67%	0,98%	1,67%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.162.171,75	0,00	0,00	1.181.423,05	19.251,30	1,66%	0,93%	1,66%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.911.831,93	0,00	0,00	9.038.684,81	126.852,88	1,42%	0,82%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	79.074,22	0,00	0,00	80.190,99	1.116,77	1,41%	0,89%	1,41%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.135.883,26	124.931,28	0,00	7.362.503,62	101.689,08	1,40%	0,82%	1,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.889.558,34	0,00	0,00	4.927.830,50	38.272,16	0,78%	0,30%	0,78%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	340.660,71	0,00	0,00	343.056,62	2.395,91	0,70%	0,18%	0,70%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.139.944,33	0,00	0,00	1.147.929,78	7.985,45	0,70%	0,44%	0,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	101.728,66	0,00	0,00	102.358,72	630,06	0,62%	0,12%	0,62%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.370.766,00	0,00	0,00	1.378.473,00	7.707,00	0,56%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.227.429,90	0,00	0,00	2.238.016,97	10.587,07	0,48%	0,03%	0,48%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.478.510,14	0,00	0,00	1.485.264,95	6.754,81	0,46%	0,01%	0,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.147.825,04	0,00	0,00	1.152.945,44	5.120,40	0,45%	0,01%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	937.312,29	2.040,00	940.000,00	2.617,14	3.264,85	0,35%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.094.830,06	3.019.224,26	2.654.304,92	2.476.210,75	16.461,35	0,32%	0,12%	0,63%
Total Renda Fixa					1.016.260,36	1,56%	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(%)
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	242.673,49	0,00	38.670,07	237.038,84	33.035,42	13,61%	-	0,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.442.367,68	0,00	0,00	1.493.075,05	50.707,37	3,52%	4,99%	3,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	566.688,57	0,00	0,00	586.086,29	19.397,72	3,42%	4,84%	3,42%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.086.500,96	0,00	0,00	1.119.843,68	33.342,72	3,07%	4,74%	3,07%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.768.066,43	0,00	0,00	2.844.925,62	76.859,19	2,78%	5,18%	2,78%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	3.161.255,31	0,00	0,00	3.240.465,10	79.209,79	2,51%	6,44%	2,51%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.542.772,78	0,00	0,00	3.603.641,36	60.868,58	1,72%	7,09%	1,72%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.030.986,63	0,00	0,00	1.045.686,07	14.699,44	1,43%	6,74%	1,43%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.961.738,14	0,00	0,00	3.000.223,72	38.485,58	1,30%	0,83%	1,30%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	753.269,65	976.630,47	0,00	1.751.127,22	21.227,10	1,23%	4,60%	2,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.128.386,64	0,00	0,00	1.137.971,20	9.584,56	0,85%	0,38%	0,85%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.232.933,89	0,00	0,00	2.241.588,40	8.654,51	0,39%	0,04%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.558.750,99	0,00	0,00	1.551.340,78	-7.410,21	-0,48%	6,00%	-0,48%
Total Renda Variável					438.661,77	1,87%	4,41%	

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 FI AÇÕES	522.761,87	0,00	0,00	536.672,79	13.910,92	2,66%	5,84%	2,66%
				Total Exterior	13.910,92	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 (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.362.732,26	477.335,77	1.500.000,00	16.868.549,89	528.481,86	3,14%	3,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.798.611,27	0,00	0,00	9.038.684,81	240.073,54	2,73%	2,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.609.304,88	0,00	0,00	7.816.236,97	206.932,09	2,72%	2,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.799.348,92	370.964,75	2.000.000,00	7.362.503,62	192.189,95	2,45%	2,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.347.465,46	1.500.000,00	0,00	4.927.830,50	80.365,04	1,95%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	244.807,49	2.000.000,00	0,00	2.307.890,45	63.082,96	2,81%	3,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.439.559,57	6.837.744,41	7.853.036,43	2.476.210,75	51.943,20	1,11%	1,86%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.150.142,39	0,00	0,00	1.192.665,17	42.522,78	3,70%	3,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.525.245,93	0,00	38.874,24	1.527.391,37	41.019,68	2,73%	2,73%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.274.260,02	0,00	35.237,24	1.279.263,10	40.240,32	3,22%	0,39%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.203.988,95	0,00	0,00	2.238.016,97	34.028,02	1,54%	1,54%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.151.219,95	0,00	0,00	1.181.423,05	30.203,10	2,62%	2,62%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	770.179,47	0,00	0,00	798.868,50	28.689,03	3,72%	3,72%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.390.682,00	0,00	38.733,70	1.378.473,00	26.524,70	1,92%	-0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	806.990,61	0,00	20.620,07	809.480,78	23.110,24	2,91%	2,91%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.462.984,02	0,00	0,00	1.485.264,95	22.280,93	1,52%	1,52%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.159.678,11	0,00	31.000,19	1.147.929,78	19.251,86	1,68%	-1,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.031.880,20	104.971,13	0,00	1.152.945,44	16.094,11	1,47%	1,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.031.419,07	97.369,77	1.139.313,74	2.617,14	13.142,04	1,34%	1,50%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	306.878,93	29.908,38	0,00	343.056,62	6.269,31	1,89%	1,94%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	78.264,21	0,00	0,00	80.190,99	1.926,78	2,46%	2,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	100.502,79	0,00	0,00	102.358,72	1.855,93	1,85%	1,85%
				Total Renda Fixa	1.710.227,47	2,65%	

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 (%)
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.758.263,25	0,00	0,00	3.240.465,10	482.201,85	17,48%	17,48%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.292.734,46	0,00	0,00	3.603.641,36	310.906,90	9,44%	9,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.462.210,98	0,00	0,00	1.551.340,78	89.129,80	6,10%	6,10%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.934.152,57	0,00	0,00	3.000.223,72	66.071,15	2,25%	2,25%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	983.637,92	0,00	0,00	1.045.686,07	62.048,15	6,31%	6,31%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.441.181,66	0,00	0,00	1.493.075,05	51.893,39	3,60%	3,60%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.620.080,12	0,00	550.000,00	1.119.843,68	49.763,56	4,11%	4,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	550.000,00	0,00	586.086,29	36.086,29	6,56%	8,98%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.811.073,40	0,00	0,00	2.844.925,62	33.852,22	1,20%	1,20%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.212.380,20	0,00	0,00	2.241.588,40	29.208,20	1,32%	1,32%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	751.803,79	976.630,47	0,00	1.751.127,22	22.692,96	1,42%	2,35%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.115.866,84	0,00	0,00	1.137.971,20	22.104,36	1,98%	1,98%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	277.911,90	0,00	42.420,07	237.038,84	1.547,01	0,65%	0,00%
Total Renda Variável					1.257.505,84	5,82%	

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 FI AÇÕES	486.746,04	0,00	0,00	536.672,79	49.926,75	10,26%	10,26%
				Total Exterior	49.926,75	10,26%	