

Relatório Analítico dos Inv em junho, 2º Trimestre e 1º semes



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	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	33.276.225,43	18,24%	920	0,38%	At
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.246.112,00	1,23%	45	1,17%	At
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.319.263,38	2,92%	220	0,36%	At
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	22.283.755,31	12,22%	873	0,29%	At
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	5.739.133,94	3,15%	107	0,57%	At
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	7.276.151,41	3,99%	73	0,53%	At
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.214.425,87	2,86%	507	0,07%	At
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	16.582.132,19	9,09%	1.419	0,11%	At
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.049.686,08	1,67%	334	0,11%	At
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.399.818,40	3,51%	1.250	0,07%	At
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.661.202,32	1,46%	688	0,05%	At
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.424.786,83	1,88%	889	0,03%	At
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.889.551,13	1,04%	576	0,05%	At
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	235.498,55	0,13%	115	0,04%	At
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.072.969,50	1,14%	104	0,34%	At
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.512.368,92	6,31%	909	0,10%	At
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.112.230,70	0,61%	308	0,04%	At
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.091.816,98	4,98%	616	0,16%	At
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.687.585,69	1,47%	245	0,06%	Art
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.712.419,60	0,94%	115	0,27%	Art
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	19.710.159,24	10,81%	560	0,30%	Art
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.129.860,71	1,17%	328	0,43%	Art

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

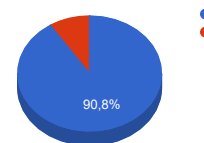
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.506.411,93	1,37%	158	0,48%	At
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.696.817,37	2,57%	4.506	0,60%	
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.432.739,13	2,43%	6.064	0,33%	
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.232.143,93	1,22%	955	0,46%	
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	914.795,65	0,50%	232	0,16%	
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25 du	Não há	2.001.338,25	1,10%	534	4,19%	
		Total	182.411.400,44				

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

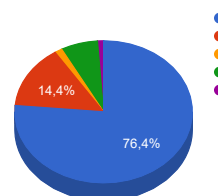
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	139.387.128,94	76,41%	15,00%	40,00%	100,00%	43.024.271,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	109.446.840,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	26.240.025,24	14,39%	0,00%	29,00%	40,00%	46.724.534,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	9.120.570,02
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.506.411,93	1,37%	0,00%	5,00%	20,00%	33.975.868,16
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	36.482.280,09
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.276.496,08	6,73%	0,00%	5,00%	10,00%	5.964.643,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	9.120.570,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	9.120.570,02
Em Enquadramento - RV	0,00%	2.001.338,25	1,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.001.338,25
Total Carteira		182.411.400,44					

RENDA FIXA	165.627.154,18	90,80%
RENDA VARIÁVEL	16.784.246,26	9,20%

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%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	139.387.128,94	76,41%	15,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	26.240.025,24	14,39%	0,00%	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 "	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 "	2.506.411,93	1,37%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	12.276.496,08	6,73%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Em Enquadramento - RV	2.001.338,25	1,10%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	182.411.400,44	100,00%	15,00	300,00

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	119.381.468,56	65,45%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	54.555.618,84	29,91%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	3.785.389,10	2,08%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	2.687.585,69	1,47%	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
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%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,00%	20,79%	12,31%	20,79%	39,92%	48,15%	0,20%	3,080%
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%
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%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,97%	8,21%	6,68%	8,21%	15,47%	19,36%	0,20%	2,153%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	1,56%	2,12%	1,56%	4,04%	9,25%	0,20%	0,461%
IDKA IPCA 5 Anos	3,06%	11,61%	7,16%	11,61%	23,26%	35,06%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,82%	8,23%	4,84%	8,23%	17,29%	28,77%	0,20%	1,509%
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%
IRF-M	2,16%	6,98%	4,59%	6,98%	15,72%	26,07%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,14%	6,86%	4,54%	6,86%	15,51%	25,56%	0,20%	1,189%
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%
IMA Geral ex-C	1,95%	7,74%	4,69%	7,74%	15,64%	25,19%	-	-

