

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2019



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	15.811.701,40	1,06%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	19.133.478,90	1,29%	308	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	189.290.244,31	12,74%	153	13,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	24.847.020,00	1,67%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	27.757.445,38	1,87%	93	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	113.721.777,52	7,65%	873	1,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.589.560,00	0,98%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.051.066,99	0,88%	1.250	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	282.841.291,20	19,04%	507	4,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	277.034,93	0,02%	821	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	14.772.507,97	0,99%	685	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	249.819.422,29	16,81%	245	5,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.574.001,89	1,05%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	235.841.844,24	15,87%	560	3,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.361,34	0,00%	328	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	28.282.582,99	1,90%	744	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	D+3	Não há	22.474.166,58	1,51%	53	8,37%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	20.038.803,76	1,35%	150	1,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	22.570.970,86	1,52%	4.589	3,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	46.601.366,03	3,14%	29.937	2,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	41.390.241,04	2,79%	52	4,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

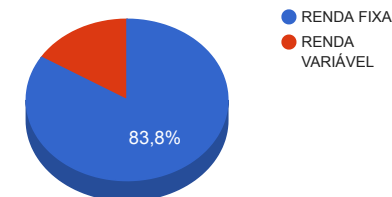
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	63.371.285,67	4,27%	197	8,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	20.578.082,33	1,39%	6.064	1,54%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	3.096.030,00	0,21%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.485.739.287,62				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			29.319,28	Artigo 6º			
Total			1.485.768.606,90				

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

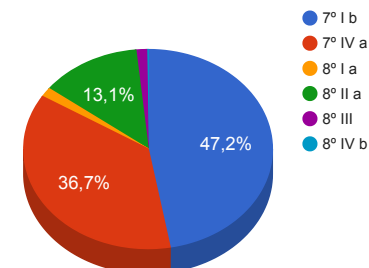
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	701.043.585,70	47,18%	25,00%	52,00%	80,00%	487.547.844,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	544.574.755,65	36,65%	5,00%	20,00%	40,00%	49.720.959,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	44.572.178,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	4,00%	59.429.571,50
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	22.474.166,58	1,51%	0,00%	7,00%	10,00%	126.099.762,18
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	193.972.667,36	13,06%	0,00%	15,00%	20,00%	103.175.190,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	20.578.082,33	1,39%	0,00%	2,00%	5,00%	53.708.882,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	14.857.392,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.096.030,00	0,21%	0,00%	0,50%	1,00%	11.761.362,88
Total Carteira		1.485.739.287,62					

RENDA FIXA	1.245.647.660,63	83,84%
RENDA VARIÁVEL	240.120.946,27	16,16%

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 "	701.043.585,70	47,18%	25,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	544.574.755,65	36,65%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	22.474.166,58	1,51%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	193.972.667,36	13,06%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	20.578.082,33	1,39%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.096.030,00	0,21%	0,00%	1,00%
Total Renda Fixa	1.485.739.287,62	100,00%	30,00	174,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	500.599.344,38	33,69%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	316.459.592,08	21,30%	0,02%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	299.236.932,84	20,14%	0,06%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	226.633.723,14	15,25%	0,05%
BRABESCO ASSET MANAGEMENT	101.419.454,14	6,83%	0,01%
ITAÚ DTVM	41.390.241,04	2,79%	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 5+	5,06%	21,12%	12,50%	21,12%	40,78%	49,39%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,04%	20,80%	12,35%	20,80%	40,18%	48,45%	0,20%	3,096%	11,68%
IMA-B	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,72%	15,18%	9,13%	15,18%	28,89%	39,11%	0,20%	2,337%	8,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,92%	8,07%	4,78%	8,07%	16,69%	28,09%	0,20%	1,428%	4,06%
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%
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%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,70%	7,16%	4,20%	7,16%	14,42%	25,32%	0,10%	1,348%	2,98%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,76%	3,19%	5,76%	11,97%	22,82%	0,20%	0,911%	1,98%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
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 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%

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

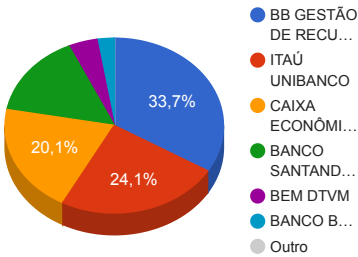
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	3,01%	1,50%	3,01%	6,17%	13,82%	0,20%	0,003%	0,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,80%	0,000%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	5,18%	2,19%	5,25%	9,57%	21,24%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,59%	7,23%	4,17%	7,23%	20,06%	32,13%	0,20%	1,199%	5,79%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	2,34%	2,66%	2,34%	4,15%	8,18%	0,20%	0,135%	4,14%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

