

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

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

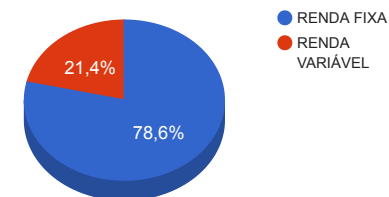
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	29.972.911,06	7,77%	153	2,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	41.115.675,70	10,66%	507	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	47.256.186,34	12,25%	283	4,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.119.624,68	12,73%	889	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	23.724.924,90	6,15%	24	6,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.139.812,11	4,18%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	11.460.019,36	2,97%	744	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	32.191.147,89	8,35%	560	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	43.224.978,33	11,21%	115	6,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	8.913.735,31	2,31%	74	1,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou D+18 (isento de taxa de	Não há	3.630.799,84	0,94%	1.055	1,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	resgate) D+4 ou D+33	Não há	5.484.788,37	1,42%	4.967	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.942.120,19	1,80%	6.711	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.653.463,69	2,24%	5.680	1,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	22.152.704,55	5,74%	150	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	10.218.853,46	2,65%	45	2,98%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	14.298.185,59	3,71%	7.178	1,81%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	952.197,34	0,25%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.171.231,69	1,08%	105	0,73%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.631.865,08	1,20%		0,19%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.473.116,55	0,38%		0,78%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total			385.728.342,03				

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

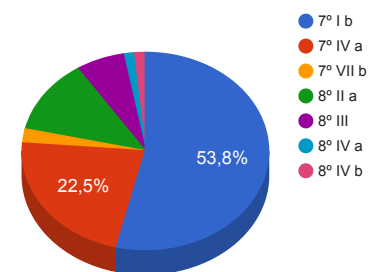
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	207.329.134,79	53,75%	15,00%	35,00%	70,00%	62.680.704,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	15,00%	60,00%	231.437.005,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	86.876.145,58	22,52%	5,00%	20,00%	40,00%	67.415.191,23
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	19.286.417,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	8.913.735,31	2,31%	0,00%	2,50%	5,00%	10.372.681,79
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	46.863.876,64	12,15%	2,00%	12,00%	20,00%	30.281.791,77
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	24.517.039,05	6,36%	2,00%	8,00%	10,00%	14.055.795,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.123.429,03	1,33%	1,00%	2,50%	5,00%	14.162.988,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	6.104.981,63	1,58%	1,00%	2,50%	5,00%	13.181.435,47
Total Carteira		385.728.342,03					

RENDA FIXA	303.119.015,68	78,58%
RENDA VARIÁVEL	82.609.326,35	21,42%

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 "	207.329.134,79	53,75%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	86.876.145,58	22,52%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	8.913.735,31	2,31%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	46.863.876,64	12,15%	2,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	24.517.039,05	6,36%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.123.429,03	1,33%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	6.104.981,63	1,58%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa	385.728.342,03	100,00%	31,00	230,00

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
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	90.481.164,67	23,46%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	82.262.969,91	21,33%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	77.629.242,48	20,13%	0,00%
WESTERN ASSET	48.241.963,95	12,51%	0,11%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	29.972.911,06	7,77%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	22.152.704,55	5,74%	0,00%
Icatu Vanguarda	8.653.463,69	2,24%	0,03%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	6.942.120,19	1,80%	0,02%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	5.484.788,37	1,42%	0,01%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.631.865,08	1,20%	0,36%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.171.231,69	1,08%	0,03%
Occam Brasil	3.630.799,84	0,94%	0,03%
BRASIL PLURAL	1.473.116,55	0,38%	0,01%

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 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%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,45%	9,41%	5,87%	9,41%	19,62%	30,98%	0,40%	1,790%	4,37%
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%
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%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	3,19%	1,70%	3,19%	6,98%	15,08%	0,20%	0,148%	0,47%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
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%
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%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,10%	7,71%	4,69%	7,71%	15,43%	-	0,40%	1,139%	3,50%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,31%	6,74%	3,73%	6,74%	14,93%	27,15%	0,20%	0,882%	3,10%

