

# 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 IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.635.707,95	1,25%	220	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	8.109.336,78	6,18%	576	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.277.568,97	3,26%	616	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.387.653,87	4,11%	1.419	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.437.047,09	2,62%	104	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.935.013,30	5,28%	507	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.486.141,47	7,99%	889	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.488.802,50	9,52%	873	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.285.828,51	3,27%	920	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.019.940,43	3,06%	909	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.297.223,50	2,51%	115	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	4.080.933,55	3,11%	292	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	3.104.592,58	2,37%	33	3,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.521.030,81	1,92%	328	0,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.183.960,74	0,90%	821	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	541.561,72	0,41%	95	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	376.185,31	0,29%	185	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.305.475,33	4,04%	115	0,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.683.113,31	8,14%	560	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.584.996,30	1,97%	31	1,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.657.266,53	2,02%	76	1,65%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.511.691,72	4,96%	1.517	2,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

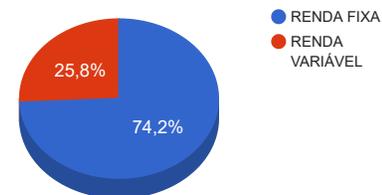
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.477.797,56	1,89%	6.711	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.633.646,74	2,01%	4.554	1,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	Não informado	Não há	2.066.128,37	1,57%	12.441	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	6.678.047,05	5,09%	139	3,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.034.853,50	0,79%	921	1,92%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.615.390,54	5,04%	77	4,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	1.655.901,85	1,26%	729	0,60%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	2.064.885,22	1,57%	4.581	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	2.088.401,95	1,59%		1,13%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total</b>			<b>131.226.125,05</b>				

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

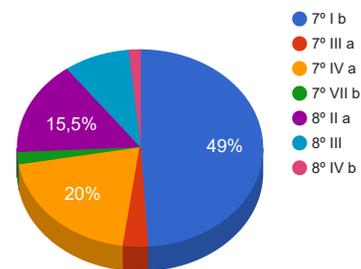
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	64.360.264,37	49,05%	20,00%	40,00%	100,00%	66.865.860,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	4.080.933,55	3,11%	0,00%	10,00%	60,00%	74.654.741,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	26.300.916,10	20,04%	5,00%	25,00%	40,00%	26.189.533,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.657.266,53	2,02%	0,00%	0,00%	5,00%	3.904.039,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	20.367.311,44	15,52%	0,00%	15,00%	20,00%	5.877.913,57
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.371.031,11	8,67%	0,00%	8,00%	10,00%	1.751.581,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.088.401,95	1,59%	0,00%	2,00%	5,00%	4.472.904,30
<b>Total Carteira</b>		<b>131.226.125,05</b>					

RENDA FIXA	97.399.380,55	74,22%
RENDA VARIÁVEL	33.826.744,50	25,78%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	64.360.264,37	49,05%	20,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	4.080.933,55	3,11%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	26.300.916,10	20,04%	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 "	2.657.266,53	2,02%	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 I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20.367.311,44	15,52%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.371.031,11	8,67%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.088.401,95	1,59%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>131.226.125,05</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00</b>	<b>335,00</b>

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	49.632.332,52	37,82%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.107.945,05	26,75%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	10.261.544,84	7,82%	1,45%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.118.707,73	6,95%	0,00%
META ASSET MANAGEMENT	6.678.047,05	5,09%	2,94%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	6.511.691,72	4,96%	0,01%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	4.651.124,67	3,54%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.542.682,78	3,46%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.633.646,74	2,01%	0,42%
ZION Invest	2.088.401,95	1,59%	0,43%

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%	-	-	-
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%
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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,68%	14,95%	8,98%	14,95%	28,36%	38,56%	0,20%	2,299%	7,56%
IMA Geral	2,00%	7,90%	4,78%	7,90%	15,90%	25,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,92%	7,58%	4,61%	7,58%	15,44%	24,63%	0,20%	1,018%	3,44%
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%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,93%	7,60%	4,61%	7,60%	15,38%	24,62%	0,20%	1,024%	3,38%
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%
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%	-	-	-

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

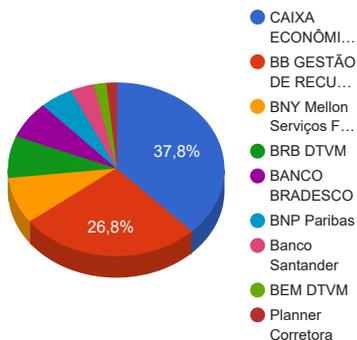
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,98%	3,39%	5,98%	12,17%	23,08%	0,20%	0,954%	1,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,76%	3,19%	5,76%	11,97%	22,82%	0,20%	0,911%	1,98%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
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%
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%
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%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,45%	2,94%	1,47%	2,94%	6,04%	13,59%	0,20%	0,001%	0,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,80%	0,000%	0,11%
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2,25%	8,47%	5,11%	8,47%	12,66%	17,28%	0,40%	1,335%	2,26%
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)

