

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
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.499.237,17	2,68%	104	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	765.281,62	0,82%	308	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.877.556,35	11,67%	616	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.741.146,33	12,59%	105	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	268.873,07	0,29%	267	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.224.907,77	3,46%	889	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.352.998,76	10,03%	909	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.823.059,92	4,10%	920	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.821.538,63	5,17%	1.419	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.468.995,85	2,65%	873	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.009.545,98	3,23%	283	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	247.506,26	0,27%	26	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.177.249,78	9,84%	244	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.399.362,94	7,94%	560	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	906.796,84	0,97%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.168,17	0,01%	95	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.956.649,62	4,24%	115	0,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.446.533,75	7,99%	104	0,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	395.118,69	0,42%	374	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.895,17	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.972.972,42	2,12%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	773.709,39	0,83%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

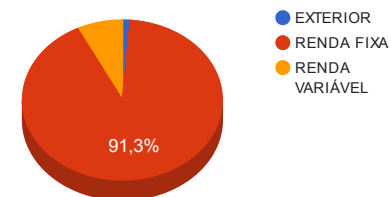
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	1.154.626,89	1,24%	197	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%			Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.044.563,40	3,27%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.725.078,93	2,92%		5,78%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	D+4	Não há	1.170.623,96	1,26%	69	0,22%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total			93.234.997,67				

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

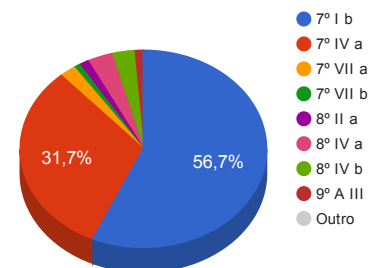
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	52.853.141,45	56,69%	15,00%	25,00%	70,00%	12.411.356,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	55.940.998,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	29.535.386,05	31,68%	10,00%	30,00%	40,00%	7.758.613,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.977.867,59	2,12%	2,00%	4,00%	5,00%	2.683.882,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	773.709,39	0,83%	0,00%	1,00%	5,00%	3.888.040,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.154.626,89	1,24%	2,00%	10,00%	20,00%	17.492.372,64
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	2,00%	10,00%	10,00%	9.323.499,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.044.563,40	3,27%	2,00%	5,00%	5,00%	1.617.186,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.725.078,93	2,92%	2,00%	5,00%	5,00%	1.936.670,95
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.170.623,96	1,26%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.170.623,96
Total Carteira		93.234.997,67					

EXTERIOR	1.170.623,96	1,26%
RENDA FIXA	85.140.104,48	91,32%
RENDA VARIÁVEL	6.924.269,23	7,43%

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 "	52.853.141,45	56,69%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	29.535.386,05	31,68%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.977.867,59	2,12%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	773.709,39	0,83%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.154.626,89	1,24%	2,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.044.563,40	3,27%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.725.078,93	2,92%	2,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	1.170.623,96	1,26%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	93.234.997,67	100,00%	40,00	240,00

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
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	30.209.026,60	32,40%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.061.365,05	32,24%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.289.083,60	24,98%	0,00%
ROMA ASSET	3.044.563,40	3,27%	0,72%
Reditus Investimentos	2.725.078,93	2,92%	-
PETRA Capital	1.972.972,42	2,12%	0,04%
Elleven Gestora de Recursos	1.154.303,10	1,24%	0,06%
SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS	773.709,39	0,83%	8,35%
BRASIL PLURAL	4.895,18	0,01%	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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	15,04%	9,08%	15,04%	28,39%	38,55%	0,20%	2,331%	7,63%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,71%	15,00%	9,05%	15,00%	28,30%	38,35%	0,20%	2,330%	7,66%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	15,00%	9,04%	15,00%	28,48%	38,78%	0,30%	2,318%	7,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,69%	15,08%	9,06%	15,08%	28,54%	38,72%	0,20%	2,313%	7,71%
IRF-M 1+	2,72%	8,35%	5,62%	8,35%	19,18%	30,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,71%	8,12%	5,50%	8,12%	19,04%	29,61%	0,20%	1,576%	5,55%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,82%	6,65%	4,37%	6,65%	15,16%	27,69%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,90%	6,62%	4,44%	6,62%	14,87%	26,97%	0,20%	1,095%	3,51%
IMA-B 5	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,73%	7,19%	4,25%	7,19%	14,54%	25,45%	0,20%	1,378%	3,09%
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%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,83%	2,42%	3,83%	2,42%	3,62%	-5,08%	0,70%	1,126%	4,88%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,34%	-1,03%	1,64%	-1,03%	-10,09%	-16,60%	0,70%	1,023%	11,31%

