

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.661.486,33	6,37%	819	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.397.855,74	1,43%	687	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	11.869.006,64	7,09%	442	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.981.095,23	1,18%	368	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	4.043.994,59	2,41%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.312.614,62	4,37%	782	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	378.969,20	0,23%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.914.459,89	5,92%	830	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	7.301.611,56	4,36%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.201.461,34	3,11%	464	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.135.399,12	4,86%	1.248	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.373.980,37	4,40%	777	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	589.416,25	0,35%	213	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	449.137,37	0,27%	661	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.125.592,42	1,87%	705	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	24.893.167,17	14,86%	416	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.132.390,03	0,68%	56	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.205.039,47	1,32%	399	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	19.519.168,90	11,65%	56	7,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	10.681.791,42	6,38%	2.510	3,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.830.593,44	2,29%	74	1,85%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	6.626.830,49	3,96%	187	1,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

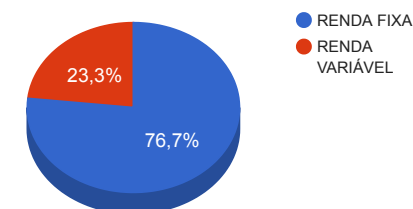
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.726.648,90	2,23%	7.504	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.399.911,12	4,42%	3.732	1,04%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	991.324,54	0,59%	36	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.201.028,80	1,91%	76	2,24%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	2.537.141,80	1,51%		1,65%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>167.481.116,75</b>				

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

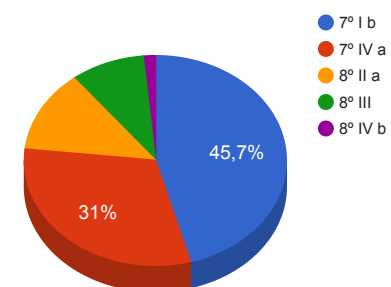
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	76.571.934,63	45,72%	15,00%	40,00%	90,00%	74.161.070,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	100.488.670,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	51.913.911,61	31,00%	5,00%	29,00%	40,00%	15.078.535,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	8.374.055,84
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	33.496.223,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	21.139.215,35	12,62%	0,00%	10,00%	20,00%	12.357.008,00
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	15.318.913,36	9,15%	0,00%	5,00%	10,00%	1.429.198,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	8.374.055,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.537.141,80	1,51%	0,00%	2,50%	5,00%	5.836.914,04
<b>Total Carteira</b>		<b>167.481.116,75</b>					