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	8,23%	5,14%	8,23%	15,98%	25,74%	0,30%	1,213%
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%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,82%	6,65%	4,37%	6,65%	15,16%	27,69%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,90%	6,62%	4,44%	6,62%	14,87%	26,97%	0,20%	1,095%
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%
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%
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%
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%
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%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,80%	0,000%
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%

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

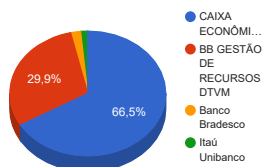
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,55%	8,36%	5,08%	8,36%	12,90%	24,68%	0,40%	1,493%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,10%	7,71%	4,69%	7,71%	15,43%	-	0,40%	1,139%

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
IGC	4,46%	15,89%	7,00%	15,89%	41,30%	54,53%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,24%	15,05%	6,32%	15,05%	41,15%	55,33%	1,00%	7,253%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1,00%	4,28%	2,67%	4,28%	-	-	1,60%	0,604%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-	-	-	-	-	-	1,50%	-
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%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,49%	6,33%	2,94%	6,33%	14,39%	25,65%	1,00%	2,391%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,69%	4,16%	2,26%	4,16%	7,97%	17,52%	0,60%	0,283%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	121.382.806,81	66,54%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	54.555.618,84	29,91%
Banco Bradesco	3.785.389,10	2,08%
Itaú Unibanco	2.687.585,69	1,47%



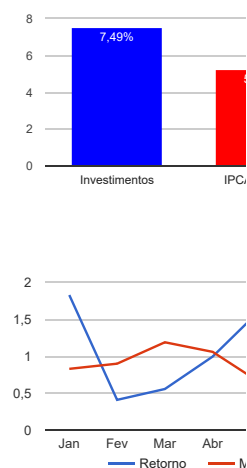
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	57.632.950,24	31,60%
IMA-B	27.880.337,31	15,28%
GESTÃO DURATION	24.110.164,53	13,22%
IRF-M 1	22.981.950,59	12,60%
MULTIMERCADO	12.276.496,08	6,73%
IMA-B 5	11.053.471,90	6,06%
IMA-GERAL	5.554.761,93	3,05%
IMA-GERAL EX-C	5.214.425,87	2,86%
IMA-B 5+	4.161.916,78	2,28%
IRF-M	2.661.202,32	1,46%
AÇÕES - SETORIAIS	2.506.411,93	1,37%
IDKA IPCA 5A	2.246.112,00	1,23%
CDI	2.129.860,71	1,17%
AÇÕES - LIVRES	2.001.338,25	1,10%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	163.573.881,49	1.268.699,00	89.778,36	167.767.882,90	3.015.080,77	1,83%	0,83%	220,06%	0,84%
Fevereiro	167.767.882,90	16.288.526,61	13.896.797,26	170.856.662,52	697.050,27	0,41%	0,90%	45,74%	1,48%
Março	170.856.662,52	1.048.654,84	465.622,89	172.394.410,35	954.715,88	0,56%	1,19%	46,66%	1,90%
Abril	172.394.410,35	1.298.472,26	993.284,01	174.420.839,61	1.721.241,01	1,00%	1,06%	94,07%	0,91%
Mai	174.420.839,61	5.377.075,75	3.748.865,62	178.919.813,14	2.870.763,40	1,63%	0,64%	254,53%	1,11%
Junho	178.919.813,14	12.858.323,84	12.681.876,57	182.411.400,44	3.315.140,03	1,85%	0,45%	411,03%	1,33%
Acumulado no ano					12.573.991,36	7,49%	5,18%	144,62%	