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
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%
CDI + 3,50% ao ano	0,73%	4,82%	2,40%	4,82%	10,00%	22,17%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-30,67%	-31,30%	-24,51%	-31,30%	-49,33%	-23,49%	0,20%	-	32,66%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,23%	1,74%	3,23%	7,09%	15,23%	0,20%	0,148%	0,49%
BRADESCO 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%	-	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,30%	1,89%	0,97%	1,89%	-18,41%	-15,60%	1,00%	0,037%	21,25%
Selic	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,15%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	3,05%	1,53%	3,05%	6,24%	14,26%	0,20%	0,003%	0,11%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,31%	4,27%	1,71%	4,27%	7,56%	16,85%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,14%	-2,29%	-1,83%	-2,29%	-3,96%	-10,66%	0,15%	0,031%	1,25%
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%

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
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,10%	7,71%	4,69%	7,71%	15,43%	-	0,40%	1,139%	3,50%

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

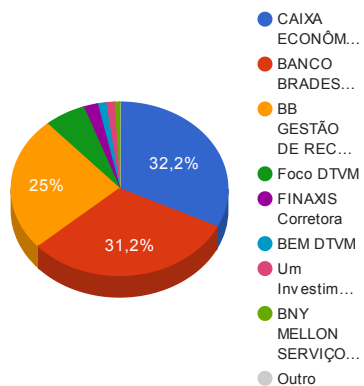
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	3,69%	11,27%	5,95%	11,27%	37,92%	78,11%	1,50%	7,101%	13,89%
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	23,07%	15,66%	23,07%	18,52%	-4,97%	1,50%	0,000%	30,90%
IPCA + 8,00% ao ano	0,59%	6,14%	2,64%	6,14%	11,53%	25,63%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	3,61%	31,24%	11,75%	31,24%	73,69%	-101,38%	0,12%	-	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (junho / 2019)

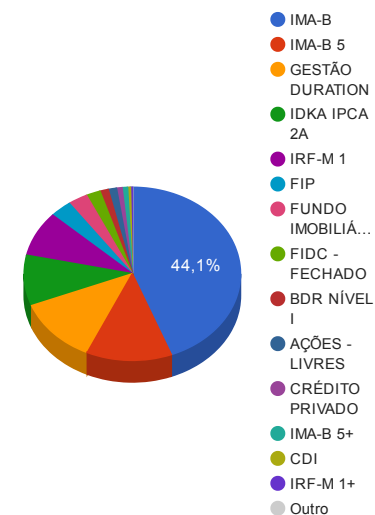
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	3,73%	16,06%	2,41%	16,06%	8,84%	45,03%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	3,87%	15,55%	2,25%	15,55%	7,85%	41,16%	0,70%	7,274%	25,65%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.061.365,05	32,24%
BANCO BRADESCO	29.054.399,71	31,16%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.289.083,60	24,98%
Foco DTVM	5.769.642,33	6,19%
FINAXIS Corretora	1.972.972,42	2,12%
BEM DTVM	1.154.626,89	1,24%
Um Investimentos	1.154.303,10	1,24%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	773.709,39	0,83%
Genial Investimentos	4.895,17	0,01%
Única Administradora	0,01	0,00%



