

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2019

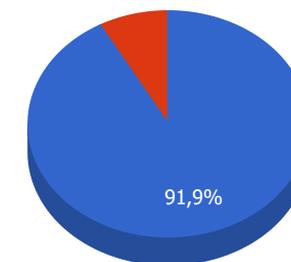
Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	206.202,99	0,12%	681	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	35.702,85	0,02%	313	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.088.730,84	4,23%	1.212	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	115.848,69	0,07%	702	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	29.675.575,12	17,71%	937	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	29.956.043,95	17,87%	1.389	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	159.534,07	0,10%	334	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	30.698.520,58	18,32%	643	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	25.000,00	0,01%	15.892	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.955.183,18	3,55%	92	2,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	23.771.090,96	14,18%	11	22,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	26.323.485,65	15,71%	758	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	23.068,06	0,01%	25.060	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	4.282.067,74	2,56%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	Não se ...	Não se aplica	4.198.023,90	2,50%		3,32%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1801	90 dias	5.079.378,59	3,03%	10	5,23%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			167.593.457,17				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			18.553,61				Artigo 6º
PL Total			167.612.010,78				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	97.936.159,09	58,44%	15,00%	25,00%	80,00%	36.138.606,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	100.556.074,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	56.097.827,85	33,47%	10,00%	30,00%	40,00%	10.939.555,02
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	25.139.018,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	8.379.672,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.379.672,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.379.672,86
Total Renda Fixa	100,00%	154.033.986,94	91,91%	27,00%	70,00%	210,00%	

Distribuição por Segmento

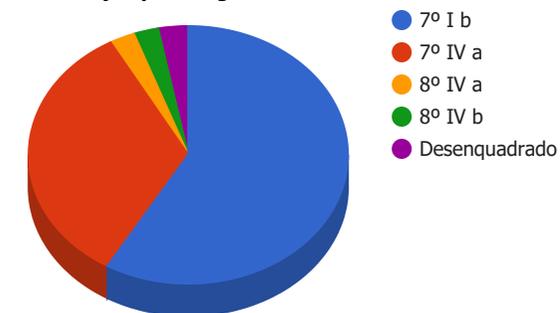


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	33.518.691,43
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	16.759.345,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.282.067,74	2,56%	2,00%	5,00%	5,00%	4.097.605,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.198.023,90	2,50%	2,00%	5,00%	5,00%	4.181.648,96
Desenquadrado - RV	0,00%	5.079.378,59	3,03%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.079.378,59
Total Renda Variável	30,00%	13.559.470,23	8,09%	18,00%	30,00%	40,00%	

Distribuição por Artigos



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Setembro / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	122.692.579,39	73,21	0,02
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	28.850.469,55	17,21	1,93
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.570.316,59	4,52	0,00
FOCO DTVM	4.282.067,74	2,56	3,71
REDITUS INVESTIMENTOS	4.198.023,90	2,50	-

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	97.936.159,09	58,44	15,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	56.097.827,85	33,47	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	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 "	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.282.067,74	2,56	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.198.023,90	2,50	2,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	0,89%	3,86%	6,15%	12,56%	26,08%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Selic (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	0,89%	3,86%	6,15%	12,56%	26,08%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Selic (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	0,89%	3,86%	6,15%	12,56%	26,08%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Selic (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

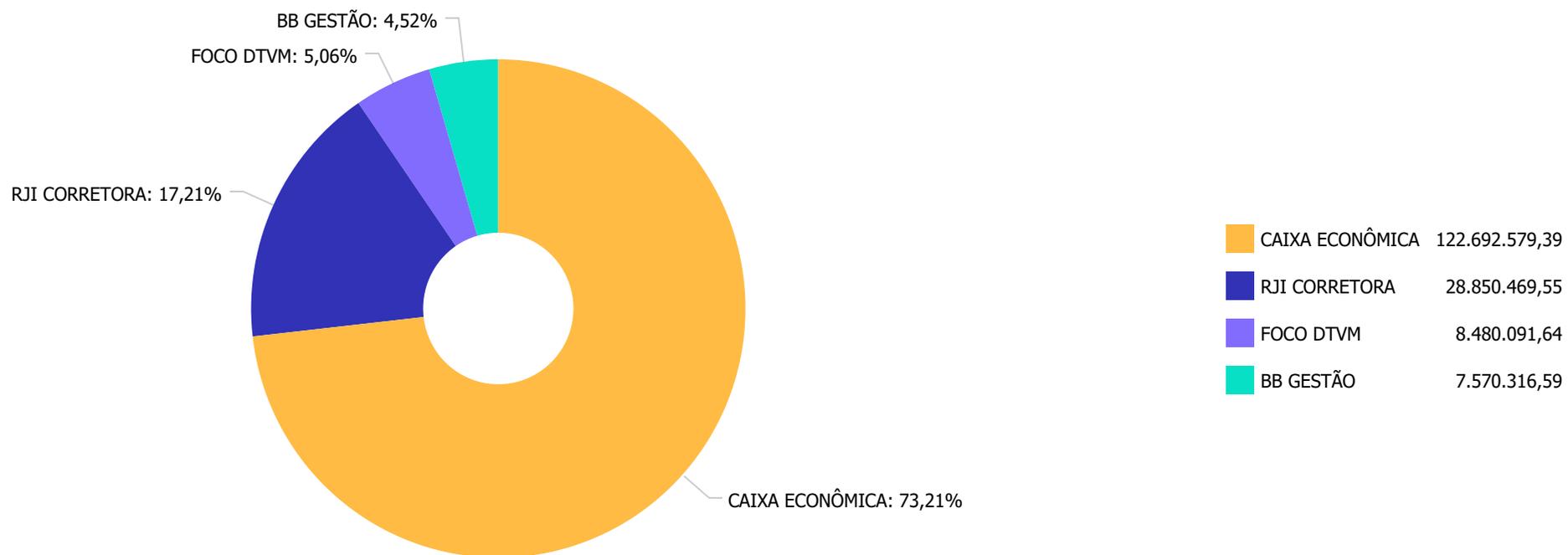
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

