

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	24.245.101,18	4,18%	165	3,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	60.026.024,50	10,35%	873	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	16.993.984,86	2,93%	57	1,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	26.073.596,37	4,50%	616	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.653.647,20	2,18%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	83.438.036,01	14,39%	909	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	17.478.630,12	3,01%	73	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	45.189.007,65	7,79%	25.232	3,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.556.674,61	2,17%	920	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.859.908,10	1,01%	821	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	87.893.643,79	15,16%	245	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	34.204.624,68	5,90%	560	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	45.362.607,97	7,82%	374	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.413.649,43	0,24%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	7.348.692,52	1,27%	158	1,40%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	13.252.307,27	2,29%	197	1,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	11.314.586,95	1,95%	6.711	1,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.696.776,60	1,33%	1.517	3,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVSPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	10.639.858,14	1,83%	52	1,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	8.012.337,09	1,38%	4.967	0,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	7.716.470,93	1,33%	2.672	2,83%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.764.642,48	1,86%	1.534	0,65%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

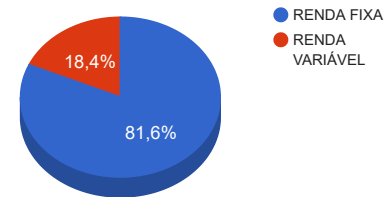
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	16.445.011,62	2,84%	35	4,50%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	10.287.692,88	1,77%	45	3,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.997.658,49	0,52%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
Total			579.865.171,44				

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

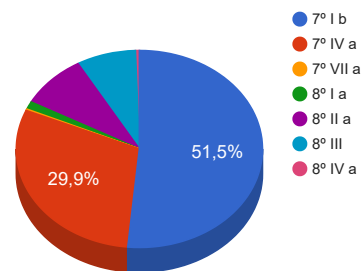
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	298.654.702,50	51,50%	35,00%	48,50%	65,00%	78.257.658,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	173.320.784,54	29,89%	20,00%	35,00%	40,00%	58.625.284,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.413.649,43	0,24%	0,00%	0,50%	0,50%	1.485.676,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	7.348.692,52	1,27%	2,00%	4,00%	8,00%	39.040.521,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	50.915.866,05	8,78%	2,00%	5,00%	10,00%	7.070.651,09
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	45.213.817,91	7,80%	2,00%	6,50%	10,00%	12.772.699,23
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.997.658,49	0,52%	0,00%	0,50%	1,00%	2.800.993,22
Total Carteira		579.865.171,44					

RENDA FIXA	473.389.136,47	81,64%
RENDA VARIÁVEL	106.476.034,97	18,36%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	298.654.702,50	51,50%	35,00%	65,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	173.320.784,54	29,89%	20,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.413.649,43	0,24%	0,00%	0,50%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	7.348.692,52	1,27%	2,00%	8,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	50.915.866,05	8,78%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	45.213.817,91	7,80%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.997.658,49	0,52%	0,00%	1,00%
Total Renda Fixa	579.865.171,44	100,00%	61,00	149,50

