

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
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.463.740,00	1,22%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.337.308,43	6,93%	104	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.166.966,79	3,46%	873	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	36.778,40	0,03%	61	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.025.501,20	4,17%	1.419	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.577.746,24	4,63%	920	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.391.946,36	4,48%	576	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.490.037,07	3,73%	1.250	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.188.434,00	1,82%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.812.700,25	4,00%	62	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.983.416,00	4,97%	889	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.622.596,52	7,16%	245	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	889.821,56	0,74%	744	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.010.691,46	1,67%	95	1,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.807.080,05	1,50%	125	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	11.090.476,15	9,21%	560	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.641.891,16	1,36%	821	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	9.494.939,29	7,89%	33	10,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	822.120,00	0,68%	76	0,51%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	5.724.191,53	4,75%	150	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	3.626.642,11	3,01%	29.937	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	983.952,20	0,82%	4.554	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

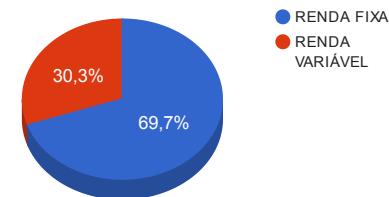
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.078.609,37	2,56%	4.851	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	3.167.983,68	2,63%	139	1,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	1.473.273,79	1,22%	118	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	4.702.376,89	3,91%	197	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.174.783,37	3,47%	6.064	0,31%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.040.750,03	3,36%	4.506	0,52%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.413.740,26	2,84%	77	2,34%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	2.049.834,30	1,70%		1,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	100.709,83	0,08%	750	0,63%	Desenquadrado - RF
Total			120.391.038,29				

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

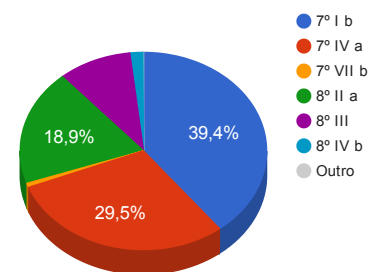
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	47.474.574,74	39,43%	15,00%	25,00%	70,00%	36.799.152,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	72.234.622,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	35.557.496,19	29,54%	10,00%	30,00%	40,00%	12.598.919,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.019.551,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	822.120,00	0,68%	0,00%	0,00%	5,00%	5.197.431,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	22.757.029,57	18,90%	7,00%	10,00%	20,00%	1.321.178,09
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.629.273,66	9,66%	7,00%	10,00%	10,00%	409.830,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.019.551,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.049.834,30	1,70%	2,00%	5,00%	5,00%	3.969.717,61
Desenquadrado - RF	0,00%	100.709,83	0,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-100.709,83
Total Carteira		120.391.038,29					

RENDA FIXA	83.954.900,76	69,74%
RENDA VARIÁVEL	36.436.137,53	30,26%

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 "	47.474.574,74	39,43%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	35.557.496,19	29,54%	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 "	822.120,00	0,68%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	22.757.029,57	18,90%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.629.273,66	9,66%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.049.834,30	1,70%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	100.709,83	0,08%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	120.391.038,29	100,00%	50,00	240,00

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	44.058.692,45	36,60%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	24.629.988,86	20,46%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.412.045,57	13,63%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	14.919.371,01	12,39%	2,11%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.039.685,32	10,83%	0,00%
META ASSET MANAGEMENT	3.167.983,68	2,63%	1,39%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.078.609,37	2,56%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	983.952,20	0,82%	0,16%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	100.709,83	0,08%	0,40%

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 5+	5,06%	21,12%	12,50%	21,12%	40,78%	49,39%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,90%	4,92%	2,25%	4,92%	12,56%	24,28%	0,50%	0,421%	3,86%
IMA-B	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,98%	7,82%	6,70%	7,82%	14,93%	18,83%	0,20%	2,161%	8,60%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	1,50%	2,10%	1,50%	3,96%	9,18%	0,20%	0,461%	4,62%
IRF-M 1+	2,72%	8,35%	5,62%	8,35%	19,18%	30,24%	-	-	-
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%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,82%	6,65%	4,37%	6,65%	15,16%	27,69%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,90%	6,62%	4,44%	6,62%	14,87%	26,97%	0,20%	1,095%	3,51%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,70%	7,12%	4,21%	7,12%	14,24%	24,84%	0,18%	1,345%	2,96%
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%	-	-	-