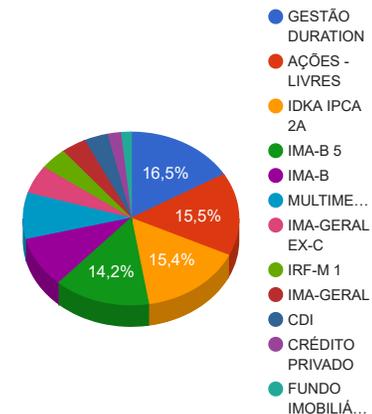
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,99%	19,26%	10,91%	19,26%	41,71%	61,51%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,50%	11,30%	9,50%	11,30%	35,83%	80,50%	2,00%	6,583%	18,02%
S&P 500	6,89%	17,35%	3,79%	17,35%	8,22%	21,39%	-	-	-
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,09%	18,63%	4,69%	18,63%	-	-	1,20%	4,694%	-
IBX	4,10%	15,59%	6,40%	15,59%	40,78%	61,42%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	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%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	5,14%	18,26%	9,17%	18,26%	49,84%	76,57%	2,00%	6,380%	20,46%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,69%	23,70%	9,25%	23,70%	40,41%	36,97%	2,00%	4,940%	21,68%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	3,63%	13,89%	6,92%	13,89%	39,00%	-	2,00%	7,539%	17,09%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,48%	2,61%	1,43%	2,61%	7,71%	-	1,60%	0,168%	1,88%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	1,05%	1,93%	1,43%	1,93%	-	-	1,50%	0,944%	1,58%
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	49.632.332,52	37,82%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.107.945,05	26,75%
BNY Mellon Serviços Financeiros	11.376.579,01	8,67%
BRB DTVM	10.261.544,84	7,82%
BANCO BRADESCO	9.118.707,73	6,95%
BNP Paribas	6.511.691,72	4,96%
Banco Santander	4.651.124,67	3,54%
BEM DTVM	2.477.797,56	1,89%
Planner Corretora	2.088.401,95	1,59%



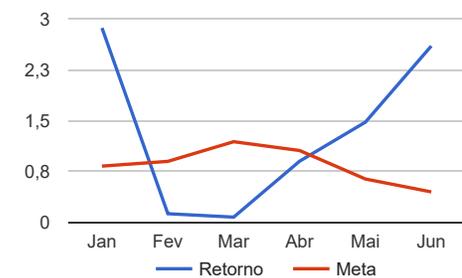
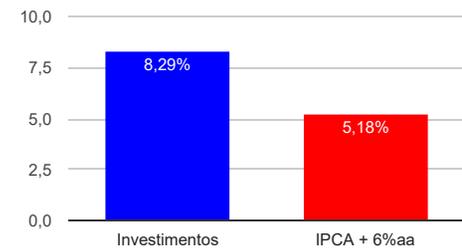
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	21.678.177,52	16,52%
AÇÕES - LIVRES	20.367.311,44	15,52%
IDKA IPCA 2A	20.211.678,10	15,40%
IMA-B 5	18.595.478,25	14,17%
IMA-B	12.378.442,95	9,43%
MULTIMERCADO	11.371.031,11	8,67%
IMA-GERAL EX-C	6.935.013,30	5,28%
IRF-M 1	5.387.653,87	4,11%
IMA-GERAL	4.932.931,45	3,76%
CDI	4.622.738,58	3,52%
CRÉDITO PRIVADO	2.657.266,53	2,02%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.088.401,95	1,59%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	107.384.837,09	31.180.953,25	26.544.255,19	115.232.636,11	3.211.100,96	2,87%	0,83%	344,69%	2,08%
Fevereiro	115.232.636,11	2.089.144,18	559.429,07	116.912.138,93	149.787,71	0,13%	0,90%	14,33%	2,03%
Março	116.912.138,93	2.448.920,14	558.629,09	118.895.200,01	92.770,03	0,08%	1,19%	6,54%	3,35%
Abril	118.895.200,01	5.112.697,92	3.098.745,05	121.999.739,09	1.090.586,21	0,90%	1,06%	85,13%	1,89%
Mai	121.999.739,09	9.144.836,41	7.110.148,95	125.868.007,95	1.833.581,40	1,48%	0,64%	230,75%	5,08%
Junho	125.868.007,95	5.033.637,16	3.001.459,69	131.226.125,05	3.325.939,63	2,60%	0,45%	577,43%	2,80%
Acumulado no ano					9.703.765,94	8,29%	5,18%	160,12%	