Acumulado no An



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 -
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.058.860,75	0,00	0,00	1.112.230,70	53.369,95	5,04%	3
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.904.360,25	0,00	0,00	3.049.686,08	145.325,83	5,00%	3
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.766.247,83	0,00	0,00	9.091.816,98	325.569,15	3,71%	2
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.102.237,11	0,00	0,00	11.512.368,92	410.131,81	3,69%	2
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.065.948,95	0,00	0,00	7.276.151,41	210.202,46	2,97%	2
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.826.542,85	3.373.667,00	0,00	19.710.159,24	509.949,39	2,66%	1
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.628.013,13	1.000.000,00	0,00	2.687.585,69	59.572,56	2,27%	1
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.103.666,05	0,00	0,00	5.214.425,87	110.759,82	2,17%	1
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.605.444,61	0,00	0,00	2.661.202,32	55.757,71	2,14%	1
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.677.252,59	0,00	0,00	1.712.419,60	35.167,01	2,10%	1
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	231.039,15	0,00	0,00	235.498,55	4.459,40	1,93%	1
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.219.112,08	0,00	0,00	5.319.263,38	100.151,30	1,92%	1
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.034.234,84	0,00	0,00	2.072.969,50	38.734,66	1,90%	1
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.206.066,94	0,00	0,00	2.246.112,00	40.045,06	1,82%	1
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.857.959,52	0,00	0,00	1.889.551,13	31.591,61	1,70%	1
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.367.596,22	0,00	0,00	3.424.786,83	57.190,61	1,70%	1
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.040.108,36	0,00	0,00	22.283.755,31	243.646,95	1,11%	0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.378.255,43	0,00	4.500.000,00	33.276.225,43	397.970,00	1,06%	0
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.704.119,65	0,00	0,00	5.739.133,94	35.014,29	0,61%	0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.363.386,75	0,00	0,00	6.399.818,40	36.431,65	0,57%	0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.473.083,83	0,00	3.000.000,00	16.582.132,19	109.048,36	0,56%	0
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.818.075,38	5.484.656,84	5.181.876,57	2.129.860,71	9.005,06	0,12%	0
				Total Renda Fixa	3.019.094,64	1,82%	1

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 -
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.404.525,73	0,00	0,00	2.506.411,93	101.886,20	4,24%	7
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.336.967,86	1.000.000,00	0,00	4.432.739,13	95.771,27	2,21%	1
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.628.019,67	0,00	0,00	4.696.817,37	68.797,70	1,49%	2
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.210.124,48	0,00	0,00	2.232.143,93	22.019,45	1,00%	0
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	908.563,13	0,00	0,00	914.795,65	6.232,52	0,69%	0
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.001.338,25	1.338,25	0,07%	
Total Renda Variável					296.045,39	1,80%	2

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 (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.594.048,03	0,00	4.500.000,00	33.276.225,43	1.182.177,40	3,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	13.523.578,54	5.111.735,26	0,00	19.710.159,24	1.074.845,44	6,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.555.833,64	0,00	0,00	11.512.368,92	956.535,28	9,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.334.753,63	0,00	0,00	9.091.816,98	757.063,35	9,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.594.922,41	0,00	0,00	22.283.755,31	688.832,90	3,19%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.820.338,19	0,00	0,00	7.276.151,41	455.813,22	6,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.715.308,56	0,00	0,00	3.049.686,08	334.377,52	12,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.249.992,12	0,00	3.000.000,00	16.582.132,19	332.140,07	1,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.959.586,32	0,00	0,00	5.214.425,87	254.839,55	5,14%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.084.745,33	0,00	0,00	5.319.263,38	234.518,05	4,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.286.641,15	0,00	0,00	3.424.786,83	138.145,68	4,20%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	989.958,43	0,00	0,00	1.112.230,70	122.272,27	12,35%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.620.257,09	0,00	0,00	5.739.133,94	118.876,85	2,12%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.545.719,59	0,00	0,00	2.661.202,32	115.482,73	4,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.291.204,84	0,00	0,00	6.399.818,40	108.613,56	1,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.142.437,75	0,00	0,00	2.246.112,00	103.674,25	4,84%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.635.728,22	0,00	0,00	1.712.419,60	76.691,38	4,69%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.813.094,74	0,00	0,00	1.889.551,13	76.456,39	4,22%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.612.714,26	0,00	2.687.585,69	74.871,43	3,24%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.072.969,50	72.969,50	3,65%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.599.469,91	6.809.422,33	8.313.053,61	2.129.860,71	34.022,08	0,75%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.588.761,95	0,00	1.610.972,59	0,00	22.210,64	1,40%