RENDA FIXA	128.485.846,24	76,72%
RENDA VARIÁVEL	38.995.270,51	23,28%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	76.571.934,63	45,72%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	51.913.911,61	31,00%	5,00%	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 "	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 I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	21.139.215,35	12,62%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	15.318.913,36	9,15%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.537.141,80	1,51%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>167.481.116,75</b>	<b>100,00%</b>	<b>20,00</b>	<b>285,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 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	96.377.800,28	57,55%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.813.765,38	27,35%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.831.869,96	5,27%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	3.830.593,44	2,29%	0,71%
WESTERN ASSET	3.726.648,90	2,23%	0,01%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.201.028,80	1,91%	0,47%
ZION Invest	2.537.141,80	1,51%	0,52%
ITAÚ UNIBANCO	1.721.806,28	1,03%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	991.324,54	0,59%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	449.137,37	0,27%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,19%	2,95%	2,95%	4,84%	10,80%	20,46%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	3,26%	3,26%	9,58%	9,27%	23,38%	0,15%	1,746%	4,52%
IMA-B 5	0,78%	2,90%	2,90%	7,68%	9,19%	22,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,76%	2,85%	2,85%	7,64%	9,00%	21,82%	0,20%	1,209%	3,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	2,83%	2,83%	7,56%	8,97%	21,82%	0,20%	1,214%	3,06%
IPCA	0,75%	1,51%	1,51%	1,90%	4,58%	7,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,54%	3,96%	3,96%	7,52%	8,97%	19,63%	0,002	4,048%	3,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,39%	3,12%	3,12%	5,99%	8,05%	18,72%	0,40%	1,888%	1,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,39%	3,12%	3,12%	5,99%	8,05%	18,71%	0,40%	1,887%	1,89%
IDKA IPCA 2 Anos	0,67%	2,48%	2,48%	5,97%	9,19%	22,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	2,50%	2,50%	5,99%	8,71%	21,23%	0,20%	0,932%	2,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	2,49%	2,49%	6,03%	8,65%	21,14%	0,20%	0,893%	2,35%
IRF-M	0,59%	2,28%	2,28%	8,65%	9,14%	23,19%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	2,22%	2,22%	8,54%	8,92%	22,62%	0,20%	1,575%	3,50%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	2,19%	2,19%	8,77%	8,90%	22,66%	0,20%	1,671%	3,63%
IMA-B	0,58%	5,54%	5,54%	15,99%	13,71%	25,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	1,05%	1,05%	9,32%	3,84%	11,21%	0,20%	2,596%	7,03%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	2,54%	2,54%	6,49%	9,39%	21,05%	0,20%	0,895%	2,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	5,52%	5,52%	15,95%	13,52%	25,44%	0,20%	4,050%	5,97%
IMA Geral ex-C	0,54%	2,92%	2,92%	8,54%	9,29%	21,13%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,94%	2,94%	8,60%	9,29%	20,53%	0,30%	1,947%	2,99%
IRF-M 1	0,47%	1,53%	1,53%	3,59%	6,68%	16,65%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,46%	1,46%	3,49%	6,45%	16,15%	0,10%	0,106%	0,55%
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,47%	1,51%	1,51%	3,03%	6,22%	15,09%	0,20%	0,016%	0,03%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	1,54%	1,54%	3,11%	6,31%	15,37%	0,20%	0,007%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	1,25%	1,25%	2,53%	5,21%	12,87%	1,00%	0,003%	0,01%
Selic	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,35%	15,28%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	1,49%	1,49%	3,03%	6,22%	15,57%	0,20%	0,008%	0,01%

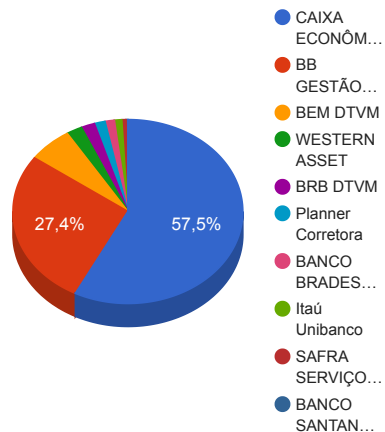


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (março / 2019)

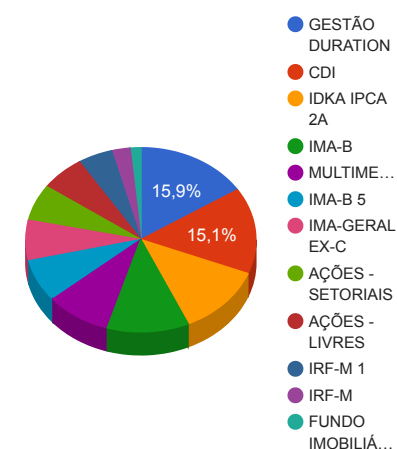
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	1,79%	13,07%	13,07%	-2,73%	7,33%	19,96%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1,98%	13,43%	13,43%	-1,06%	11,34%	33,04%	1,00%	6,235%	13,94%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,97%	13,55%	13,55%	-0,78%	11,80%	32,95%	1,00%	6,325%	14,06%
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,48%	4,17%	4,17%	8,95%	10,26%	23,06%	0,50%	3,156%	3,88%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,40%	1,60%	1,60%	3,19%	6,66%	16,74%	1,00%	0,142%	0,56%
SMLL	0,10%	7,53%	7,53%	29,53%	11,77%	49,58%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-0,25%	7,08%	7,08%	26,22%	8,43%	45,29%	1,50%	10,844%	20,56%
Ibovespa	-0,18%	8,56%	8,56%	20,26%	11,77%	46,83%	-	-	-
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,24%	5,02%	5,02%	18,80%	13,05%	64,29%	1,50%	12,602%	21,90%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,21%	9,28%	9,28%	20,81%	15,71%	49,63%	2,00%	12,621%	23,15%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-12,94%	-13,95%	-13,95%	-21,69%	-37,02%	-1,33%	1,60%	20,975%	80,99%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	96.377.800,28	57,55%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.813.765,38	27,35%
BEM DTVM	10.457.423,93	6,24%
WESTERN ASSET	3.726.648,90	2,23%
BRB DTVM	3.201.028,80	1,91%
Planner Corretora	2.537.141,80	1,51%
BANCO BRADESCO	2.205.039,47	1,32%
Itaú Unibanco	1.721.806,28	1,03%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	991.324,54	0,59%
BANCO SANTANDER	449.137,37	0,27%