**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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.124.393,37	0,00	0,00	4.277.568,97	153.175,60	3,71%	2,33%	3,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.876.728,78	0,00	0,00	4.019.940,43	143.211,65	3,69%	2,31%	3,69%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.935.999,00	0,00	0,00	4.080.933,55	144.934,55	3,68%	2,30%	3,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.585.385,36	0,00	0,00	2.657.266,53	71.881,17	2,78%	2,04%	2,78%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	10.398.728,74	0,00	0,00	10.683.113,31	284.384,57	2,73%	1,65%	2,73%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.527.997,96	0,00	0,00	2.584.996,30	56.998,34	2,25%	1,33%	2,25%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.787.706,42	0,00	0,00	6.935.013,30	147.306,88	2,17%	1,21%	2,17%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.196.519,72	0,00	0,00	5.305.475,33	108.955,61	2,10%	1,14%	2,10%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.234.787,38	0,00	0,00	3.297.223,50	62.436,12	1,93%	1,02%	1,93%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.604.910,77	0,00	0,00	1.635.707,95	30.797,18	1,92%	1,02%	1,92%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.372.823,84	0,00	0,00	3.437.047,09	64.223,25	1,90%	1,10%	1,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.973.755,90	0,00	0,00	8.109.336,78	135.580,88	1,70%	1,35%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.311.033,05	0,00	0,00	10.486.141,47	175.108,42	1,70%	1,34%	1,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.234.217,05	0,00	0,00	4.285.828,51	51.611,46	1,22%	0,95%	1,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.352.251,97	0,00	0,00	12.488.802,50	136.550,53	1,11%	0,91%	1,11%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	3.076.859,72	0,00	0,00	3.104.592,58	27.732,86	0,90%	0,42%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.356.934,06	0,00	0,00	5.387.653,87	30.719,81	0,57%	0,15%	0,57%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	538.558,97	0,00	0,00	541.561,72	3.002,75	0,56%	0,16%	0,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.178.608,74	0,00	0,00	1.183.960,74	5.352,00	0,45%	0,00%	0,45%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	374.504,41	0,00	0,00	376.185,31	1.680,90	0,45%	0,00%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	482.173,07	2.633.049,97	600.872,50	2.521.030,81	6.680,27	0,21%	0,00%	0,41%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.842.324,80</b>	<b>1,93%</b>	<b>1,24%</b>	

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	1.738.390,45	0,00	0,00	2.088.401,95	350.011,50	20,13%	47,87%	20,13%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	966.319,79	0,00	0,00	1.034.853,50	68.533,71	7,09%	4,69%	7,09%
META VALOR FI AÇÕES	6.306.309,85	0,00	0,00	6.678.047,05	371.737,20	5,89%	8,60%	5,89%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.504.846,85	0,00	0,00	2.633.646,74	128.799,89	5,14%	6,38%	5,14%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.220.185,30	0,00	0,00	6.511.691,72	291.506,42	4,69%	4,94%	4,69%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	1.993.669,10	0,00	0,00	2.066.128,37	72.459,27	3,63%	7,54%	3,63%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.348.562,18	2.400.587,19	2.400.587,19	2.477.797,56	129.235,38	2,72%	6,58%	5,50%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.043.376,81	0,00	0,00	2.064.885,22	21.508,41	1,05%	0,94%	1,05%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.573.550,45	0,00	0,00	6.615.390,54	41.840,09	0,64%	0,19%	0,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1.647.918,89	0,00	0,00	1.655.901,85	7.982,96	0,48%	0,17%	0,48%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.483.614,83</b>	<b>4,59%</b>	<b>7,29%</b>	

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	10.012.548,62	0,00	0,00	10.683.113,31	670.564,69	6,70%	6,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.063.161,79	0,00	0,00	10.486.141,47	422.979,68	4,20%	4,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.102.750,07	0,00	0,00	12.488.802,50	386.052,43	3,19%	3,19%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.921.381,56	0,00	0,00	4.277.568,97	356.187,41	9,08%	9,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.596.085,16	0,00	0,00	6.935.013,30	338.928,14	5,14%	5,14%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.744.566,13	0,00	0,00	4.080.933,55	336.367,42	8,98%	8,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.685.933,17	0,00	0,00	4.019.940,43	334.007,26	9,06%	9,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.781.210,92	0,00	0,00	8.109.336,78	328.125,86	4,22%	4,22%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.067.867,53	0,00	0,00	5.305.475,33	237.607,80	4,69%	4,69%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.657.266,53	157.266,53	6,29%	6,44%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.290.943,07	0,00	0,00	3.437.047,09	146.104,02	4,44%	4,44%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.151.974,47	0,00	0,00	3.297.223,50	145.249,03	4,61%	4,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.159.430,50	1.000.000,00	0,00	4.285.828,51	126.398,01	3,30%	3,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.295.562,81	0,00	0,00	5.387.653,87	92.091,06	1,74%	1,74%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.584.996,30	84.996,30	3,40%	5,11%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	3.036.348,44	0,00	0,00	3.104.592,58	68.244,14	2,25%	2,25%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	573.485,39	1.000.000,00	0,00	1.635.707,95	62.222,56	4,49%	4,61%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	6.384.383,59	6.890.584,30	10.809.766,50	2.521.030,81	55.829,42	0,80%	1,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.166.416,93	0,00	0,00	1.183.960,74	17.543,81	1,50%	1,50%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	532.176,48	0,00	0,00	541.561,72	9.385,24	1,76%	1,76%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	370.730,43	0,00	0,00	376.185,31	5.454,88	1,47%	1,47%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>4.381.605,69</b>	<b>4,74%</b>	

