

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.288.172,51	5,92%	920	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.450.039,47	7,30%	104	1,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.359.520,05	8,52%	889	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.097.824,35	3,89%	873	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.917.906,14	10,15%	576	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	3.082.244,22	1,97%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.542.479,72	6,72%	245	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	11.326.180,43	7,22%	95	5,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	34.196,44	0,02%	719	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.896.685,36	3,76%	33	6,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.348.518,52	9,15%	560	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.329.973,22	1,49%	98	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	354.217,63	0,23%	328	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.241.372,75	7,81%	115	1,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	6.124.862,60	3,91%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	203.334,52	0,13%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.888.776,74	1,84%	1.517	1,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.745.904,63	1,75%	1.869	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.364.795,99	2,15%	4.554	1,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	7.447.184,29	4,75%	4.967	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.002.670,12	1,91%	3.339	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	2.686.899,34	1,71%	887	2,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

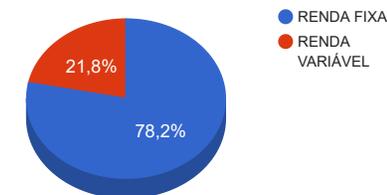
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.490.706,37	4,14%	77	4,44%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.202.309,83	2,04%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	2.371.108,87	1,51%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
Total			156.797.884,11				

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

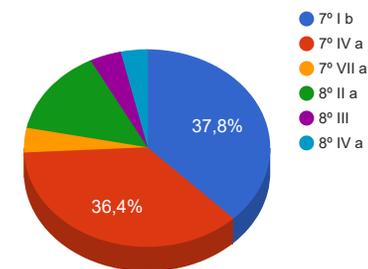
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	59.195.706,74	37,75%	15,00%	25,00%	70,00%	50.562.812,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	94.078.730,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	57.073.624,07	36,40%	10,00%	30,00%	40,00%	5.645.529,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.328.197,12	4,04%	1,00%	5,00%	5,00%	1.511.697,09
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	22.136.231,11	14,12%	7,00%	12,50%	20,00%	9.223.345,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.490.706,37	4,14%	7,00%	10,00%	10,00%	9.189.082,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.573.418,70	3,55%	2,00%	5,00%	5,00%	2.266.475,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	7.839.894,21
Total Carteira		156.797.884,11					

RENDA FIXA	122.597.527,93	78,19%
RENDA VARIÁVEL	34.200.356,18	21,81%

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 "	59.195.706,74	37,75%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	57.073.624,07	36,40%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.328.197,12	4,04%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	22.136.231,11	14,12%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	6.490.706,37	4,14%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.573.418,70	3,55%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	156.797.884,11	100,00%	42,00	406,00

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	37.350.428,71	23,82%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	27.462.144,37	17,51%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	23.713.572,16	15,12%	3,35%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	23.691.412,22	15,11%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	10.542.479,72	6,72%	0,00%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	7.447.184,29	4,75%	0,01%
SUPERNOVA CAPITAL	6.124.862,60	3,91%	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.364.795,99	2,15%	0,54%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.202.309,83	2,04%	-
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	3.002.670,12	1,91%	0,07%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.888.776,74	1,84%	0,01%
PERFIN INVESTIMENTOS	2.745.904,63	1,75%	0,05%
HIX CAPITAL	2.686.899,34	1,71%	0,22%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	2.371.108,87	1,51%	0,00%
BRASIL PLURAL	203.334,52	0,13%	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%	-	-	-
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%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,82%	6,65%	4,37%	6,65%	15,16%	27,69%	-	-	-
BRAPAR 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%	-	-	-
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%
IPCA + 7,00% ao ano	0,52%	5,66%	2,40%	5,66%	10,51%	23,34%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,29%	-6,64%	1,66%	-6,64%	-0,24%	-22,04%	1,65%	-	-
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%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,47%	3,05%	1,51%	3,05%	6,55%	14,45%	0,20%	0,007%	0,27%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,80%	0,000%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,53%	1,27%	2,53%	5,19%	11,74%	1,00%	0,004%	0,10%

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

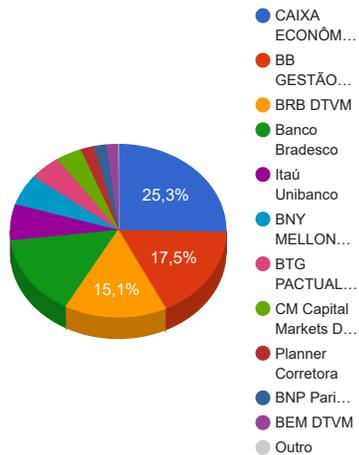
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,73%	10,92%	6,70%	10,92%	16,74%	26,22%	0,002	1,653%	3,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,55%	8,36%	5,08%	8,36%	12,90%	24,68%	0,40%	1,493%	2,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,21%	9,04%	5,46%	9,04%	18,61%	30,04%	0,20%	1,705%	4,79%
BRAPENCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,10%	7,71%	4,69%	7,71%	15,43%	-	0,40%	1,139%	3,50%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	11,87%	8,75%	10,60%	8,75%	-26,98%	47.708,28%	0,72%	22,099%	34,43%