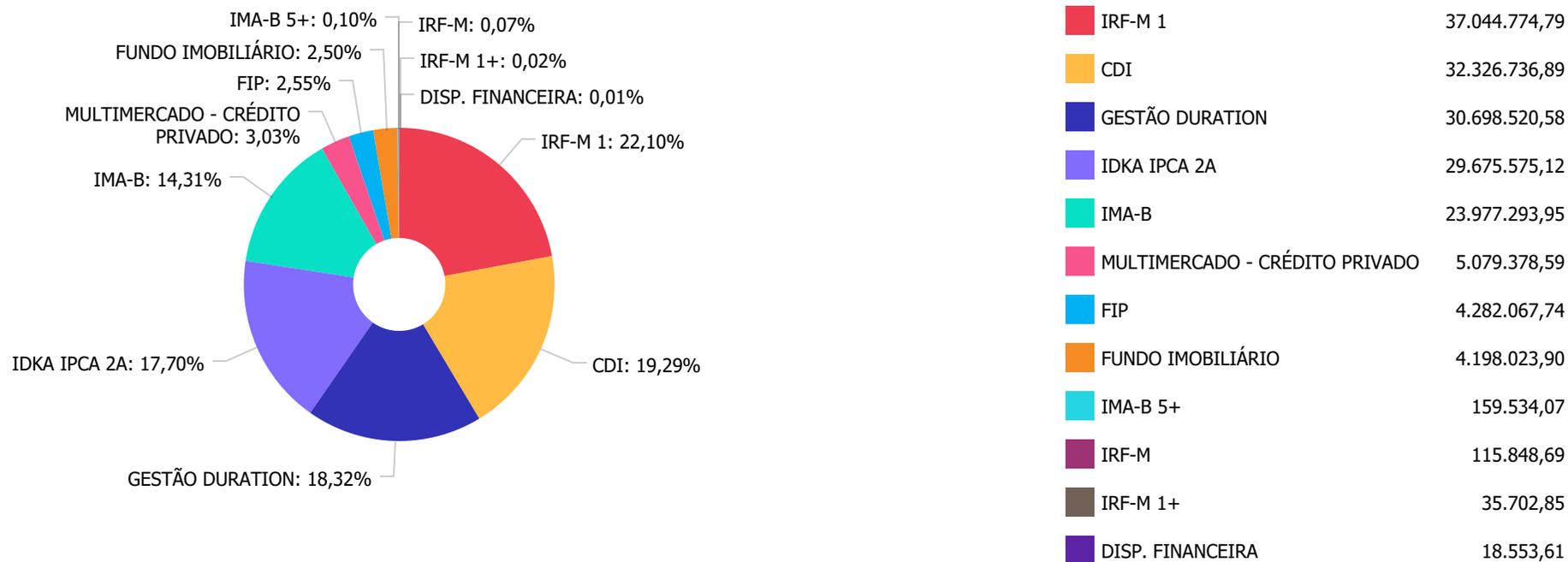
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,18%	10,59%	-0,49%	1,10%	8,03%	17,93%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-1,77%	14,38%	-1,68%	1,99%	11,17%	22,09%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,78%	10,44%	-1,87%	1,59%	8,31%	19,23%	0,01%	0,03%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Setembro / 2019)