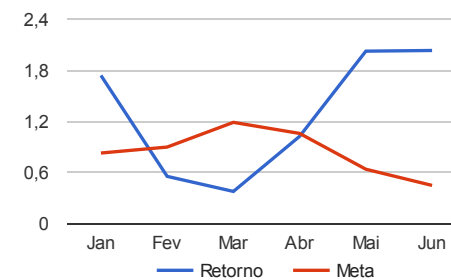
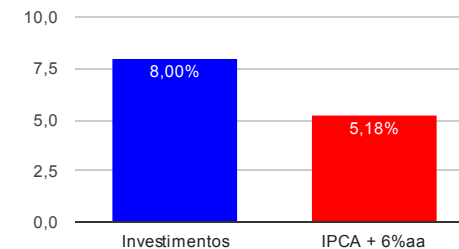
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	41.155.119,39	44,14%
IMA-B 5	11.825.744,62	12,68%
GESTÃO DURATION	11.356.012,56	12,18%
IDKA IPCA 2A	8.791.292,94	9,43%
IRF-M 1	7.831.084,61	8,40%
FIP	3.044.563,40	3,27%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.725.078,93	2,92%
FIDC - FECHADO	1.977.867,59	2,12%
BDR NÍVEL I	1.170.623,96	1,26%
AÇÕES - LIVRES	1.154.626,89	1,24%
CRÉDITO PRIVADO	773.709,39	0,83%
IMA-B 5+	765.281,62	0,82%
CDI	395.118,69	0,42%
IRF-M 1+	268.873,07	0,29%
MULTIMERCADO	0,01	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	78.828.877,72	1.233.485,47	1.621.374,10	79.813.128,50	1.372.139,41	1,74%	0,83%	209,31%	1,92%
Fevereiro	79.813.128,50	10.743.516,43	10.644.425,35	80.356.708,12	444.488,54	0,56%	0,90%	62,11%	1,51%
Março	80.356.708,12	2.401.763,05	1.537.803,44	81.528.777,96	308.110,23	0,38%	1,19%	31,78%	2,58%
Abril	81.528.777,96	2.071.482,80	1.708.070,68	82.732.328,13	840.138,05	1,03%	1,06%	96,83%	1,21%
Mai	82.732.328,13	1.741.188,91	1.680.280,94	84.470.253,00	1.677.016,90	2,03%	0,64%	316,17%	1.500.353,61%
Junho	84.470.253,00	4.824.713,34	3.348.779,30	87.693.930,89	1.747.743,85	2,03%	0,45%	451,55%	1,75%
Acumulado no ano					6.389.636,98	8,00%	5,18%	154,55%	

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(%)
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	858.164,73	0,00	0,00	906.796,84	48.632,11	5,67%	1,02%	0,34%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	728.559,89	0,00	0,00	765.281,62	36.721,73	5,04%	3,10%	5,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5.946,81	0,00	0,00	6.168,17	221,36	3,72%	2,34%	3,72%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.488.041,61	0,00	0,00	10.877.556,35	389.514,74	3,71%	2,33%	3,71%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.849.281,02	0,00	0,00	9.177.249,78	327.968,76	3,71%	2,32%	3,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.064.506,12	1.979.352,32	0,00	9.352.998,76	309.140,32	3,42%	2,31%	3,69%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	8.508.803,29	2.845.361,02	0,00	11.741.146,33	386.982,02	3,41%	2,33%	3,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.202.391,83	0,00	0,00	7.399.362,94	196.971,11	2,73%	1,65%	2,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	261.781,61	0,00	0,00	268.873,07	7.091,46	2,71%	1,58%	2,71%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.875.394,09	0,00	0,00	3.956.649,62	81.255,53	2,10%	1,14%	2,10%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.452.537,45	0,00	0,00	2.499.237,17	46.699,72	1,90%	1,10%	1,90%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.320.108,65	0,00	0,00	7.446.533,75	126.425,10	1,73%	1,38%	1,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.171.054,92	0,00	0,00	3.224.907,77	53.852,85	1,70%	1,34%	1,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.827.378,60	0,00	50.797,40	3.823.059,92	46.478,72	1,21%	0,95%	1,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.442.000,25	0,00	0,00	2.468.995,85	26.995,60	1,11%	0,91%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.982.637,55	0,00	1.193.062,07	4.821.538,63	31.963,15	0,53%	0,15%	0,57%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.232.032,18	0,00	1.243.859,47	3.009.545,98	21.373,27	0,51%	0,15%	0,56%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	393.272,18	0,00	0,00	395.118,69	1.846,51	0,47%	0,00%	0,47%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI CRÉDITO PRIVADO LP	771.419,58	0,00	0,00	773.709,39	2.289,81	0,30%	0,04%	0,30%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.975.829,13	0,00	0,00	1.972.972,42	-2.856,71	-0,14%	0,03%	-0,14%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	270.295,31	0,00	0,00	247.506,26	-22.789,05	-8,43%	1,13%	0,83%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.060,49	0,00	0,00	4.895,17	-2.165,32	-30,67%	-	-
Total Renda Fixa					2.114.612,79	2,55%	1,65%	

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(%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.113.582,91	0,00	0,00	1.154.626,89	41.043,98	3,69%	7,10%	3,69%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	960.345,50	0,00	962.655,16	0,00	2.309,66	0,24%	0,20%	0,66%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.045.343,13	0,00	0,00	3.044.563,40	-779,73	-0,03%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.057.516,55	0,00	0,00	2.725.078,93	-332.437,62	-10,87%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					-289.863,71	-3,54%	2,11%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.127.006,29	0,00	0,00	1.170.623,96	43.617,67	3,87%	7,27%	3,87%
				Total Exterior	43.617,67	3,87%	7,27%	