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

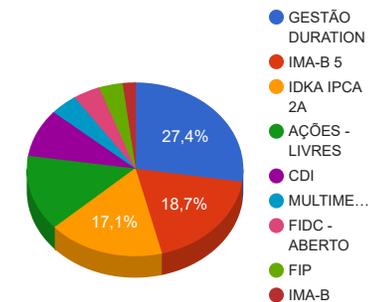
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	5,14%	18,26%	9,17%	18,26%	49,84%	76,57%	2,00%	6,380%	20,46%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,85%	17,29%	12,65%	17,29%	45,85%	66,10%	3,00%	7,054%	16,08%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,69%	23,70%	9,25%	23,70%	40,41%	36,97%	2,00%	4,940%	21,68%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	4,48%	12,60%	5,16%	12,60%	35,09%	57,38%	2,00%	7,512%	17,13%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,95%	17,63%	10,28%	17,63%	44,50%	51,60%	1,85%	3,844%	13,91%
IPCA + 8,00% ao ano	0,59%	6,14%	2,64%	6,14%	11,53%	25,63%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,64%	3,52%	1,89%	3,52%	6,84%	15,58%	1,00%	0,195%	0,38%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5,79%	20,16%	10,38%	20,16%	37,00%	44,10%	2,00%	5,736%	14,59%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.721.537,58	25,33%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	27.462.144,37	17,51%
BRB DTVM	23.713.572,16	15,12%
Banco Bradesco	23.691.412,22	15,11%
Itaú Unibanco	10.542.479,72	6,72%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	9.054.365,45	5,77%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	7.447.184,29	4,75%
CM Capital Markets DTVM	6.124.862,60	3,91%
Planner Corretora	3.202.309,83	2,04%
BNP Paribas	2.888.776,74	1,84%
BEM DTVM	2.745.904,63	1,75%
Santander Securities Services	203.334,52	0,13%



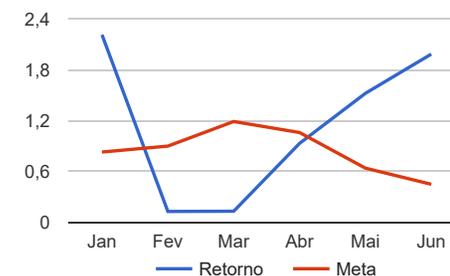
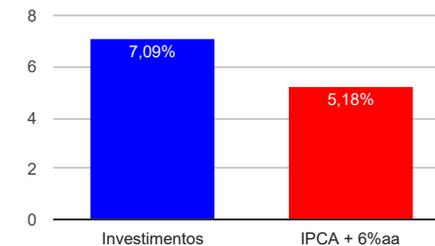
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	43.029.056,35	27,44%
IMA-B 5	29.277.426,19	18,67%
IDKA IPCA 2A	26.836.036,33	17,12%
AÇÕES - LIVRES	22.136.231,11	14,12%
CDI	14.044.567,72	8,96%
MULTIMERCADO	6.490.706,37	4,14%
FIDC - ABERTO	6.328.197,12	4,04%
FIP	5.573.418,70	3,55%
IMA-B	3.082.244,22	1,97%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	146.458.485,09	4.258.701,74	3.477.204,61	150.498.104,38	3.258.122,16	2,21%	0,83%	266,08%	1,66%
Fevereiro	150.498.104,38	29.163.354,34	28.363.666,48	151.493.308,15	195.515,91	0,13%	0,90%	14,43%	1,98%
Março	151.493.308,15	2.839.786,38	3.012.544,51	151.520.465,58	199.915,56	0,13%	1,19%	11,06%	2,71%
Abril	151.520.465,58	7.816.188,97	7.834.190,96	152.914.794,10	1.412.330,51	0,93%	1,06%	87,97%	1,42%
Mai	152.914.794,10	31.137.710,98	32.463.049,20	153.917.527,83	2.328.071,95	1,52%	0,64%	237,64%	5,91%
Junho	153.917.527,83	2.166.805,89	2.341.115,97	156.797.884,11	3.054.666,36	1,98%	0,45%	440,69%	1,87%
Acumulado no ano					10.448.622,45	7,09%	5,18%	137,01%	