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

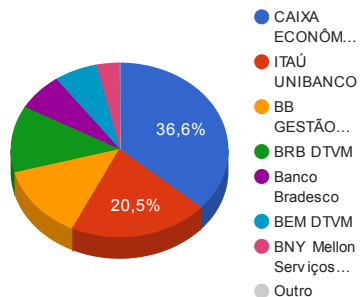
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,23%	1,74%	3,23%	7,09%	15,23%	0,20%	0,148%	0,49%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,57%	3,19%	1,69%	3,19%	6,99%	15,09%	0,18%	0,148%	0,44%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,56%	3,41%	1,76%	3,41%	7,05%	15,47%	0,75%	0,158%	0,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,46%	3,01%	1,51%	3,01%	6,19%	13,85%	0,18%	0,002%	0,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	3,01%	1,50%	3,01%	6,19%	14,07%	0,20%	0,003%	0,11%
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%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,78%	9,90%	6,44%	9,90%	16,31%	23,14%	0,20%	2,042%	3,04%
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 definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,44%	-13,31%	-15,76%	-13,31%	22,78%	41,58%	2,00%	0,162%	30,41%

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

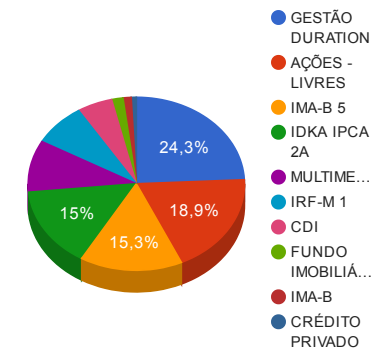
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	4,10%	15,59%	6,40%	15,59%	40,78%	61,42%	-	-	-
META VALOR FIAÇÕES	5,89%	9,82%	3,78%	9,82%	36,52%	72,40%	2,50%	8,597%	20,12%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,22%	18,16%	10,36%	18,16%	42,83%	74,12%	1,90%	7,359%	15,73%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	5,14%	18,26%	9,17%	18,26%	49,84%	76,57%	2,00%	6,380%	20,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,88%	15,08%	8,88%	15,08%	41,60%	76,02%	2,50%	6,804%	17,18%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	3,69%	11,27%	5,95%	11,27%	37,92%	78,11%	1,50%	7,101%	13,89%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,39%	9,97%	5,70%	9,97%	32,46%	71,65%	2,00%	7,647%	16,33%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2,89%	21,90%	7,96%	21,90%	59,91%	-	2,00%	6,580%	23,97%
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1,18%	2,24%	0,98%	2,24%	12,66%	-3,55%	1,20%	2,628%	9,90%
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%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,49%	6,33%	2,94%	6,33%	14,39%	25,65%	1,00%	2,391%	4,72%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,64%	3,52%	1,89%	3,52%	6,84%	15,58%	1,00%	0,195%	0,38%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	44.058.692,45	36,60%
ITAÚ UNIBANCO	24.629.988,86	20,46%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.412.045,57	13,63%
BRB DTVM	14.919.371,01	12,39%
Banco Bradesco	8.337.308,43	6,93%
BEM DTVM	7.780.986,26	6,46%
BNY Mellon Serviços Financeiros	4.151.935,88	3,45%
ICLA Trust	100.709,83	0,08%