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 (%)
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	225.124,38	0,00	0,00	235.498,55	10.374,17	4,61%
				Total Renda Fixa	7.345.803,71	4,57%

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 (%)
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.234.271,31	1.000.000,00	0,00	4.432.739,13	198.467,82	5,45%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.357.471,73	0,00	0,00	2.506.411,93	148.940,20	6,32%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.562.504,64	0,00	0,00	4.696.817,37	134.312,73	2,94%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.174.119,42	0,00	0,00	2.232.143,93	58.024,51	2,67%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	894.538,43	0,00	0,00	914.795,65	20.257,22	2,26%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.001.338,25	1.338,25	0,07%
				Total Renda Variável	561.340,73	3,84%

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 (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	46.750.407,41	20.554,00	15.722.313,57	33.276.225,43	2.227.577,59	5,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.003.455,10	0,00	0,00	11.512.368,92	1.508.913,82	15,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	3.035.836,34	15.422.529,66	0,00	19.710.159,24	1.251.793,24	10,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.903.249,24	0,00	0,00	9.091.816,98	1.188.567,74	15,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.606.737,58	3.500.000,00	0,00	22.283.755,31	1.177.017,73	5,79%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.724.314,75	0,00	152.925,94	7.276.151,41	704.762,60	10,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.971.766,81	0,00	3.000.000,00	16.582.132,19	610.365,38	3,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.239.544,13	306.351,69	0,00	3.049.686,08	503.790,26	20,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.818.098,80	0,00	0,00	5.214.425,87	396.327,07	8,23%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.944.454,56	0,00	0,00	5.319.263,38	374.808,82	7,58%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.651.153,11	0,00	153.425,73	5.739.133,94	241.406,56	4,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.195.721,06	0,00	0,00	3.424.786,83	229.065,77	7,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.200.702,91	0,00	0,00	6.399.818,40	199.115,49	3,21%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	869.013,22	55.477,08	0,00	1.112.230,70	187.740,40	20,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.129.478,73	0,00	55.477,08	2.246.112,00	172.110,35	8,23%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.490.366,93	0,00	0,00	2.661.202,32	170.835,39	6,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.763.273,49	0,00	0,00	1.889.551,13	126.277,64	7,16%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.589.778,29	0,00	0,00	1.712.419,60	122.641,31	7,71%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.011.423,78	9.216.956,45	9.175.940,64	2.129.860,71	77.421,12	1,91%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.612.714,26	0,00	2.687.585,69	74.871,43	3,24%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.072.969,50	72.969,50	3,65%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.540.633,80	0,00	1.610.972,59	0,00	70.338,79	4,57%

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 (%)
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	218.874,85	0,00	0,00	235.498,55	16.623,70	7,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.994.109,73	0,00	2.005.169,16	0,00	11.059,43	0,55%
			Total Renda Fixa		11.716.401,13	7,54%

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 (%)
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.104.912,11	1.000.000,00	0,00	4.432.739,13	327.827,02	9,85%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.417.131,53	0,00	0,00	4.696.817,37	279.685,84	6,33%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	380.781,93	2.005.169,16	0,00	2.506.411,93	120.460,84	14,10%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.140.440,35	0,00	0,00	2.232.143,93	91.703,58	4,28%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	878.220,95	0,00	0,00	914.795,65	36.574,70	4,16%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.001.338,25	1.338,25	0,07%
				Total Renda Variável	857.590,23	6,70%