

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.506.630,85	1,35%	688	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	390.442,09	0,21%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	4.240.456,56	2,29%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.070.118,58	1,12%	393	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.842.530,99	8,01%	889	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.321.558,22	7,19%	920	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.420.801,75	2,93%	576	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	7.790.744,06	4,21%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.275.851,49	4,47%	1.250	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	12.478.874,50	6,74%	507	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.808.798,28	2,60%	909	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.001.565,47	5,94%	873	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	36.688.483,68	19,80%	560	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	403.648,99	0,22%	685	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.809.296,27	0,98%	245	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.457.443,75	5,10%	60	2,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.184.188,45	1,72%	719	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.062.992,92	1,11%	115	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.238.801,77	1,21%	374	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	7.020.873,22	3,79%	197	0,97%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	11.706.647,90	6,32%	2.582	3,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	4.458.197,75	2,41%	29.937	0,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

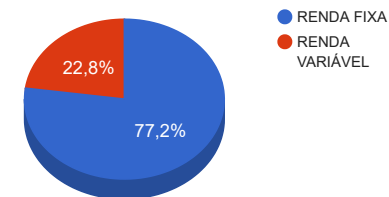
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.261.543,63	1,76%	77	2,23%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.038.231,66	0,56%	35	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.812.264,61	4,22%	6.064	0,59%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.902.930,40	2,11%	7.178	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	3.068.570,15	1,66%		1,65%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			185.262.487,99				

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

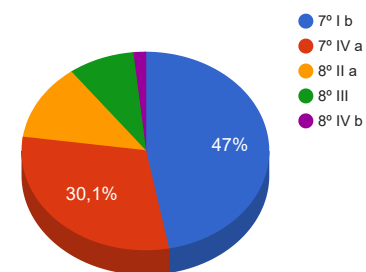
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	87.148.372,84	47,04%	15,00%	40,00%	90,00%	79.587.866,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	111.157.492,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	55.844.855,83	30,14%	5,00%	29,00%	40,00%	18.260.139,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	9.263.124,40
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	37.052.497,60
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	23.185.718,87	12,52%	0,00%	10,00%	20,00%	13.866.778,73
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	16.014.970,30	8,64%	0,00%	5,00%	10,00%	2.511.278,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	9.263.124,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.068.570,15	1,66%	0,00%	2,50%	5,00%	6.194.554,25
Total Carteira		185.262.487,99					

RENDA FIXA	142.993.228,67	77,18%
RENDA VARIÁVEL	42.269.259,32	22,82%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 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 "	87.148.372,84	47,04%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	55.844.855,83	30,14%	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 "	23.185.718,87	12,52%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	16.014.970,30	8,64%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.068.570,15	1,66%	0,00%	5,00%
Total	185.262.487,99	100,00%	20,00	285,00

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	108.498.590,07	58,56%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.498.811,16	25,64%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.322.667,91	6,11%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	6.267.494,02	3,38%	0,00%
WESTERN ASSET	3.902.930,40	2,11%	0,01%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.261.543,63	1,76%	0,46%
ZION Invest	3.068.570,15	1,66%	0,63%
BANCO J. SAFRA S/A	1.038.231,66	0,56%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	403.648,99	0,22%	0,00%

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%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,98%	7,82%	6,70%	7,82%	14,93%	18,84%	0,20%	2,161%	8,60%
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%

IRF-M	2,16%	6,98%	4,59%	6,98%	15,72%	26,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,15%	6,78%	4,49%	6,78%	15,56%	25,51%	0,20%	1,196%	4,10%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,14%	6,86%	4,54%	6,86%	15,51%	25,56%	0,20%	1,189%	3,82%

IMA Geral ex-C	1,95%	7,74%	4,69%	7,74%	15,64%	25,19%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	8,23%	5,14%	8,23%	15,98%	25,74%	0,30%	1,213%	3,59%

IMA-B 5	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,70%	7,16%	4,22%	7,16%	14,42%	25,32%	0,20%	1,349%	2,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,70%	7,17%	4,20%	7,17%	14,47%	25,32%	0,20%	1,343%	2,98%