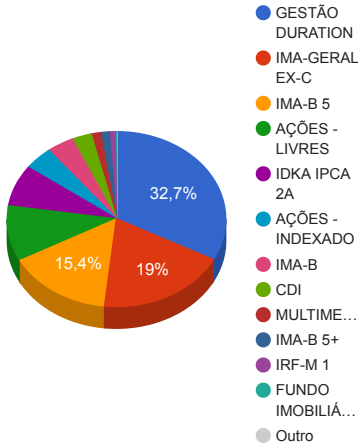
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,22%	18,16%	10,36%	18,16%	42,83%	74,12%	1,90%	7,359%	15,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,88%	15,08%	8,88%	15,08%	41,60%	76,02%	2,50%	6,804%	17,18%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4,68%	14,51%	6,76%	14,51%	38,04%	57,96%	1,50%	6,684%	16,61%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	4,03%	14,76%	5,74%	14,76%	38,76%	59,70%	0,50%	7,595%	16,58%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	3,69%	11,27%	5,95%	11,27%	37,92%	78,11%	1,50%	7,101%	13,89%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	3,52%	13,94%	6,96%	13,94%	39,47%	63,19%	2,00%	7,532%	17,04%
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%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	500.599.344,38	33,69%
ITAÚ UNIBANCO	357.849.833,12	24,09%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	299.236.932,84	20,14%
BANCO SANTANDER	226.633.723,14	15,25%
BEM DTVM	63.371.285,67	4,27%
BANCO BRADESCO	38.048.168,47	2,56%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	29.319,28	0,00%



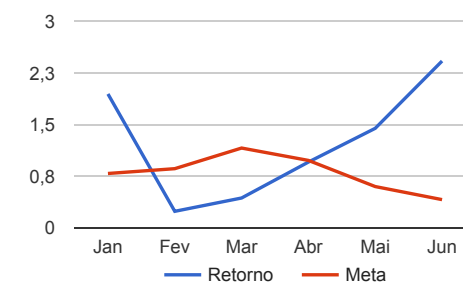
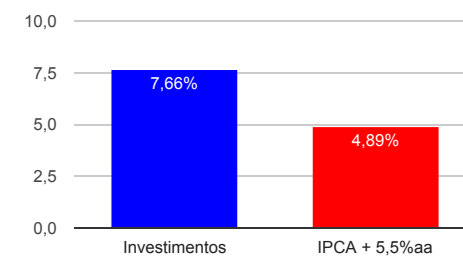
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	485.661.266,53	32,69%
IMA-GERAL EX-C	282.841.291,20	19,04%
IMA-B 5	228.726.824,31	15,39%
AÇÕES - LIVRES	152.582.426,32	10,27%
IDKA IPCA 2A	113.721.777,52	7,65%
AÇÕES - INDEXADO	63.864.407,62	4,30%
IMA-B	59.143.148,67	3,98%
CDI	43.339.487,23	2,92%
MULTIMERCADO	20.578.082,33	1,39%
IMA-B 5+	19.133.478,90	1,29%
IRF-M 1	13.051.066,99	0,88%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.096.030,00	0,21%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	29.319,28	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.318.859.470,03	161.471.399,07	151.927.382,57	1.354.259.056,04	25.855.569,51	1,95%	0,79%	246,37%	1,19%
Fevereiro	1.354.259.056,04	152.907.674,76	143.288.887,74	1.367.150.993,59	3.273.150,53	0,24%	0,86%	27,98%	2,24%
Março	1.367.150.993,59	87.352.835,56	75.367.034,05	1.385.117.934,89	5.981.139,79	0,43%	1,16%	37,47%	2,90%
Abril	1.385.117.934,89	59.389.879,60	48.622.013,83	1.409.232.075,90	13.346.275,24	0,96%	0,98%	97,59%	1,64%
Mai	1.409.232.075,90	140.590.825,29	130.504.659,48	1.439.852.510,25	20.534.268,54	1,45%	0,60%	241,48%	2,05%
Junho	1.439.852.510,25	281.485.978,38	270.774.482,31	1.485.739.287,62	35.175.281,30	2,42%	0,41%	584,98%	2,17%
Acumulado no ano					104.165.684,91	7,66%	4,89%	156,60%	