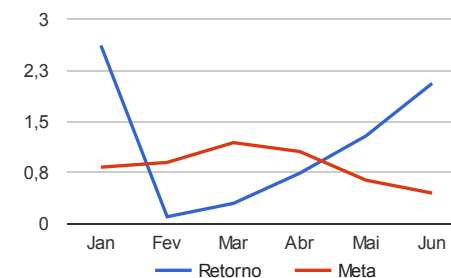
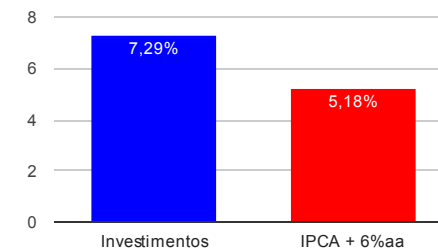
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	29.208.011,96	24,26%
AÇÕES - LIVRES	22.757.029,57	18,90%
IMA-B 5	18.376.496,61	15,26%
IDKA IPCA 2A	18.082.021,46	15,02%
MULTIMERCADO	11.629.273,66	9,66%
IRF-M 1	9.552.316,67	7,93%
CDI	6.349.484,23	5,27%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.049.834,30	1,70%
IMA-B	1.463.740,00	1,22%
CRÉDITO PRIVADO	922.829,83	0,77%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	106.357.825,78	7.728.849,03	6.774.629,06	110.118.337,44	2.806.291,69	2,62%	0,83%	314,45%	1,99%
Fevereiro	110.118.337,44	2.527.768,76	1.547.700,70	111.213.080,08	114.674,58	0,10%	0,90%	11,53%	2,36%
Março	111.213.080,08	1.560.630,70	718.884,05	112.390.132,85	335.306,12	0,30%	1,19%	25,07%	3,34%
Abril	112.390.132,85	8.140.343,39	7.038.736,83	114.332.284,75	840.545,34	0,74%	1,06%	69,90%	1,85%
Mai	114.332.284,75	10.581.791,67	9.298.965,83	117.103.777,28	1.488.666,69	1,29%	0,64%	200,98%	4,22%
Junho	117.103.777,28	11.812.666,31	10.953.598,85	120.391.038,29	2.428.193,55	2,06%	0,45%	457,09%	2,26%
Acumulado no ano					8.013.677,97	7,29%	5,18%	140,83%	

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 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.421.359,00	0,00	0,00	1.463.740,00	42.381,00	2,98%	2,16%	2,98%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	799.881,00	0,00	0,00	822.120,00	22.239,00	2,78%	2,04%	2,78%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.795.247,59	0,00	0,00	11.090.476,15	295.228,56	2,73%	1,65%	2,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.408.393,08	0,00	0,00	8.622.596,52	214.203,44	2,55%	1,49%	2,55%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	8.181.520,88	0,00	0,00	8.337.308,43	155.787,55	1,90%	1,10%	1,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.301.797,82	0,00	0,00	5.391.946,36	90.148,54	1,70%	1,35%	1,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	4.732.269,29	0,00	0,00	4.812.700,25	80.430,96	1,70%	1,34%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.349.104,56	527.533,24	2.000.000,00	5.983.416,00	106.778,20	1,36%	1,34%	1,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.509.156,16	0,00	0,00	5.577.746,24	68.590,08	1,25%	0,95%	1,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.121.405,86	0,00	0,00	4.166.966,79	45.560,93	1,11%	0,91%	1,11%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.410.122,41	0,00	0,00	9.494.939,29	84.816,88	0,90%	0,42%	0,90%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.175.184,50	0,00	0,00	2.188.434,00	13.249,50	0,61%	0,46%	0,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.464.477,05	0,00	0,00	4.490.037,07	25.560,02	0,57%	0,17%	0,57%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.999.542,95	0,00	0,00	2.010.691,46	11.148,51	0,56%	0,16%	0,56%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	165.889,10	0,00	130.000,00	36.778,40	889,30	0,54%	0,15%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.513.956,94	477.040,87	2.000.000,00	5.025.501,20	34.503,39	0,49%	0,15%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	869.417,48	16.373,11	0,00	889.821,56	4.030,97	0,46%	0,00%	0,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.553.750,77	80.812,36	0,00	1.641.891,16	7.328,03	0,45%	0,00%	0,45%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	100.265,04	0,00	0,00	100.709,83	444,79	0,44%	0,16%	0,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1.895.849,02	494.582,82	591.905,20	1.807.080,05	8.553,41	0,36%	0,00%	0,46%
				Total Renda Fixa	1.311.873,06	1,53%	0,99%	