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(%)
BBIF MASTER FIDC LP	181.751,81	0,00	0,00	203.334,52	21.582,71	11,87%	22,10%	11,87%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	13.966.560,82	0,00	0,00	14.348.518,52	381.957,70	2,73%	1,65%	2,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.280.582,34	0,00	0,00	10.542.479,72	261.897,38	2,55%	1,49%	2,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.015.729,08	0,00	0,00	3.082.244,22	66.515,14	2,21%	1,71%	2,21%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.989.978,42	0,00	0,00	12.241.372,75	251.394,33	2,10%	1,14%	2,10%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	11.236.088,72	0,00	0,00	11.450.039,47	213.950,75	1,90%	1,10%	1,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.651.772,95	0,00	0,00	15.917.906,14	266.133,19	1,70%	1,35%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.971.777,22	1.230.000,00	60.000,00	13.359.520,05	217.742,83	1,65%	1,34%	1,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.060.895,50	0,00	30.000,00	6.097.824,35	66.928,85	1,10%	0,91%	1,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.225.265,31	0,00	1.050.000,00	9.288.172,51	112.907,20	1,10%	0,95%	1,22%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	5.844.011,16	0,00	0,00	5.896.685,36	52.674,20	0,90%	0,42%	0,90%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	11.263.381,16	0,00	0,00	11.326.180,43	62.799,27	0,56%	0,16%	0,56%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.319.157,75	0,00	0,00	2.329.973,22	10.815,47	0,47%	0,01%	0,47%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.107.366,33	0,00	0,00	6.124.862,60	17.496,27	0,29%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.238,89	21.548,50	16.686,46	34.196,44	95,51	0,19%	0,00%	0,39%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	622.374,53	915.257,39	1.184.429,51	354.217,63	1.015,22	0,07%	0,00%	0,41%
Total Renda Fixa					2.005.906,02	1,66%	1,15%	

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(%)
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.539.953,48	0,00	0,00	2.686.899,34	146.945,86	5,79%	5,74%	5,79%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.200.238,85	0,00	0,00	3.364.795,99	164.557,14	5,14%	6,38%	5,14%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.102.952,81	0,00	0,00	7.447.184,29	344.231,48	4,85%	7,05%	4,85%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.759.455,98	0,00	0,00	2.888.776,74	129.320,76	4,69%	4,94%	4,69%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.873.783,29	0,00	0,00	3.002.670,12	128.886,83	4,48%	7,51%	4,48%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.641.517,39	0,00	0,00	2.745.904,63	104.387,24	3,95%	3,84%	3,95%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.449.654,86	0,00	0,00	6.490.706,37	41.051,51	0,64%	0,19%	0,64%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.207.096,85	0,00	0,00	3.202.309,83	-4.787,02	-0,15%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.376.942,33	0,00	0,00	2.371.108,87	-5.833,46	-0,25%	-	-
Total Renda Variável					1.048.760,34	3,16%	4,82%	

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	10.401.116,28	3.047.784,05	0,00	14.348.518,52	899.618,19	6,69%	6,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.579.574,78	2.740.192,40	0,00	15.917.906,14	598.138,96	4,10%	4,22%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.693.138,03	0,00	0,00	12.241.372,75	548.234,72	4,69%	4,69%
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	10.963.314,44	0,00	0,00	11.450.039,47	486.725,03	4,44%	4,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	10.183.973,00	0,00	10.542.479,72	358.506,72	3,52%	5,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.010.736,08	0,00	1.050.000,00	9.288.172,51	327.436,43	3,27%	3,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	13.173.646,27	140.000,00	13.359.520,05	325.873,78	2,57%	4,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.551.927,66	0,00	1.667.757,72	6.097.824,35	213.654,41	3,07%	3,19%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	11.129.898,25	0,00	0,00	11.326.180,43	196.282,18	1,76%	1,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.922.708,36	0,00	0,00	3.082.244,22	159.535,86	5,46%	5,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	10.032.718,85	0,00	10.172.974,71	0,00	140.255,86	1,40%	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	5.767.066,35	0,00	0,00	5.896.685,36	129.619,01	2,25%	2,25%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.024.963,64	0,00	0,00	6.124.862,60	99.898,96	1,66%	1,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.814.533,93	1.180.000,00	13.080.115,43	0,00	85.581,50	0,69%	1,74%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.690.046,60	0,00	2.740.192,40	0,00	50.145,80	1,86%	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.295.552,46	1.237.757,72	1.237.757,72	2.329.973,22	34.420,76	1,32%	1,51%
BBIF MASTER FIDC LP	183.854,42	0,00	0,00	203.334,52	19.480,10	10,60%	10,60%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	287.689,15	3.341.524,36	3.277.521,59	354.217,63	2.525,71	0,16%	1,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.921,19	6.215.828,04	6.224.252,51	34.196,44	1.699,72	0,24%	1,27%
Total Renda Fixa					4.677.633,70	3,94%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.611.152,75	0,00	0,00	7.447.184,29	836.031,54	12,65%	12,65%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.082.270,74	0,00	0,00	3.364.795,99	282.525,25	9,17%	9,17%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.489.933,30	0,00	0,00	2.745.904,63	255.971,33	10,28%	10,28%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.434.302,63	0,00	0,00	2.686.899,34	252.596,71	10,38%	10,38%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.644.205,78	0,00	0,00	2.888.776,74	244.570,96	9,25%	9,25%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.855.390,43	0,00	0,00	3.002.670,12	147.279,69	5,16%	5,16%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.370.277,50	0,00	0,00	6.490.706,37	120.428,87	1,89%	1,89%
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.036.140,74	0,00	3.047.784,05	0,00	11.643,31	0,38%	0,04%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.217.957,57	0,00	0,00	3.202.309,83	-15.647,74	-0,49%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.389.073,67	0,00	0,00	2.371.108,87	-17.964,80	-0,75%	-
Total Renda Variável					2.117.435,12	6,47%	