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 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	156.535.532,01	27,00%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	117.693.414,57	20,30%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	87.893.643,79	15,16%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	58.614.915,24	10,11%	0,01%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	45.189.007,65	7,79%	0,13%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	27.209.654,10	4,69%	0,01%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	20.665.984,29	3,56%	0,02%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	16.993.984,86	2,93%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	11.314.586,95	1,95%	0,03%
ITAÚ DTVM	10.639.858,14	1,83%	0,00%
WESTERN ASSET	10.287.692,88	1,77%	0,02%
Vinci Partners	7.716.470,93	1,33%	0,03%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	7.696.776,60	1,33%	0,01%
PETRA Capital	1.413.649,43	0,24%	0,03%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	15,04%	9,08%	15,04%	28,39%	38,55%	0,20%	2,331%	7,63%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	3,71%	15,03%	9,06%	15,03%	28,44%	38,61%	0,20%	2,333%	7,65%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,69%	15,08%	9,06%	15,08%	28,54%	38,72%	0,20%	2,313%	7,71%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3,24%	14,77%	8,72%	14,77%	28,29%	40,15%	0,40%	1,901%	7,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,97%	8,21%	6,68%	8,21%	15,47%	19,36%	0,20%	2,153%	8,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	5,64%	3,03%	5,64%	11,98%	22,93%	0,20%	0,778%	2,21%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,98%	3,39%	5,98%	12,17%	23,08%	0,20%	0,954%	1,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,76%	3,19%	5,76%	11,97%	22,82%	0,20%	0,911%	1,98%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	3,01%	1,50%	3,01%	6,17%	13,82%	0,20%	0,003%	0,12%
Selic	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,15%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	3,05%	1,53%	3,05%	6,24%	14,26%	0,20%	0,003%	0,11%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,31%	4,27%	1,73%	4,32%	7,61%	16,96%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,14%	-2,29%	-1,83%	-2,29%	-3,96%	-10,66%	0,15%	0,031%	1,25%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,73%	10,92%	6,70%	10,92%	16,74%	26,22%	0,002	1,653%	3,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,55%	8,36%	5,08%	8,36%	12,90%	24,68%	0,40%	1,493%	2,83%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,73%	4,78%	4,42%	4,78%	10,13%	14,83%	0,15%	1,345%	6,25%

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

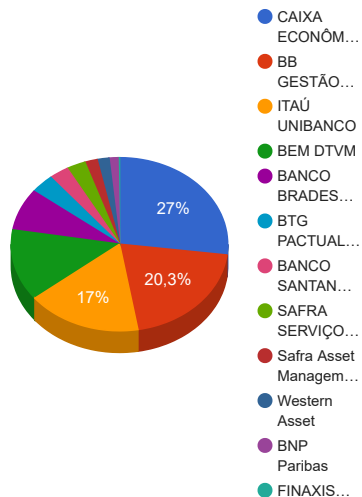
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,99%	19,26%	10,91%	19,26%	41,71%	61,51%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,50%	11,30%	9,50%	11,30%	35,83%	80,50%	2,00%	6,583%	18,02%
S&P 500	6,89%	17,35%	3,79%	17,35%	8,22%	21,39%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	7,08%	18,79%	4,73%	18,79%	12,04%	32,58%	1,00%	4,643%	18,45%
IGC	4,46%	15,89%	7,00%	15,89%	41,30%	54,53%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,24%	15,05%	6,32%	15,05%	41,15%	55,33%	1,00%	7,253%	16,59%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,85%	17,29%	12,65%	17,29%	45,85%	66,10%	3,00%	7,054%	16,08%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,69%	23,70%	9,25%	23,70%	40,41%	36,97%	2,00%	4,940%	21,68%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4,68%	14,51%	6,76%	14,51%	38,04%	57,96%	1,50%	6,684%	16,61%
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	3,69%	11,27%	5,95%	11,27%	37,92%	78,11%	1,50%	7,101%	13,89%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,71%	2,28%	0,92%	2,28%	5,13%	15,42%	2,00%	0,752%	1,70%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,65%	3,21%	1,77%	3,21%	7,30%	14,94%	0,50%	0,380%	0,74%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,035%	0,30%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

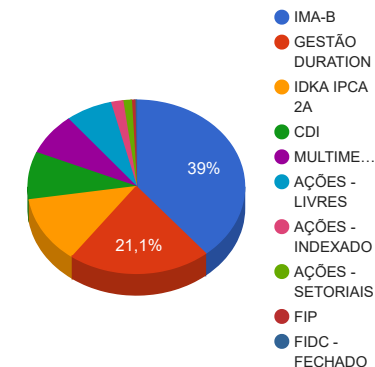
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	2,00%	7,69%	4,86%	7,69%	12,93%	22,95%	0,96%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	156.535.532,01	27,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	117.693.414,57	20,30%
ITAÚ UNIBANCO	98.533.501,93	16,99%
BEM DTVM	77.472.372,80	13,36%
BANCO BRADESCO	45.362.607,97	7,82%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	20.665.984,29	3,56%
BANCO SANTANDER	16.993.984,86	2,93%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	16.445.011,62	2,84%
Safra Asset Management	10.764.642,48	1,86%
Western Asset	10.287.692,88	1,77%
BNP Paribas	7.696.776,60	1,33%
FINAXIS Corretora	1.413.649,43	0,24%