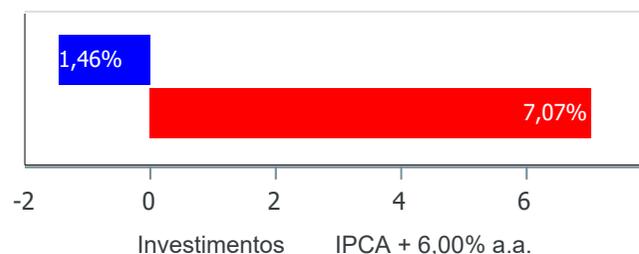
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

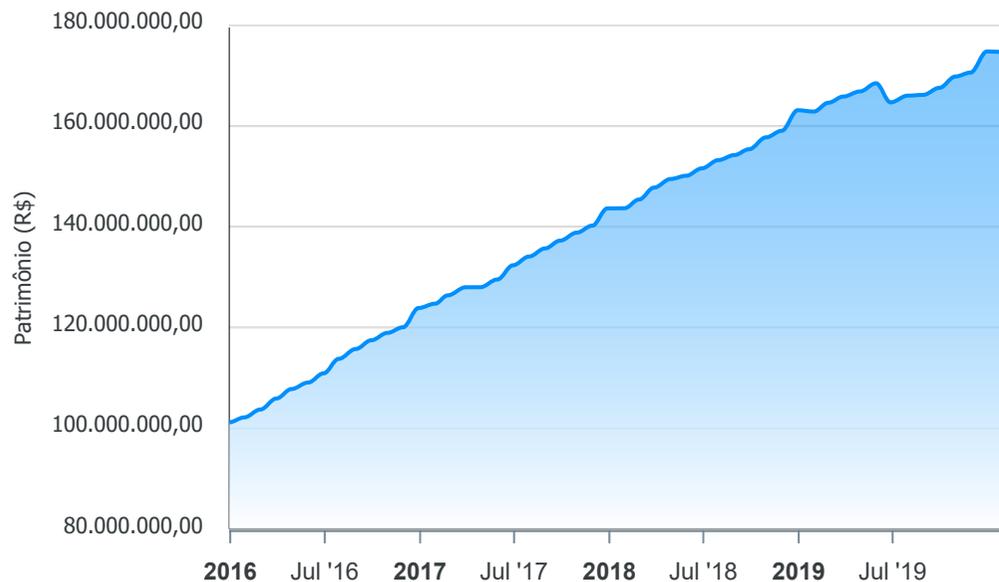
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	163.157.262,13	0,00	683.400,00	162.752.567,82	278.705,69	278.705,69	0,17%	0,17%	0,83%	0,83%	20,54%	0,43%
Fevereiro	162.752.567,82	1.087.050,00	105.000,00	164.646.943,89	912.326,07	1.191.031,76	0,56%	0,73%	0,90%	1,73%	42,03%	0,56%
Março	164.646.943,89	854.175,56	152.000,00	165.820.330,11	471.210,66	1.662.242,42	0,28%	1,02%	1,19%	2,95%	34,45%	1,02%
Abril	165.820.330,11	858.083,74	114.000,00	166.834.863,67	270.449,82	1.932.692,24	0,16%	1,18%	1,06%	4,04%	29,21%	1,17%
Mai	166.834.863,67	1.030.378,80	250.000,00	168.489.449,88	874.207,41	2.806.899,65	0,52%	1,71%	0,64%	4,71%	36,29%	1,69%
Junho	168.489.449,88	3.661.049,75	1.569.980,19	164.659.819,61	-5.920.699,83	-3.113.800,18	-3,47%	-1,82%	0,45%	5,18%	-35,20%	4,47%
Julho	164.659.819,61	1.535.378,80	808.500,00	166.055.155,75	668.457,34	-2.445.342,84	0,40%	-1,43%	0,72%	5,94%	-24,00%	1,65%
Agosto	166.055.155,75	23.336.070,05	22.545.692,18	166.195.693,93	-649.839,69	-3.095.182,53	-0,39%	-1,81%	0,62%	6,60%	-27,43%	2,24%
Setembro	166.195.693,93	26.771.665,65	25.967.653,96	167.593.457,17	593.751,55	-2.501.430,98	0,36%	-1,46%	0,45%	7,07%	-20,65%	24,45%