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

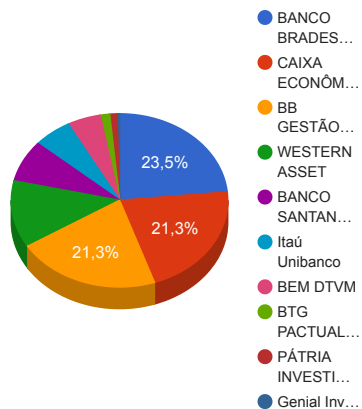
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,99%	19,26%	10,91%	19,26%	41,71%	61,51%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,50%	11,30%	9,50%	11,30%	35,83%	80,50%	2,00%	6,583%	18,02%
S&P 500	6,89%	17,35%	3,79%	17,35%	8,22%	21,39%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7,12%	18,92%	4,73%	18,92%	12,44%	32,60%	1,00%	4,673%	18,51%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4,88%	15,08%	8,88%	15,08%	41,60%	76,02%	2,50%	6,804%	17,18%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,85%	17,29%	12,65%	17,29%	45,85%	66,10%	3,00%	7,054%	16,08%
OCCAM FIC AÇÕES	3,41%	13,22%	5,48%	13,22%	39,15%	68,87%	3,00%	8,021%	15,04%
IDIV	3,11%	18,67%	9,64%	18,67%	47,74%	60,82%	-	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,06%	21,65%	11,38%	21,65%	54,69%	64,96%	2,00%	5,137%	16,99%
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1,98%	4,50%	3,81%	4,50%	6,37%	2,30%	0,40%	4,643%	14,16%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,71%	2,28%	0,92%	2,28%	5,13%	15,42%	2,00%	0,752%	1,70%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,011%	-

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

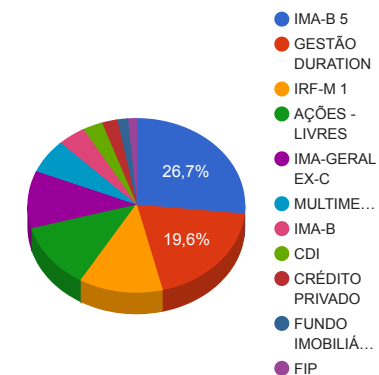
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,035%	0,30%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	90.481.164,67	23,46%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	82.262.969,91	21,33%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	82.261.107,56	21,33%
WESTERN ASSET	48.241.963,95	12,51%
BANCO SANTANDER	29.972.911,06	7,77%
Itaú Unibanco	22.152.704,55	5,74%
BEM DTVM	19.226.383,72	4,98%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	5.484.788,37	1,42%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.171.231,69	1,08%
Genial Investimentos	1.473.116,55	0,38%



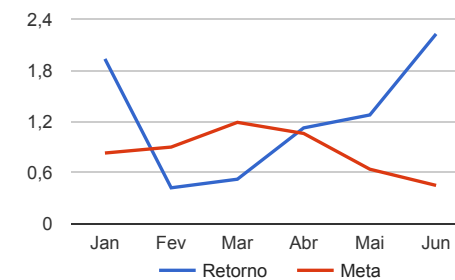
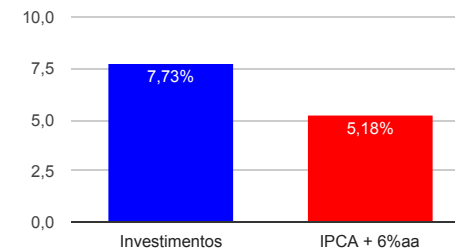
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	102.817.460,64	26,66%
GESTÃO DURATION	75.416.126,22	19,55%
IRF-M 1	47.256.186,34	12,25%
AÇÕES - LIVRES	46.863.876,64	12,15%
IMA-GERAL EX-C	41.115.675,70	10,66%
MULTIMERCADO	24.517.039,05	6,36%
IMA-B	16.139.812,11	4,18%
CDI	11.460.019,36	2,97%
CRÉDITO PRIVADO	8.913.735,31	2,31%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.104.981,63	1,58%
FIP	5.123.429,03	1,33%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	373.947.208,44	15.944.003,51	8.989.960,00	388.269.600,80	7.368.348,85	1,93%	0,83%	232,61%	1,35%
Fevereiro	388.269.600,80	28.328.055,86	32.218.319,88	386.017.704,18	1.638.367,40	0,42%	0,90%	47,12%	1,49%
Março	386.017.704,18	60.582.076,39	64.883.180,38	383.734.794,67	2.018.194,48	0,52%	1,19%	43,80%	2,52%
Abril	383.734.794,67	17.006.000,00	21.144.476,63	383.912.448,01	4.316.129,97	1,12%	1,06%	106,16%	1,38%
Mai	383.912.448,01	45.228.810,20	49.758.247,14	384.285.320,38	4.902.309,31	1,28%	0,64%	199,32%	2,04%
Junho	384.285.320,38	6.776.000,00	17.000.472,63	382.620.265,88	8.559.418,13	2,23%	0,45%	494,60%	1,92%
Acumulado no ano					28.802.768,14	7,73%	5,18%	149,36%	