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 (%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.960.395,84	0,00	0,00	6.511.691,72	551.295,88	9,25%	9,25%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	1.726.723,40	0,00	0,00	2.088.401,95	361.678,55	20,95%	20,95%
META VALOR FI AÇÕES	6.434.730,62	0,00	0,00	6.678.047,05	243.316,43	3,78%	3,78%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.412.512,47	0,00	0,00	2.633.646,74	221.134,27	9,17%	9,17%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.262.836,48	2.400.587,19	2.400.587,19	2.477.797,56	214.961,08	6,61%	9,50%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.492.648,28	0,00	0,00	6.615.390,54	122.742,26	1,89%	1,89%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.066.128,37	66.128,37	3,31%	6,92%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.034.853,50	34.853,50	3,49%	4,69%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.035.774,02	0,00	0,00	2.064.885,22	29.111,20	1,43%	1,43%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1.632.621,84	0,00	0,00	1.655.901,85	23.280,01	1,43%	1,43%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.868.501,55</b>	<b>5,91%</b>	

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	15.517.338,17	0,00	6.000.000,00	10.683.113,31	1.165.775,14	10,53%	10,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.784.779,22	0,00	0,00	10.486.141,47	701.362,25	7,17%	7,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.808.494,78	0,00	0,00	12.488.802,50	680.307,72	5,76%	5,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.567.394,34	0,00	0,00	8.109.336,78	541.942,44	7,16%	7,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.407.911,45	0,00	0,00	6.935.013,30	527.101,85	8,23%	8,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	812.043,97	3.000.000,00	0,00	4.277.568,97	465.525,00	12,21%	15,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	640.693,39	3.000.000,00	0,00	4.080.933,55	440.240,16	12,09%	14,95%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	585.591,75	3.000.000,00	0,00	4.019.940,43	434.348,68	12,11%	15,08%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.305.475,33	305.475,33	6,11%	7,71%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.064.474,54	0,00	0,00	3.297.223,50	232.748,96	7,60%	7,60%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.223.508,48	0,00	0,00	3.437.047,09	213.538,61	6,62%	6,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.082.242,68	1.000.000,00	0,00	4.285.828,51	203.585,83	5,89%	5,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.196.802,58	0,00	6.000.000,00	5.387.653,87	190.851,29	3,12%	3,23%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.657.266,53	157.266,53	6,29%	9,90%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.270.441,12	25.609.601,87	24.472.079,85	2.521.030,81	113.067,67	1,59%	2,65%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	0,00	3.104.592,58	104.592,58	3,49%	4,92%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.584.996,30	84.996,30	3,40%	8,47%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	557.662,63	1.000.000,00	0,00	1.635.707,95	78.045,32	7,46%	7,58%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.149.341,34	0,00	0,00	1.183.960,74	34.619,40	3,01%	3,01%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	2.357.447,78	0,00	2.000.000,00	376.185,31	18.737,53	2,84%	2,94%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	523.696,41	0,00	0,00	541.561,72	17.865,31	3,41%	3,41%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>6.711.993,90</b>	<b>7,61%</b>	

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 (%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.264.108,45	0,00	0,00	6.511.691,72	1.247.583,27	23,70%	23,70%
META VALOR FI AÇÕES	6.080.953,64	0,00	0,00	6.678.047,05	597.093,41	9,82%	9,82%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.227.074,86	0,00	0,00	2.633.646,74	406.571,88	18,26%	18,26%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.226.206,09	2.400.587,19	2.400.587,19	2.477.797,56	251.591,47	8,37%	11,30%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.390.166,80	0,00	0,00	6.615.390,54	225.223,74	3,52%	3,52%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.006.732,60	0,00	0,00	2.088.401,95	81.669,35	4,07%	4,07%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.066.128,37	66.128,37	3,31%	13,89%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	1.613.847,30	0,00	0,00	1.655.901,85	42.054,55	2,61%	2,61%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.025.882,72	0,00	0,00	2.064.885,22	39.002,50	1,93%	1,93%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.034.853,50	34.853,50	3,49%	18,63%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>2.991.772,04</b>	<b>10,19%</b>	