Investimentos x Meta Atuarial



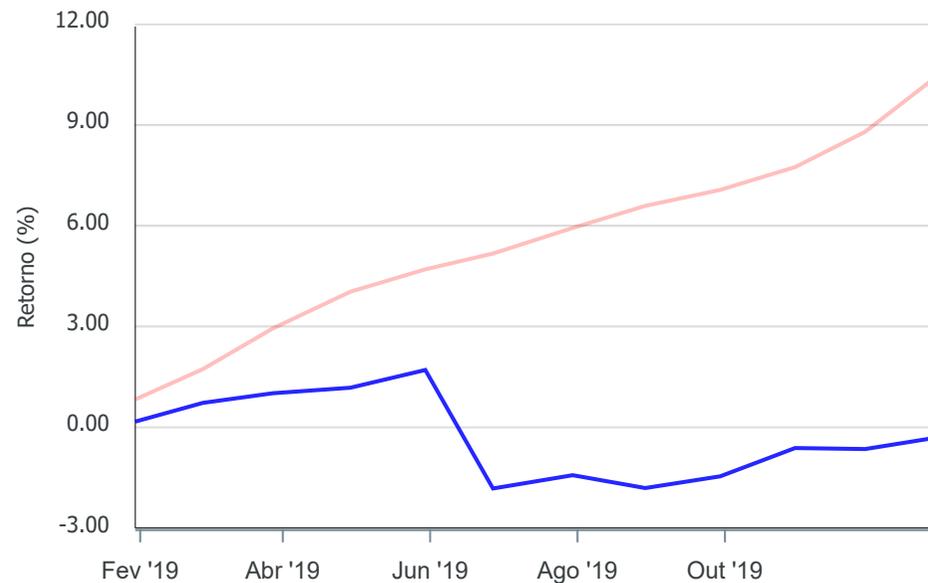
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	153.830,81	0,00	0,00	159.534,07	5.703,26	3,71%	3,71%	2,78%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	200.493,72	0,00	0,00	206.202,99	5.709,27	2,85%	2,85%	1,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	35.052,67	0,00	0,00	35.702,85	650,18	1,85%	1,85%	1,22%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	114.230,42	0,00	0,00	115.848,69	1.618,27	1,42%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.644.499,66	12.661.665,65	0,00	30.698.520,58	392.355,27	1,29%	2,12%	1,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	15.455.422,03	14.000.000,00	0,00	29.675.575,12	220.153,09	0,75%	1,42%	0,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	55.461.633,39	0,00	25.852.500,00	29.956.043,95	346.910,56	0,63%	0,63%	0,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.045.097,07	0,00	0,00	7.088.730,84	43.633,77	0,62%	0,62%	0,12%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.926.134,62	0,00	0,00	5.955.183,18	29.048,56	0,49%	0,49%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.206.579,35	0,00	0,00	26.323.485,65	116.906,30	0,45%	0,45%	0,01%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	23.000,00	0,00	0,00	23.068,06	68,06	0,30%	0,30%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	30.139,48	110.000,00	115.153,96	25.000,00	14,48	0,01%	0,05%	0,01%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	24.328.181,36	0,00	0,00	23.771.090,96	-557.090,40	-2,29%	-1,78%	164,59%
Total Renda Fixa	152.624.294,58	26.771.665,65	25.967.653,96	154.033.986,94	605.680,67	0,39%		25,87%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.283.251,54	0,00	0,00	4.282.067,74	-1.183,80	-0,03%	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.201.584,10	0,00	0,00	4.198.023,90	-3.560,20	-0,08%	0,00%	0,00%
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.086.563,71	0,00	0,00	5.079.378,59	-7.185,12	-0,14%	0,01%	1,75%
Total Renda Variável	13.571.399,35	0,00	0,00	13.559.470,23	-11.929,12	-0,09%		0,96%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	77.846.030,25	0,00	49.186.691,24	29.956.043,95	1.296.704,94	1,67%	1,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.340.333,38	28.956.200,08	0,00	30.698.520,58	401.987,12	1,33%	3,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.936.048,08	0,00	0,00	26.323.485,65	387.437,57	1,49%	1,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.851.731,75	22.533.914,42	0,00	29.675.575,12	289.928,95	0,99%	2,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.960.200,60	0,00	0,00	7.088.730,84	128.530,24	1,85%	1,85%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.864.319,72	0,00	0,00	5.955.183,18	90.863,46	1,55%	1,55%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	198.797,81	0,00	0,00	206.202,99	7.405,18	3,72%	3,72%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	152.775,75	0,00	0,00	159.534,07	6.758,32	4,42%	4,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	112.749,45	0,00	0,00	115.848,69	3.099,24	2,75%	2,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	34.593,72	0,00	0,00	35.702,85	1.109,13	3,21%	3,21%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00	23.000,00	0,00	23.068,06	68,06	0,30%	1,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	30.087,58	130.000,00	135.154,90	25.000,00	67,32	0,04%	0,22%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	25.555.525,40	0,00	0,00	23.771.090,96	-1.784.434,44	-6,98%	-6,51%
Total Renda Fixa					829.525,09	0,54%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.285.711,90	0,00	0,00	4.282.067,74	-3.644,16	-0,09%	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.209.892,44	0,00	0,00	4.198.023,90	-11.868,54	-0,28%	0,00%
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.281.021,78	0,00	0,00	5.079.378,59	-201.643,19	-3,82%	-3,67%
				Total Renda Variável	-217.155,89	-1,58%	