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(%)
META VALOR FI AÇÕES	2.991.636,11	0,00	0,00	3.167.983,68	176.347,57	5,89%	8,60%	5,89%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	935.831,49	0,00	0,00	983.952,20	48.120,71	5,14%	6,38%	5,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.457.613,34	0,00	0,00	5.724.191,53	266.578,19	4,88%	6,80%	4,88%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.379.443,03	2.087.628,98	0,00	3.626.642,11	159.570,10	4,60%	7,36%	7,22%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	4.535.219,60	0,00	0,00	4.702.376,89	167.157,29	3,69%	7,10%	3,69%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.977.764,66	0,00	0,00	3.078.609,37	100.844,71	3,39%	7,65%	3,39%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.431.929,79	0,00	0,00	1.473.273,79	41.344,00	2,89%	6,58%	2,89%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.039.940,00	0,00	14.000,00	2.049.834,30	23.894,30	1,17%	2,63%	1,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	4.128.694,93	0,00	4.174.783,37	46.088,44	1,12%	1,76%	2,32%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	4.000.000,00	0,00	4.040.750,03	40.750,03	1,02%	2,39%	1,49%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.392.149,50	0,00	0,00	3.413.740,26	21.590,76	0,64%	0,19%	0,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	2.078.266,93	0,00	2.087.622,81	0,00	9.355,88	0,45%	0,25%	0,75%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	4.115.392,33	0,00	4.130.070,84	0,00	14.678,51	0,36%	0,27%	0,60%
Total Renda Variável					1.116.320,49	3,16%	5,18%	

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	10.394.341,84	0,00	0,00	11.090.476,15	696.134,31	6,70%	6,70%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.982.901,20	0,00	0,00	8.337.308,43	354.407,23	4,44%	4,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	8.329.377,20	0,00	8.622.596,52	293.219,32	3,52%	5,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.172.436,35	527.533,24	2.000.000,00	5.983.416,00	283.446,41	3,85%	4,20%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.173.773,52	0,00	0,00	5.391.946,36	218.172,84	4,22%	4,22%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.286.224,64	0,00	0,00	9.494.939,29	208.714,65	2,25%	2,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	4.618.448,33	0,00	0,00	4.812.700,25	194.251,92	4,21%	4,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.118.427,94	277.249,24	0,00	5.577.746,24	182.069,06	3,37%	3,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.005.174,91	50.024,03	16.867,95	4.166.966,79	128.635,80	3,18%	3,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	9.570.467,84	0,00	9.692.782,78	0,00	122.314,94	1,38%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.439.330,35	477.040,87	2.000.000,00	5.025.501,20	109.129,98	1,66%	1,74%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.371.891,00	0,00	0,00	1.463.740,00	91.849,00	6,70%	6,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.413.835,08	0,00	0,00	4.490.037,07	76.201,99	1,73%	1,73%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	772.359,50	0,00	0,00	822.120,00	49.760,50	6,44%	6,44%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.143.416,00	0,00	0,00	2.188.434,00	45.018,00	2,10%	2,10%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.975.846,28	0,00	0,00	2.010.691,46	34.845,18	1,76%	1,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	227.774,61	3.075.158,67	1.516.129,26	1.807.080,05	20.276,03	0,91%	1,51%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	403.447,30	1.258.842,81	34.689,08	1.641.891,16	14.290,13	1,05%	1,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	326.063,67	663.616,65	108.873,86	889.821,56	9.015,10	1,31%	1,50%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	164.063,46	0,00	130.000,00	36.778,40	2.714,94	1,65%	1,69%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	119.549,76	0,00	0,00	100.709,83	-18.839,93	-15,76%	-15,76%
Total Renda Fixa					3.115.627,40	3,73%	

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 (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.257.137,22	0,00	0,00	5.724.191,53	467.054,31	8,88%	8,88%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.841.426,12	2.568.000,80	0,00	4.702.376,89	292.949,97	6,64%	5,95%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	3.411.893,11	0,00	3.626.642,11	214.749,00	8,96%	10,36%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.912.540,21	0,00	0,00	3.078.609,37	166.069,16	5,70%	5,70%
META VALOR FI AÇÕES	3.052.557,35	0,00	0,00	3.167.983,68	115.426,33	3,78%	3,78%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	617.323,72	767.369,82	0,00	1.473.273,79	88.580,25	6,40%	7,96%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	901.334,61	0,00	0,00	983.952,20	82.617,59	9,17%	9,17%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	3.062.451,96	1.000.000,00	4.130.070,84	0,00	67.618,88	1,66%	1,97%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.350.401,55	0,00	0,00	3.413.740,26	63.338,71	1,89%	1,89%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.044.000,00	0,00	42.000,00	2.049.834,30	47.834,30	2,36%	0,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.680.684,89	0,00	3.727.622,81	0,00	46.937,92	1,68%	2,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	4.128.694,93	0,00	4.174.783,37	46.088,44	1,12%	5,57%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	4.000.000,00	0,00	4.040.750,03	40.750,03	1,02%	2,94%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.359.271,67	0,00	1.324.264,13	0,00	-35.007,54	-2,58%	8,79%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.631.229,97	0,00	2.568.000,80	0,00	-63.229,17	-2,40%	4,92%
Total Renda Variável					1.641.778,18	4,88%	