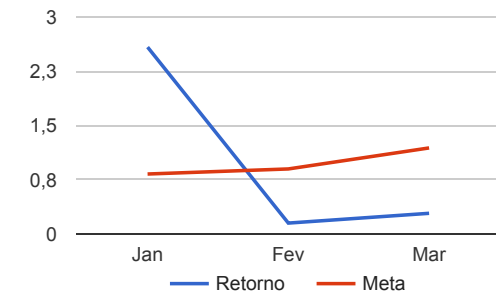
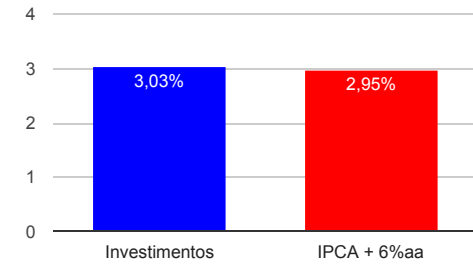
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	26.614.973,45	15,89%
CDI	25.298.938,16	15,11%
IDKA IPCA 2A	20.575.946,22	12,29%
IMA-B	19.098.555,72	11,40%
MULTIMERCADO	15.318.913,36	9,15%
IMA-B 5	12.514.075,96	7,47%
IMA-GERAL EX-C	11.869.006,64	7,09%
AÇÕES - SETORIAIS	10.681.791,42	6,38%
AÇÕES - LIVRES	10.457.423,93	6,24%
IRF-M 1	8.135.399,12	4,86%
IRF-M	4.378.950,97	2,61%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.537.141,80	1,51%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	151.624.985,03	22.135.693,01	16.553.674,62	161.265.801,00	4.058.797,58	2,58%	0,83%	310,45%	2,18%
Fevereiro	161.265.801,00	2.448.820,38	2.495.450,27	161.465.315,43	246.144,32	0,15%	0,90%	17,04%	2,36%
Março	161.465.315,43	6.683.054,96	1.147.628,61	167.481.116,75	480.374,97	0,29%	1,19%	24,10%	3,46%
Acumulado no ano					4.785.316,87	3,03%	2,95%	102,88%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.235.463,04	0,00	0,00	7.301.611,56	66.148,52	0,91%	2,60%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.012.063,94	0,00	0,00	4.043.994,59	31.930,65	0,80%	1,75%	0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.257.137,15	0,00	0,00	7.312.614,62	55.477,47	0,76%	1,21%	0,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.162.345,68	0,00	0,00	5.201.461,34	39.115,66	0,76%	1,21%	0,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.849.277,72	0,00	0,00	9.914.459,89	65.182,17	0,66%	0,93%	0,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	376.501,48	0,00	0,00	378.969,20	2.467,72	0,66%	0,90%	0,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.592.573,94	0,00	0,00	10.661.486,33	68.912,39	0,65%	0,89%	0,65%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.384.293,61	0,00	0,00	2.397.855,74	13.562,13	0,57%	1,57%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.332.909,41	0,00	0,00	7.373.980,37	41.070,96	0,56%	4,05%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.970.268,67	0,00	0,00	1.981.095,23	10.826,56	0,55%	1,67%	0,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	24.758.338,41	0,00	0,00	24.893.167,17	134.828,76	0,54%	4,05%	0,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.807.702,42	0,00	0,00	11.869.006,64	61.304,22	0,52%	1,95%	0,52%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.194.779,55	0,00	0,00	2.205.039,47	10.259,92	0,47%	0,01%	0,47%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	473.006,87	0,00	26.000,00	449.137,37	2.130,50	0,45%	0,01%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.099.887,93	0,00	0,00	8.135.399,12	35.511,19	0,44%	0,11%	0,44%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	14.414.052,04	5.694.334,81	670.000,00	19.519.168,90	80.782,05	0,40%	0,02%	0,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	587.112,50	0,00	0,00	589.416,25	2.303,75	0,39%	1,89%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.128.011,47	0,00	0,00	1.132.390,03	4.378,56	0,39%	1,89%	0,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.577.606,50	988.720,15	451.628,61	3.125.592,42	10.894,38	0,31%	0,00%	0,39%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>737.087,56</b>	<b>0,58%</b>	<b>1,76%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	972.113,32	0,00	0,00	991.324,54	19.211,22	1,98%	6,24%	1,98%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.654.489,93	0,00	0,00	3.726.648,90	72.158,97	1,97%	6,32%	1,97%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.364.768,34	0,00	0,00	7.399.911,12	35.142,78	0,48%	3,16%	0,48%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.188.215,29	0,00	0,00	3.201.028,80	12.813,51	0,40%	0,14%	0,40%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	6.611.158,21	0,00	0,00	6.626.830,49	15.672,28	0,24%	12,60%	0,24%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.838.778,16	0,00	0,00	3.830.593,44	-8.184,72	-0,21%	12,62%	-0,21%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.708.175,35	0,00	0,00	10.681.791,42	-26.383,93	-0,25%	10,84%	-0,25%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.914.284,50	0,00	0,00	2.537.141,80	-377.142,70	-12,94%	20,98%	-12,94%