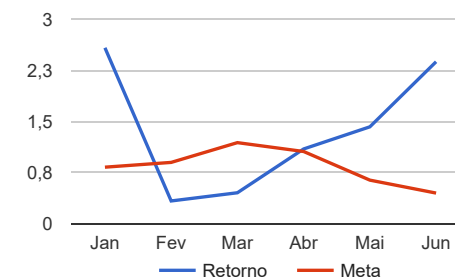
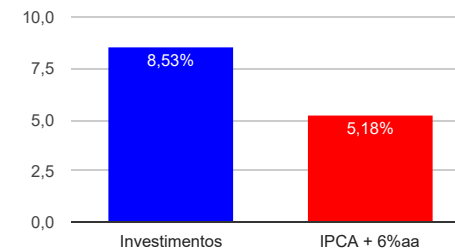
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	226.072.003,39	38,99%
GESTÃO DURATION	122.098.268,47	21,06%
IDKA IPCA 2A	72.582.699,11	12,52%
CDI	51.222.516,07	8,83%
MULTIMERCADO	45.213.817,91	7,80%
AÇÕES - LIVRES	40.276.007,91	6,95%
AÇÕES - INDEXADO	10.639.858,14	1,83%
AÇÕES - SETORIAIS	7.348.692,52	1,27%
FIP	2.997.658,49	0,52%
FIDC - FECHADO	1.413.649,43	0,24%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	540.248.896,44	21.785.926,14	19.097.109,18	556.953.088,69	14.015.375,29	2,58%	0,83%	310,40%	1,68%
Fevereiro	556.953.088,69	13.821.182,46	16.963.205,64	555.673.806,66	1.862.741,15	0,33%	0,90%	37,35%	2,05%
Março	555.673.806,66	13.527.269,34	15.455.000,00	556.273.223,24	2.527.147,24	0,45%	1,19%	38,10%	2,65%
Abril	556.273.223,24	21.417.421,87	24.269.913,04	559.523.434,42	6.102.702,35	1,10%	1,06%	103,54%	1,45%
Mai	559.523.434,42	158.509.980,17	162.570.394,26	563.419.135,15	7.956.114,82	1,42%	0,64%	221,95%	1,99%
Junho	563.419.135,15	117.642.497,78	114.656.980,36	579.865.171,44	13.460.518,87	2,38%	0,45%	527,71%	2,07%
Acumulado no ano					45.924.599,72	8,53%	5,18%	164,79%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	16.386.614,72	0,00	0,00	16.993.984,86	607.370,14	3,71%	2,33%	3,71%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.973.685,84	0,00	0,00	17.478.630,12	504.944,28	2,97%	2,15%	2,97%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.494.081,61	3.681.144,11	25.917.648,38	0,00	742.422,66	2,95%	2,32%	3,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	33.294.097,26	0,00	0,00	34.204.624,68	910.527,42	2,73%	1,65%	2,73%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	35.492.653,70	8.500.000,00	0,00	45.189.007,65	1.196.353,95	2,72%	1,90%	3,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	77.397.177,11	8.500.000,00	0,00	87.893.643,79	1.996.466,68	2,32%	1,49%	2,55%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.437.858,70	0,00	0,00	12.653.647,20	215.788,50	1,73%	1,34%	1,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.041.762,25	53.012.356,90	0,00	83.438.036,01	1.383.916,86	1,69%	2,31%	3,69%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	59.369.709,71	0,00	0,00	60.026.024,50	656.314,79	1,11%	0,91%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.000.262,32	0,00	0,00	24.245.101,18	244.838,86	1,02%	0,78%	1,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.371.667,61	10.427.447,00	56.838.012,29	12.556.674,61	595.572,29	0,87%	0,95%	1,22%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	25.917.648,38	0,00	26.073.596,37	155.947,99	0,60%	2,33%	3,71%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	62.079.382,37	0,00	17.000.000,00	45.362.607,97	283.225,60	0,46%	0,00%	0,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.096.400,54	0,00	10.301.319,69	5.859.908,10	64.827,25	0,40%	0,00%	0,45%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.415.696,28	0,00	0,00	1.413.649,43	-2.046,85	-0,14%	0,03%	-0,14%
Total Renda Fixa					9.556.470,42	2,06%	1,49%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	15.358.402,62	0,00	0,00	16.445.011,62	1.086.609,00	7,08%	4,64%	7,08%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.724.447,96	0,00	0,00	11.314.586,95	590.138,99	5,50%	6,58%	5,50%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.641.982,52	0,00	0,00	8.012.337,09	370.354,57	4,85%	7,05%	4,85%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.352.217,94	0,00	0,00	7.696.776,60	344.558,66	4,69%	4,94%	4,69%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.164.185,93	0,00	0,00	10.639.858,14	475.672,21	4,68%	6,68%	4,68%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	14.373.109,08	0,00	1.600.000,00	13.252.307,27	479.198,19	3,33%	7,10%	3,69%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10.044.724,28	0,00	3.000.000,00	7.348.692,52	303.968,24	3,03%	7,25%	4,24%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,00	7.603.901,39	0,00	7.716.470,93	112.569,54	1,48%	-	2,00%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	10.215.122,87	0,00	0,00	10.287.692,88	72.570,01	0,71%	0,75%	0,71%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.694.907,67	0,00	0,00	10.764.642,48	69.734,81	0,65%	0,38%	0,65%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.998.984,26	0,00	0,00	2.997.658,49	-1.325,77	-0,04%	0,03%	-0,04%