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	9.469.942,30	1.224.841,51	689.699,23	11.090.476,15	1.085.391,57	10,65%	10,92%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.819.323,87	0,00	0,00	8.337.308,43	517.984,56	6,62%	6,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.602.796,14	1.101.341,38	2.195.834,55	5.983.416,00	475.113,03	6,75%	7,17%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.049.511,69	0,00	0,00	9.494.939,29	445.427,60	4,92%	4,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	8.442.225,03	852.000,00	9.692.782,78	0,00	398.557,75	4,40%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.267.366,95	775.656,42	0,00	5.391.946,36	348.922,99	7,11%	7,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	4.149.558,40	348.671,77	0,00	4.812.700,25	314.470,08	7,11%	7,12%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.987.761,08	858.188,54	1.580.939,30	5.577.746,24	312.735,92	5,73%	5,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	8.329.377,20	0,00	8.622.596,52	293.219,32	3,52%	8,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.639.456,17	325.766,06	16.867,95	4.166.966,79	218.612,51	5,69%	5,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.346.424,25	1.221.775,39	2.744.734,52	5.025.501,20	202.036,08	3,09%	3,23%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.357.630,00	0,00	35.890,98	1.463.740,00	142.000,98	10,66%	7,82%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.396.589,72	5.209,51	51.904,10	4.490.037,07	140.141,94	3,21%	3,21%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.156.023,50	0,00	59.032,91	2.188.434,00	91.443,41	4,32%	1,50%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	748.032,00	0,00	0,00	822.120,00	74.088,00	9,90%	9,90%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1.944.361,76	0,00	0,00	2.010.691,46	66.329,70	3,41%	3,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.516.983,01	2.378.212,15	2.281.397,39	1.641.891,16	28.093,39	2,26%	3,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	245.974,60	4.927.158,67	3.390.229,31	1.807.080,05	24.176,09	1,93%	3,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	572.341,44	663.616,65	362.425,17	889.821,56	16.288,64	2,74%	3,01%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	161.673,43	0,00	130.000,00	36.778,40	5.104,97	3,16%	3,19%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	116.167,98	0,00	0,00	100.709,83	-15.458,15	-13,31%	-13,31%
Total Renda Fixa					5.184.680,38	6,44%	

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 (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4.974.062,15	0,00	0,00	5.724.191,53	750.129,38	15,08%	15,08%
META VALOR FIAÇÕES	2.884.729,88	0,00	0,00	3.167.983,68	283.253,80	9,82%	9,82%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	0,00	4.421.868,90	0,00	4.702.376,89	280.507,99	5,37%	11,27%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.799.396,54	0,00	0,00	3.078.609,37	279.212,83	9,97%	9,97%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	3.411.893,11	0,00	3.626.642,11	214.749,00	8,96%	18,16%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	832.053,58	0,00	0,00	983.952,20	151.898,62	18,26%	18,26%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRH11	2.018.720,00	0,00	90.000,00	2.049.834,30	121.114,30	6,07%	2,24%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.297.518,04	0,00	0,00	3.413.740,26	116.222,22	3,52%	3,52%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.459.029,92	0,00	2.568.000,80	0,00	108.970,88	4,43%	12,27%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	3.022.318,04	1.000.000,00	4.130.070,84	0,00	107.752,80	3,01%	3,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.191.128,96	1.000.000,00	4.297.622,81	0,00	106.493,85	3,13%	3,67%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.377.777,67	0,00	1.473.273,79	95.496,12	7,60%	21,90%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.256.306,89	0,00	1.324.264,13	0,00	67.957,24	5,41%	17,70%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	632.418,46	0,00	690.818,55	0,00	58.400,09	9,23%	15,05%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	4.128.694,93	0,00	4.174.783,37	46.088,44	1,12%	9,97%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	4.000.000,00	0,00	4.040.750,03	40.750,03	1,02%	6,33%
Total Renda Variável					2.828.997,59	9,31%	