Total Renda Variável					-256.712,59	-0,65%	9,09%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.064.911,48	7.000.000,00	0,00	24.893.167,17	828.255,69	3,44%	3,96%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.988.105,73	0,00	0,00	7.373.980,37	385.874,64	5,52%	5,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.530.406,55	0,00	0,00	11.869.006,64	338.600,09	2,94%	2,94%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.225.941,85	0,00	191.539,25	7.301.611,56	267.208,96	3,72%	1,05%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.402.272,63	0,00	0,00	10.661.486,33	259.213,70	2,49%	2,49%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.392.118,55	11.665.859,72	15.794.000,00	19.519.168,90	255.190,63	1,25%	1,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.672.240,46	0,00	0,00	9.914.459,89	242.219,43	2,50%	2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.110.321,89	0,00	0,00	7.312.614,62	202.292,73	2,85%	2,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.058.532,60	0,00	0,00	5.201.461,34	142.928,74	2,83%	2,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.020.297,55	0,00	106.243,63	4.043.994,59	129.940,67	3,25%	3,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.384.120,14	1.648.667,18	0,00	8.135.399,12	102.611,80	1,40%	1,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.345.718,14	0,00	0,00	2.397.855,74	52.137,60	2,22%	2,22%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.938.674,50	0,00	0,00	1.981.095,23	42.420,73	2,19%	2,19%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.663.164,72	2.418.041,45	2.994.493,59	3.125.592,42	38.879,84	0,95%	1,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.098.118,31	0,00	0,00	1.132.390,03	34.271,72	3,12%	3,12%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.172.613,14	0,00	0,00	2.205.039,47	32.426,33	1,49%	1,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	571.561,15	0,00	0,00	589.416,25	17.855,10	3,12%	3,12%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.001.980,65	535.000,00	1.100.000,00	449.137,37	12.156,72	1,28%	1,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	379.898,10	0,00	10.477,03	378.969,20	9.548,13	2,53%	2,54%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.394.033,25</b>	<b>2,78%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.282.081,23	0,00	0,00	3.726.648,90	444.567,67	13,55%	13,55%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.340.062,78	5.000.000,00	0,00	10.681.791,42	341.728,64	3,30%	7,08%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.505.244,42	0,00	0,00	3.830.593,44	325.349,02	9,28%	9,28%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	6.310.016,42	0,00	0,00	6.626.830,49	316.814,07	5,02%	5,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.184.039,74	3.000.000,00	0,00	7.399.911,12	215.871,38	3,00%	4,17%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	873.979,48	0,00	0,00	991.324,54	117.345,06	13,43%	13,43%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.150.503,01	0,00	0,00	3.201.028,80	50.525,79	1,60%	1,60%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.958.059,81	0,00	0,00	2.537.141,80	-420.918,01	-14,23%	-13,95%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.391.283,62</b>	<b>3,70%</b>	