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	31.334.219,23	0,00	0,00	32.191.147,89	856.928,66	2,73%	1,65%	2,73%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	23.157.573,75	0,00	0,00	23.724.924,90	567.351,15	2,45%	1,79%	2,45%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.242.336,08	0,00	0,00	41.115.675,70	873.339,62	2,17%	1,21%	2,17%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	42.337.290,81	0,00	0,00	43.224.978,33	887.687,52	2,10%	1,14%	2,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.851.147,21	0,00	0,00	16.139.812,11	288.664,90	1,82%	1,51%	1,82%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	29.471.175,64	0,00	0,00	29.972.911,06	501.735,42	1,70%	1,35%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.299.374,54	0,00	0,00	49.119.624,68	820.250,14	1,70%	1,34%	1,70%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	8.798.878,36	0,00	0,00	8.913.735,31	114.856,95	1,31%	0,88%	1,31%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.201.423,79	0,00	2.220.235,87	47.256.186,34	274.998,42	0,56%	0,15%	0,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	19.698.398,22	6.776.000,00	15.084.000,00	11.460.019,36	69.621,14	0,26%	0,00%	0,46%
Total Renda Fixa					5.255.433,92	1,70%	1,12%	

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(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.347.859,96	0,00	0,00	14.298.185,59	950.325,63	7,12%	4,67%	7,12%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.580.037,53	0,00	0,00	6.942.120,19	362.082,66	5,50%	6,58%	5,50%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.236.993,31	0,00	0,00	8.653.463,69	416.470,38	5,06%	5,14%	5,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	21.121.043,12	0,00	0,00	22.152.704,55	1.031.661,43	4,88%	6,80%	4,88%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.231.264,78	0,00	0,00	5.484.788,37	253.523,59	4,85%	7,05%	4,85%
OCCAM FIC AÇÕES	3.511.116,04	0,00	0,00	3.630.799,84	119.683,80	3,41%	8,02%	3,41%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.554.351,98	0,00	30.000,00	4.631.865,08	107.513,10	2,36%	-	0,00%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.451.528,60	0,00	11.236,76	1.473.116,55	32.824,71	2,26%	4,64%	1,98%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	10.146.769,06	0,00	0,00	10.218.853,46	72.084,40	0,71%	0,75%	0,71%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	952.618,45	0,00	0,00	952.197,34	-421,11	-0,04%	0,03%	-0,04%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.174.633,14	0,00	0,00	4.171.231,69	-3.401,45	-0,08%	0,01%	-0,08%
Total Renda Variável					3.342.347,14	4,21%	5,00%	

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	30.170.552,72	0,00	0,00	32.191.147,89	2.020.595,17	6,70%	6,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.106.269,41	0,00	0,00	41.115.675,70	2.009.406,29	5,14%	5,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.138.285,56	0,00	0,00	49.119.624,68	1.981.339,12	4,20%	4,20%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	29.123.993,98	12.337.425,84	0,00	43.224.978,33	1.763.558,51	4,49%	4,69%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	22.410.464,61	0,00	0,00	23.724.924,90	1.314.460,29	5,87%	5,87%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	28.763.946,85	0,00	0,00	29.972.911,06	1.208.964,21	4,20%	4,20%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	53.645.558,92	0,00	7.220.235,87	47.256.186,34	830.863,29	1,66%	1,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.392.048,45	0,00	0,00	16.139.812,11	747.763,66	4,86%	4,86%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	8.593.083,77	0,00	0,00	8.913.735,31	320.651,54	3,73%	3,73%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	20.156.229,99	34.141.962,00	43.094.700,00	11.460.019,36	256.527,37	0,86%	1,50%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	13.450.233,00	0,00	13.700.962,00	0,00	250.729,00	1,86%	-
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	12.198.666,19	0,00	12.331.422,36	0,00	132.756,17	1,09%	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	12.331.422,36	12.337.425,84	0,00	6.003,48	0,05%	1,53%
Total Renda Fixa					12.843.618,10	4,16%	