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%

IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,10%	0,171%	0,49%

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

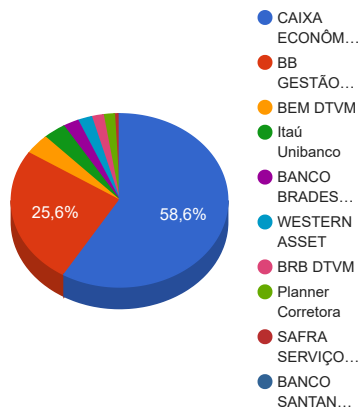
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SELIC	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,15%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	3,05%	1,53%	3,05%	6,24%	14,26%	0,20%	0,003%	0,11%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,46%	3,08%	1,55%	3,08%	6,26%	13,97%	0,20%	0,006%	0,12%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,46%	3,09%	1,52%	3,09%	6,31%	14,14%	0,20%	0,003%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,53%	1,27%	2,53%	5,19%	11,74%	1,00%	0,004%	0,10%
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	5,18%	2,17%	5,18%	9,49%	21,07%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,82%	8,27%	4,86%	8,27%	17,38%	29,02%	0,15%	1,510%	4,08%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
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%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,10%	7,71%	4,69%	7,71%	15,43%	-	0,40%	1,139%	3,50%

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

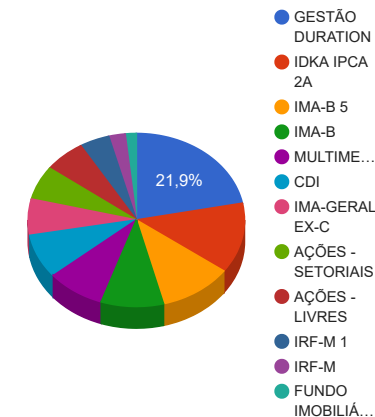
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,99%	19,26%	10,91%	19,26%	41,71%	61,51%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6,41%	17,36%	9,59%	17,36%	37,23%	55,63%	1,50%	6,190%	17,25%
S&P 500	6,89%	17,35%	3,79%	17,35%	8,22%	21,39%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7,12%	18,92%	4,73%	18,92%	12,44%	32,60%	1,00%	4,673%	18,51%
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%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,22%	18,16%	10,36%	18,16%	42,83%	74,12%	1,90%	7,359%	15,73%
BRADESCO 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%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,32%	9,97%	5,57%	9,97%	17,83%	28,99%	0,50%	1,757%	3,89%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,64%	3,52%	1,89%	3,52%	6,84%	15,58%	1,00%	0,195%	0,38%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	20,13%	4,07%	20,95%	4,07%	-26,94%	1,13%	1,60%	47,871%	32,55%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	108.498.590,07	58,56%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.498.811,16	25,64%
BEM DTVM	7.020.873,22	3,79%
Itaú Unibanco	6.267.494,02	3,38%
BANCO BRADESCO	4.301.794,69	2,32%
WESTERN ASSET	3.902.930,40	2,11%
BRB DTVM	3.261.543,63	1,76%
Planner Corretora	3.068.570,15	1,66%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	1.038.231,66	0,56%
BANCO SANTANDER	403.648,99	0,22%



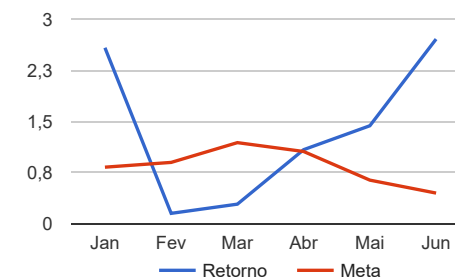
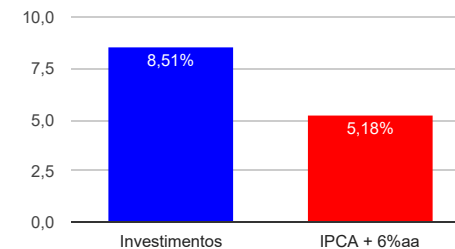
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	40.560.772,87	21,89%
IDKA IPCA 2A	24.323.123,69	13,13%
IMA-B 5	20.263.332,74	10,94%
IMA-B	17.230.440,99	9,30%
MULTIMERCADO	16.014.970,30	8,64%
CDI	15.284.082,96	8,25%
IMA-GERAL EX-C	12.478.874,50	6,74%
AÇÕES - SETORIAIS	11.706.647,90	6,32%
AÇÕES - LIVRES	11.479.070,97	6,20%
IRF-M 1	8.275.851,49	4,47%
IRF-M	4.576.749,43	2,47%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.068.570,15	1,66%