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	18.336.785,49	0,00	19.133.478,90	796.693,41	4,34%	3,10%	5,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	15.098.017,25	0,00	15.574.001,89	475.984,64	3,15%	2,34%	3,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	243.613.382,04	0,00	0,00	249.819.422,29	6.206.040,25	2,55%	1,49%	2,55%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	23.442.378,60	206.714.579,58	0,00	235.841.844,24	5.684.886,06	2,47%	1,65%	2,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	291.777.380,58	0,00	15.000.000,00	282.841.291,20	6.063.910,62	2,08%	1,21%	2,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.235.704,50	0,00	0,00	27.757.445,38	521.740,88	1,92%	1,43%	1,92%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	186.109.394,66	12.289,72	0,00	189.290.244,31	3.168.559,93	1,70%	1,35%	1,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.563.825,94	0,00	0,00	15.811.701,40	247.875,46	1,59%	1,20%	1,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	112.478.362,10	0,00	0,00	113.721.777,52	1.243.415,42	1,11%	0,91%	1,11%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.501.230,00	0,00	0,00	14.589.560,00	88.330,00	0,61%	0,46%	0,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.976.772,39	0,00	0,00	13.051.066,99	74.294,60	0,57%	0,17%	0,57%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.704.445,11	0,00	0,00	14.772.507,97	68.062,86	0,46%	0,00%	0,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	275.782,62	0,00	0,00	277.034,93	1.252,31	0,45%	0,00%	0,45%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.737.490,00	0,00	0,00	24.847.020,00	109.530,00	0,44%	0,14%	0,44%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.331,62	0,00	0,00	7.361,34	29,72	0,41%	0,00%	0,41%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	30.859.752,49	31.282.000,00	33.972.385,49	28.282.582,99	113.215,99	0,18%	0,00%	0,46%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.087.130,40	0,00	15.098.017,24	0,00	10.886,84	0,07%	0,15%	0,56%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	206.693.678,52	0,00	206.693.579,58	0,00	-98,94	0,00%	0,95%	1,22%
				Total Renda Fixa	24.874.610,05	2,04%	1,31%	

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(%)
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	43.462.036,12	0,00	0,00	46.601.366,03	3.139.329,91	7,22%	7,36%	7,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	19.105.587,65	0,00	0,00	20.038.803,76	933.216,11	4,88%	6,80%	4,88%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	39.539.822,79	0,00	0,00	41.390.241,04	1.850.418,25	4,68%	6,68%	4,68%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	21.603.571,02	0,00	0,00	22.474.166,58	870.595,56	4,03%	7,59%	4,03%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	61.118.601,11	0,00	0,00	63.371.285,67	2.252.684,56	3,69%	7,10%	3,69%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	21.802.491,32	0,00	0,00	22.570.970,86	768.479,54	3,52%	7,53%	3,52%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	10.096.448,67	10.042.306,34	0,00	20.578.082,33	439.327,32	2,18%	1,76%	2,32%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.059.910,00	0,00	10.500,00	3.096.030,00	46.620,00	1,52%	2,63%	1,18%
Total Renda Variável					10.300.671,25	4,48%	6,63%	

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 (%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	283.540.320,16	0,00	15.000.000,00	282.841.291,20	14.300.971,04	5,04%	5,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	162.285.708,16	76.591.007,87	0,00	249.819.422,29	10.942.706,26	4,80%	5,08%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	181.643.270,83	12.289,72	0,00	189.290.244,31	7.634.683,76	4,20%	4,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	229.621.085,75	0,00	235.841.844,24	6.220.758,49	4,87%	6,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	202.159.805,67	208.591,06	206.704.079,58	0,00	4.335.682,85	2,14%	3,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	110.206.422,91	0,00	0,00	113.721.777,52	3.515.354,61	3,19%	3,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.490.514,95	0,00	0,00	27.757.445,38	1.266.930,43	4,78%	4,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	75.453.464,83	0,00	76.508.292,63	0,00	1.054.827,80	1,40%	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	18.336.785,49	0,00	19.133.478,90	796.693,41	4,34%	12,35%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.203.484,00	0,00	0,00	24.847.020,00	643.536,00	2,66%	2,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.178.578,99	0,00	0,00	15.811.701,40	633.122,41	4,17%	4,17%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	15.098.017,25	0,00	15.574.001,89	475.984,64	3,15%	9,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	29.156.514,61	95.303.889,30	96.577.983,65	28.282.582,99	400.162,73	0,65%	1,50%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.289.440,00	0,00	0,00	14.589.560,00	300.120,00	2,10%	2,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.829.572,77	0,00	0,00	13.051.066,99	221.494,22	1,73%	1,73%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.551.449,98	0,00	0,00	14.772.507,97	221.057,99	1,52%	1,52%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.917.514,22	0,00	15.098.017,24	0,00	180.503,02	1,21%	1,70%
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	5.101.239,41	0,00	5.227.080,08	0,00	125.840,67	2,50%	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.699.219,10	0,00	7.813.656,79	0,00	114.437,69	1,49%	6,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.385.903,88	0,00	10.498.430,41	0,00	112.526,53	1,08%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	272.929,86	0,00	0,00	277.034,93	4.105,07	1,50%	1,50%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	13.025.000,00	13.027.651,29	0,00	2.651,29	0,02%	1,27%