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	20.345.197,63	0,00	0,00	22.152.704,55	1.807.506,92	8,88%	8,88%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.522.376,04	5.200.000,00	0,00	8.653.463,69	931.087,65	12,06%	11,38%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.652.387,35	0,00	0,00	14.298.185,59	645.798,24	4,73%	4,73%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.339.857,23	0,00	0,00	6.942.120,19	602.262,96	9,50%	9,50%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.484.788,37	484.788,37	9,70%	12,65%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.485.287,18	0,00	88.500,00	4.631.865,08	235.077,90	5,28%	0,00%
OCCAM FIC AÇÕES	3.442.191,34	0,00	0,00	3.630.799,84	188.608,50	5,48%	5,48%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	10.125.917,77	0,00	0,00	10.218.853,46	92.935,69	0,92%	0,92%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.441.322,62	0,00	29.950,33	1.473.116,55	61.744,26	4,32%	3,81%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	954.489,43	0,00	0,00	952.197,34	-2.292,09	-0,24%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.182.303,41	0,00	0,00	4.171.231,69	-11.071,72	-0,26%	-
Total Renda Variável					5.036.446,68	6,62%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	75.217.439,98	0,00	30.000.000,00	49.119.624,68	3.902.184,70	6,86%	7,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.855.842,34	135.926,73	0,00	41.115.675,70	3.123.906,63	8,22%	8,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	30.000.000,00	0,00	32.191.147,89	2.191.147,89	7,30%	10,92%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	21.684.609,71	0,00	0,00	23.724.924,90	2.040.315,19	9,41%	9,41%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	41.274.481,70	0,00	43.224.978,33	1.950.496,63	5,22%	7,71%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	17.745.432,63	10.438.076,39	0,00	29.972.911,06	1.789.402,04	7,15%	7,16%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	60.788.927,47	0,00	15.220.235,87	47.256.186,34	1.687.494,74	3,09%	3,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.301.853,98	0,00	404.379,17	16.139.812,11	1.242.337,30	8,27%	8,27%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	21.309.751,34	66.979.962,00	77.430.290,79	11.460.019,36	600.596,81	1,84%	3,01%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	13.109.697,00	0,00	13.700.962,00	0,00	591.265,00	4,51%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	8.350.985,25	0,00	0,00	8.913.735,31	562.750,06	6,74%	6,74%
BRABESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.957.992,33	0,00	12.331.422,36	0,00	373.430,03	3,12%	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	10.190.725,63	0,00	10.438.064,26	0,00	247.338,63	2,43%	8,47%
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.820.867,11	12.331.422,36	33.274.481,70	0,00	122.192,23	0,61%	3,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.622.200,37	0,00	2.704.439,65	0,00	82.239,28	3,14%	8,36%
Total Renda Fixa					20.507.097,16	6,63%	

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	19.249.692,96	0,00	0,00	22.152.704,55	2.903.011,59	15,08%	15,08%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	12.023.736,48	0,00	0,00	14.298.185,59	2.274.449,11	18,92%	18,92%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	7.700.000,00	0,00	8.653.463,69	953.463,69	13,06%	21,65%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.237.228,77	0,00	0,00	6.942.120,19	704.891,42	11,30%	11,30%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.484.788,37	484.788,37	9,70%	17,29%
OCCAM FIC AÇÕES	3.206.873,13	0,00	0,00	3.630.799,84	423.926,71	13,22%	13,22%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.410.607,31	0,00	194.500,00	4.631.865,08	415.757,77	9,61%	0,00%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	9.991.083,90	0,00	0,00	10.218.853,46	227.769,56	2,28%	2,28%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.405.136,09	0,00	56.880,86	1.473.116,55	124.861,32	9,03%	4,50%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	951.951,73	5.076,78	0,00	952.197,34	-4.831,17	-0,50%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.193.118,79	0,00	0,00	4.171.231,69	-21.887,10	-0,52%	-
Total Renda Variável					8.486.201,27	12,59%	