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	7.056.909,05	6.047.784,05	0,00	14.348.518,52	1.243.825,42	11,27%	10,92%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.423.320,62	3.000.000,00	0,00	12.241.372,75	818.052,13	7,71%	7,71%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	15.149.012,10	0,00	15.917.906,14	768.894,04	5,54%	7,16%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	10.738.665,58	0,00	0,00	11.450.039,47	711.373,89	6,62%	6,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.766.164,53	0,00	1.050.000,00	9.288.172,51	572.007,98	5,86%	5,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.803.840,78	2.585.443,95	1.667.757,72	6.097.824,35	376.297,34	5,41%	5,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	6.797.581,87	3.000.000,00	10.172.974,71	0,00	375.392,84	4,57%	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	10.952.546,73	0,00	0,00	11.326.180,43	373.633,70	3,41%	3,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	10.183.973,00	0,00	10.542.479,72	358.506,72	3,52%	8,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	13.173.646,27	140.000,00	13.359.520,05	325.873,78	2,57%	7,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.071.474,34	3.715.000,00	25.110.833,42	0,00	324.359,08	1,96%	3,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.900.271,48	0,00	75.443,95	3.082.244,22	257.416,69	9,04%	9,04%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	2.663.432,06	3.000.000,00	0,00	5.896.685,36	233.253,30	5,00%	4,92%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	14.588.732,73	1.237.757,72	13.646.577,42	2.329.973,22	150.060,19	2,53%	3,05%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.621.939,40	0,00	2.740.192,40	0,00	118.253,00	4,51%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.456.343,58	0,00	3.480.586,95	0,00	24.243,37	0,70%	3,01%
BBIF MASTER FIDC LP	186.980,37	0,00	0,00	203.334,52	16.354,15	8,75%	8,75%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	682.958,30	0,00	687.493,44	0,00	4.535,14	0,68%	3,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	46.665,94	5.912.740,66	5.609.327,62	354.217,63	4.138,65	0,33%	2,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	448.315,44	9.497.190,55	9.914.018,70	34.196,44	2.709,15	0,50%	2,53%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.582.200,85	0,00	148.781,35	6.124.862,60	-308.556,90	-4,81%	-6,64%
Total Renda Fixa					6.750.623,66	5,81%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.349.343,08	0,00	0,00	7.447.184,29	1.097.841,21	17,29%	17,29%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.335.312,35	0,00	0,00	2.888.776,74	553.464,39	23,70%	23,70%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.845.352,20	0,00	0,00	3.364.795,99	519.443,79	18,26%	18,26%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.236.141,03	0,00	0,00	2.686.899,34	450.758,31	20,16%	20,16%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.334.265,34	0,00	0,00	2.745.904,63	411.639,29	17,63%	17,63%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.666.756,01	0,00	0,00	3.002.670,12	335.914,11	12,60%	12,60%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.269.727,56	0,00	0,00	6.490.706,37	220.978,81	3,52%	3,52%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.420.664,96	880.000,00	0,00	2.371.108,87	70.443,91	5,55%	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.979.123,66	0,00	3.047.784,05	0,00	68.660,39	2,30%	1,95%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.233.455,25	0,00	0,00	3.202.309,83	-31.145,42	-0,96%	-
Total Renda Variável					3.697.998,79	11,64%	