Total Renda Variável					3.904.048,45	3,81%	4,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.082.203,21	72.905.445,31	0,00	87.893.643,79	2.905.995,27	4,12%	5,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.375.299,52	55.365.313,55	0,00	83.438.036,01	2.697.422,94	6,64%	9,06%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	15.589.286,48	27.016.247,86	0,00	45.189.007,65	2.583.473,31	7,79%	8,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	71.420.048,13	41.951.607,53	102.881.071,00	12.556.674,61	2.066.089,95	2,64%	3,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.170.506,88	0,00	0,00	60.026.024,50	1.855.517,62	3,19%	3,19%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.137.814,33	7.047.111,72	25.917.648,38	0,00	1.732.722,33	8,15%	9,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	32.500.000,00	0,00	34.204.624,68	1.704.624,68	5,24%	6,70%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	15.581.704,67	0,00	0,00	16.993.984,86	1.412.280,19	9,06%	9,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.383.684,41	0,00	0,00	17.478.630,12	1.094.945,71	6,68%	6,68%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	61.430.274,40	0,00	17.000.000,00	45.362.607,97	932.333,57	1,52%	1,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	63.448.884,35	0,00	64.335.889,97	0,00	887.005,62	1,40%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.532.674,49	0,00	0,00	24.245.101,18	712.426,69	3,03%	3,03%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.117.591,00	0,00	0,00	12.653.647,20	536.056,20	4,42%	4,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.956.616,12	8.602.557,92	26.979.319,69	5.859.908,10	280.053,75	1,16%	1,50%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	18.316.907,82	0,00	18.516.247,86	0,00	199.340,04	1,09%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	25.917.648,38	0,00	26.073.596,37	155.947,99	0,60%	9,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.497.139,76	10.174.763,98	29.781.808,58	0,00	109.904,84	0,43%	1,74%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.440.039,21	0,00	0,00	1.413.649,43	-26.389,78	-1,83%	-1,83%
Total Renda Fixa					21.839.750,92	4,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.332.991,05	0,00	0,00	11.314.586,95	981.595,90	9,50%	9,50%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.112.860,69	0,00	0,00	8.012.337,09	899.476,40	12,65%	12,65%
BRABESCO SELECTION FI AÇÕES	14.066.451,89	8.485.302,18	10.085.302,18	13.252.307,27	785.855,38	5,13%	5,95%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	15.702.028,77	0,00	0,00	16.445.011,62	742.982,85	4,73%	4,73%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	12.908.156,62	0,00	3.000.000,00	10.639.858,14	731.701,52	6,76%	6,76%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.045.148,51	0,00	0,00	7.696.776,60	651.628,09	9,25%	9,25%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	9.848.159,74	0,00	3.000.000,00	7.348.692,52	500.532,78	5,08%	6,32%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.577.745,67	0,00	0,00	10.764.642,48	186.896,81	1,77%	1,77%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,00	7.603.901,39	0,00	7.716.470,93	112.569,54	1,48%	4,86%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	10.194.131,10	0,00	0,00	10.287.692,88	93.561,78	0,92%	0,92%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	3.004.874,42	0,00	0,00	2.997.658,49	-7.215,93	-0,24%	-