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%
Abril	167.481.116,75	13.955.347,40	13.971.624,50	169.284.762,47	1.819.922,82	1,09%	1,06%	102,56%	1,95%
Mai	169.284.762,47	10.511.294,90	11.574.563,67	170.655.361,35	2.433.867,65	1,44%	0,64%	224,42%	3,43%
Junho	170.655.361,35	10.878.585,27	1.157.622,26	185.262.487,99	4.886.163,63	2,71%	0,45%	601,52%	2,76%
Acumulado no ano					13.925.270,97	8,51%	5,18%	164,41%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.637.483,31	0,00	0,00	4.808.798,28	171.314,97	3,69%	2,31%	3,69%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.565.082,15	0,00	0,00	7.790.744,06	225.661,91	2,98%	2,16%	2,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	28.934.805,48	6.809.560,78	0,00	36.688.483,68	944.117,42	2,64%	1,65%	2,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.764.349,55	0,00	0,00	1.809.296,27	44.946,72	2,55%	1,49%	2,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.213.810,25	0,00	0,00	12.478.874,50	265.064,25	2,17%	1,21%	2,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.026.614,71	0,00	0,00	2.070.118,58	43.503,87	2,15%	1,20%	2,15%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.454.111,73	0,00	0,00	2.506.630,85	52.519,12	2,14%	1,19%	2,14%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.020.626,37	0,00	0,00	2.062.992,92	42.366,55	2,10%	1,14%	2,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.164.614,85	0,00	0,00	4.240.456,56	75.841,71	1,82%	1,51%	1,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.330.170,78	0,00	0,00	5.420.801,75	90.630,97	1,70%	1,35%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.594.675,10	0,00	0,00	14.842.530,99	247.855,89	1,70%	1,34%	1,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.161.135,30	0,00	0,00	13.321.558,22	160.422,92	1,22%	0,95%	1,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.881.276,14	0,00	0,00	11.001.565,47	120.289,33	1,11%	0,91%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	386.499,22	0,00	0,00	390.442,09	3.942,87	1,02%	0,78%	1,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.228.740,32	0,00	0,00	8.275.851,49	47.111,17	0,57%	0,17%	0,57%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.228.339,20	0,00	0,00	2.238.801,77	10.462,57	0,47%	0,00%	0,47%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	428.756,27	0,00	27.000,00	403.648,99	1.892,72	0,44%	0,00%	0,46%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	6.478.488,47	3.010.924,00	62.000,00	9.457.443,75	30.031,28	0,32%	0,01%	0,46%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.181.628,11	1.058.100,49	1.068.622,26	3.184.188,45	13.082,11	0,31%	0,00%	0,39%
Total Renda Fixa					2.591.058,35	1,85%	1,21%	

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(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.554.284,65	0,00	0,00	3.068.570,15	514.285,50	20,13%	47,87%	20,13%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.157.868,49	0,00	0,00	4.458.197,75	300.329,26	7,22%	7,36%	7,22%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.643.523,02	0,00	0,00	3.902.930,40	259.407,38	7,12%	4,67%	7,12%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	969.630,20	0,00	0,00	1.038.231,66	68.601,46	7,08%	4,64%	7,08%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	11.001.755,19	0,00	0,00	11.706.647,90	704.892,71	6,41%	6,19%	6,41%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	6.771.299,42	0,00	0,00	7.020.873,22	249.573,80	3,69%	7,10%	3,69%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.634.877,59	0,00	0,00	7.812.264,61	177.387,02	2,32%	1,76%	2,32%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.240.915,48	0,00	0,00	3.261.543,63	20.628,15	0,64%	0,19%	0,64%
Total Renda Variável					2.295.105,28	5,74%	8,03%	

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 (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	24.893.167,17	9.809.560,78	0,00	36.688.483,68	1.985.755,73	6,47%	6,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.869.006,64	0,00	0,00	12.478.874,50	609.867,86	5,14%	5,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.312.614,62	7.000.000,00	0,00	14.842.530,99	529.916,37	3,70%	4,20%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.301.611,56	0,00	0,00	7.790.744,06	489.132,50	6,70%	6,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.373.980,37	0,00	3.000.000,00	4.808.798,28	434.817,91	8,93%	9,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.914.459,89	3.000.000,00	0,00	13.321.558,22	407.098,33	3,15%	3,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.661.486,33	0,00	0,00	11.001.565,47	340.079,14	3,19%	3,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.201.461,34	0,00	0,00	5.420.801,75	219.340,41	4,22%	4,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.043.994,59	0,00	0,00	4.240.456,56	196.461,97	4,86%	4,86%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	19.519.168,90	5.937.927,19	16.181.500,00	9.457.443,75	181.847,66	1,26%	1,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.135.399,12	0,00	0,00	8.275.851,49	140.452,37	1,73%	1,73%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.397.855,74	0,00	0,00	2.506.630,85	108.775,11	4,54%	4,54%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.981.095,23	0,00	0,00	2.070.118,58	89.023,35	4,49%	4,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.132.390,03	598.302,34	0,00	1.809.296,27	78.603,90	4,78%	5,08%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.062.992,92	62.992,92	3,15%	4,69%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.125.592,42	2.998.475,85	2.982.685,49	3.184.188,45	42.805,67	1,03%	1,27%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.205.039,47	0,00	0,00	2.238.801,77	33.762,30	1,53%	1,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	378.969,20	0,00	0,00	390.442,09	11.472,89	3,03%	3,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	589.416,25	0,00	597.656,19	0,00	8.239,94	1,40%	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	449.137,37	0,00	52.000,00	403.648,99	6.511,62	1,47%	1,52%
Total Renda Fixa					5.976.957,95	4,53%	