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 DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	3.400.000,00	3.393.463,95	7.361,34	825,29	0,89%	1,33%
			Total Renda Fixa		53.504.976,20	4,49%	

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 DUNAMIS FIC AÇÕES	32.341.852,24	9.920.000,00	0,00	46.601.366,03	4.339.513,79	10,27%	10,36%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	59.814.606,37	0,00	0,00	63.371.285,67	3.556.679,30	5,95%	5,95%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	38.770.815,61	0,00	0,00	41.390.241,04	2.619.425,43	6,76%	6,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	18.403.776,49	0,00	0,00	20.038.803,76	1.635.027,27	8,88%	8,88%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	21.101.376,33	0,00	0,00	22.570.970,86	1.469.594,53	6,96%	6,96%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	21.254.153,52	0,00	0,00	22.474.166,58	1.220.013,06	5,74%	5,74%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	19.950.016,83	0,00	20.578.082,33	628.065,50	4,13%	5,57%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.066.000,00	0,00	52.500,00	3.096.030,00	82.530,00	2,72%	0,98%
Total Renda Variável					15.550.848,88	7,10%	

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 (%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	115.347.332,51	161.199.380,97	15.000.000,00	282.841.291,20	21.294.577,72	7,95%	8,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	205.853.691,00	76.591.007,87	50.000.000,00	249.819.422,29	17.374.723,42	8,08%	8,36%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	176.402.174,84	235.082,37	0,00	189.290.244,31	12.652.987,10	7,16%	7,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	195.629.688,40	1.824.279,25	206.704.079,58	0,00	9.250.111,93	4,70%	5,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	229.621.085,75	0,00	235.841.844,24	6.220.758,49	4,87%	10,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	100.387.951,10	7.168.000,00	0,00	113.721.777,52	6.165.826,42	5,73%	5,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.360.099,22	0,00	689.529,53	27.757.445,38	2.086.875,69	8,06%	8,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	24.617.115,91	50.000.000,00	76.508.292,63	0,00	1.891.176,72	4,39%	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.278.850,00	0,00	697.706,51	24.847.020,00	1.265.876,51	5,32%	2,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.146.640,93	0,00	408.876,53	15.811.701,40	1.073.937,00	7,22%	7,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	207.083.342,98	0,00	195.000.000,00	13.051.066,99	967.724,01	2,64%	3,21%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	39.911.337,10	170.208.936,88	182.685.042,47	28.282.582,99	847.351,48	1,40%	3,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	18.336.785,49	0,00	19.133.478,90	796.693,41	4,34%	20,80%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	47.417.388,21	0,00	48.098.017,24	0,00	680.629,03	2,60%	3,19%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.373.490,00	0,00	393.552,74	14.589.560,00	609.622,74	4,32%	1,50%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.437.460,08	199.000,00	3.340.000,00	14.772.507,97	476.047,89	3,08%	3,09%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	15.098.017,25	0,00	15.574.001,89	475.984,64	3,15%	15,18%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.456.711,89	0,00	7.813.656,79	0,00	356.944,90	4,79%	9,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.179.697,75	0,00	10.498.430,41	0,00	318.732,66	3,13%	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	5.379.379,20	0,00	5.679.477,41	0,00	300.098,21	5,92%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	269.029,01	0,00	95,22	277.034,93	8.101,14	3,01%	3,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	13.447.000,00	13.449.738,97	0,00	2.738,97	0,04%	2,53%

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 DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	3.400.000,00	3.393.463,95	7.361,34	825,29	0,89%	2,65%
			Total Renda Fixa		85.118.345,37	7,19%	

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 (%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	25.493.994,14	33.000.000,00	0,00	63.371.285,67	4.877.291,53	11,85%	11,27%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	42.920.000,00	0,00	46.601.366,03	3.681.366,03	8,07%	18,16%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	19.583.826,03	0,00	0,00	22.474.166,58	2.890.340,55	14,76%	14,76%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	19.809.380,42	0,00	0,00	22.570.970,86	2.761.590,44	13,94%	13,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	17.412.809,31	0,00	0,00	20.038.803,76	2.625.994,45	15,08%	15,08%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	40.000.000,00	0,00	41.390.241,04	1.390.241,04	3,48%	14,51%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	19.950.016,83	0,00	20.578.082,33	628.065,50	4,13%	9,97%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.028.080,00	0,00	124.500,00	3.096.030,00	192.450,00	6,44%	2,24%
Total Renda Variável					19.047.339,54	13,80%	