Total Renda Variável					5.679.585,12	5,63%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	23.697.605,07	55.732.669,29	0,00	83.438.036,01	4.007.761,65	12,51%	15,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	67.437.328,81	44.230.429,99	102.881.071,00	12.556.674,61	3.769.986,81	5,19%	5,98%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	14.766.347,60	27.016.247,86	0,00	45.189.007,65	3.406.412,19	13,79%	14,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.716.536,02	72.905.445,31	0,00	87.893.643,79	3.271.662,46	7,37%	8,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	56.550.560,70	206.404,84	0,00	60.026.024,50	3.269.058,96	5,76%	5,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	61.526.836,29	0,00	64.335.889,97	0,00	2.809.053,68	4,57%	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.408.377,35	8.983.754,32	25.917.648,38	0,00	2.525.516,71	13,99%	15,00%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	14.773.512,44	0,00	0,00	16.993.984,86	2.220.472,42	15,03%	15,03%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	60.526.908,12	0,00	17.000.000,00	45.362.607,97	1.835.699,85	3,03%	3,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	32.500.000,00	0,00	34.204.624,68	1.704.624,68	5,24%	10,92%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.153.018,78	0,00	367.355,74	17.478.630,12	1.692.967,08	10,65%	8,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.590.356,16	0,00	650.587,27	24.245.101,18	1.305.332,29	5,64%	5,64%
BGT PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.075.984,90	0,00	324.262,63	12.653.647,20	901.924,93	7,61%	4,78%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	19.091.102,59	13.162.869,46	26.979.319,69	5.859.908,10	585.255,74	2,56%	3,01%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	17.955.523,97	0,00	18.516.247,86	0,00	560.723,89	3,12%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	29.473.528,47	48.046.513,09	78.057.808,58	0,00	537.767,02	1,47%	3,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	25.917.648,38	0,00	26.073.596,37	155.947,99	0,60%	15,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.446.800,24	0,00	0,00	1.413.649,43	-33.150,81	-2,29%	-2,29%
Total Renda Fixa					34.527.017,54	7,80%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	13.843.348,40	0,00	0,00	16.445.011,62	2.601.663,22	18,79%	18,79%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	12.033.913,69	0,00	3.000.000,00	10.639.858,14	1.605.944,45	14,51%	14,51%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.222.141,43	0,00	0,00	7.696.776,60	1.474.635,17	23,70%	23,70%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	11.588.879,98	10.382.411,36	10.085.302,18	13.252.307,27	1.366.318,11	9,66%	11,27%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	9.101.022,30	0,00	3.000.000,00	7.348.692,52	1.247.670,22	13,71%	15,05%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.831.182,78	0,00	0,00	8.012.337,09	1.181.154,31	17,29%	17,29%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.165.722,49	0,00	0,00	11.314.586,95	1.148.864,46	11,30%	11,30%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	10.430.206,45	0,00	0,00	10.764.642,48	334.436,03	3,21%	3,21%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	10.058.388,94	0,00	0,00	10.287.692,88	229.303,94	2,28%	2,28%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,00	7.603.901,39	0,00	7.716.470,93	112.569,54	1,48%	7,69%
BRDESCO H IBOVESPA REGIMES DE PREVIDÊNCIA FIC AÇÕES	1.786.877,16	0,00	1.897.109,18	0,00	110.232,02	6,17%	14,40%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.996.885,31	15.982,47	0,00	2.997.658,49	-15.209,29	-0,50%	-
Total Renda Variável					11.397.582,18	11,99%	