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 (%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.681.791,42	0,00	0,00	11.706.647,90	1.024.856,48	9,59%	9,59%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.537.141,80	0,00	0,00	3.068.570,15	531.428,35	20,95%	20,95%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	4.000.961,41	0,00	4.458.197,75	457.236,34	11,43%	10,36%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.399.911,12	0,00	0,00	7.812.264,61	412.353,49	5,57%	5,57%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	6.626.830,49	0,00	0,00	7.020.873,22	394.042,73	5,95%	5,95%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.726.648,90	0,00	0,00	3.902.930,40	176.281,50	4,73%	4,73%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.201.028,80	0,00	0,00	3.261.543,63	60.514,83	1,89%	1,89%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.830.593,44	0,00	3.889.968,75	0,00	59.375,31	1,55%	5,67%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	991.324,54	0,00	0,00	1.038.231,66	46.907,12	4,73%	4,73%
Total Renda Variável					3.162.996,15	8,09%	

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.064.911,48	16.809.560,78	0,00	36.688.483,68	2.814.011,42	10,14%	10,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.530.406,55	0,00	0,00	12.478.874,50	948.467,95	8,23%	8,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.988.105,73	0,00	3.000.000,00	4.808.798,28	820.692,55	14,95%	15,08%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.225.941,85	0,00	191.539,25	7.790.744,06	756.341,46	10,67%	7,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.110.321,89	7.000.000,00	0,00	14.842.530,99	732.209,10	6,65%	7,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.672.240,46	3.000.000,00	0,00	13.321.558,22	649.317,76	5,74%	5,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.402.272,63	0,00	0,00	11.001.565,47	599.292,84	5,76%	5,76%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.392.118,55	17.603.786,91	31.975.500,00	9.457.443,75	437.038,29	2,53%	3,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.058.532,60	0,00	0,00	5.420.801,75	362.269,15	7,16%	7,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.020.297,55	0,00	106.243,63	4.240.456,56	326.402,64	8,27%	8,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.384.120,14	1.648.667,18	0,00	8.275.851,49	243.064,17	3,15%	3,21%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.345.718,14	0,00	0,00	2.506.630,85	160.912,71	6,86%	6,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.938.674,50	0,00	0,00	2.070.118,58	131.444,08	6,78%	6,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.098.118,31	598.302,34	0,00	1.809.296,27	112.875,62	8,05%	8,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.663.164,72	5.416.517,30	5.977.179,08	3.184.188,45	81.685,51	1,99%	2,53%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.172.613,14	0,00	0,00	2.238.801,77	66.188,63	3,05%	3,05%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.062.992,92	62.992,92	3,15%	7,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	571.561,15	0,00	597.656,19	0,00	26.095,04	4,57%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	379.898,10	0,00	10.477,03	390.442,09	21.021,02	5,64%	5,64%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.001.980,65	535.000,00	1.152.000,00	403.648,99	18.668,34	2,78%	3,09%
Total Renda Fixa					9.370.991,20	7,43%	

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 (%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.340.062,78	5.000.000,00	0,00	11.706.647,90	1.366.585,12	13,22%	17,36%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	6.310.016,42	0,00	0,00	7.020.873,22	710.856,80	11,27%	11,27%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.184.039,74	3.000.000,00	0,00	7.812.264,61	628.224,87	8,74%	9,97%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.282.081,23	0,00	0,00	3.902.930,40	620.849,17	18,92%	18,92%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	4.000.961,41	0,00	4.458.197,75	457.236,34	11,43%	18,16%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.505.244,42	0,00	3.889.968,75	0,00	384.724,33	10,98%	15,48%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	873.979,48	0,00	0,00	1.038.231,66	164.252,18	18,79%	18,79%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.150.503,01	0,00	0,00	3.261.543,63	111.040,62	3,52%	3,52%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.958.059,81	0,00	0,00	3.068.570,15	110.510,34	3,74%	4,07%
Total Renda Variável					4.554.279,77	12,09%	