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 (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.971.796,89	0,00	0,00	10.877.556,35	905.759,46	9,08%	9,08%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.000.001,03	4.961.440,73	0,00	11.741.146,33	779.704,57	8,62%	9,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.416.022,52	0,00	0,00	9.177.249,78	761.227,26	9,04%	9,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.884.469,96	4.529.979,66	1.708.070,68	9.352.998,76	646.619,82	8,40%	9,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.934.914,85	0,00	0,00	7.399.362,94	464.448,09	6,70%	6,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.143.110,04	0,00	0,00	7.446.533,75	303.423,71	4,25%	4,25%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.779.449,51	0,00	0,00	3.956.649,62	177.200,11	4,69%	4,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.094.824,60	0,00	0,00	3.224.907,77	130.083,17	4,20%	4,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.823.296,09	0,00	127.983,57	3.823.059,92	127.747,40	3,38%	3,39%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.392.998,12	0,00	0,00	2.499.237,17	106.239,05	4,44%	4,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.914.098,00	0,00	1.193.062,07	4.821.538,63	100.502,70	1,70%	1,74%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	681.150,95	0,00	0,00	765.281,62	84.130,67	12,35%	12,35%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.942.908,23	0,00	3.015.221,45	3.009.545,98	81.859,20	1,62%	1,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.392.674,54	0,00	0,00	2.468.995,85	76.321,31	3,19%	3,19%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	847.190,55	0,00	0,00	906.796,84	59.606,29	7,04%	1,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.080.005,93	0,00	840.140,47	268.873,07	29.007,61	4,79%	5,50%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	766.295,96	0,00	0,00	773.709,39	7.413,43	0,97%	0,97%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	389.160,09	0,00	0,00	395.118,69	5.958,60	1,53%	1,53%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5.652,34	0,00	0,00	6.168,17	515,83	9,13%	9,13%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.484,58	0,00	0,00	4.895,17	-1.589,41	-24,51%	-24,51%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	262.481,37	0,00	0,00	247.506,26	-14.975,11	-5,71%	3,83%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.009.803,57	0,00	0,00	1.972.972,42	-36.831,15	-1,83%	-1,83%
Total Renda Fixa					4.794.372,61	6,07%	

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 (%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.089.824,08	0,00	0,00	1.154.626,89	64.802,81	5,95%	5,95%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	948.193,10	0,00	962.655,16	0,00	14.462,06	1,53%	1,95%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	11,75%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.046.913,38	0,00	0,00	3.044.563,40	-2.349,98	-0,08%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.067.584,25	0,00	0,00	2.725.078,93	-342.505,32	-11,17%	15,66%
Total Renda Variável					-265.590,43	-2,58%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.144.882,61	0,00	0,00	1.170.623,96	25.741,35	2,25%	2,25%
				Total Exterior	25.741,35	2,25%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.455.539,98	0,00	0,00	10.877.556,35	1.422.016,37	15,04%	15,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.148.290,79	7.633.071,56	0,00	11.741.146,33	959.783,98	13,60%	15,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.233.099,34	6.992.491,57	1.708.070,68	9.352.998,76	835.478,53	13,47%	15,08%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.347.253,61	0,00	9.177.249,78	829.996,17	9,94%	15,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.670.769,51	0,00	0,00	7.399.362,94	728.593,43	10,92%	10,92%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	6.947.026,04	0,00	0,00	7.446.533,75	499.507,71	7,19%	7,19%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.673.279,43	0,00	0,00	3.956.649,62	283.370,19	7,71%	7,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.876.816,20	0,00	277.158,50	3.823.059,92	223.402,22	5,96%	5,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.250.728,72	0,00	3.637.481,62	4.821.538,63	208.291,53	3,16%	3,23%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.101.060,78	0,00	5.278.957,71	3.009.545,98	187.442,91	3,08%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	799.760,38	2.240.392,92	0,00	3.224.907,77	184.754,47	7,27%	7,17%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.343.963,29	0,00	0,00	2.499.237,17	155.273,88	6,62%	6,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.334.501,22	0,00	0,00	2.468.995,85	134.494,63	5,76%	5,76%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	633.529,95	0,00	0,00	765.281,62	131.751,67	20,80%	20,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.053.896,69	0,00	840.140,47	268.873,07	55.116,85	7,39%	8,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.655.505,58	0,00	4.695.300,51	0,00	39.794,93	0,85%	3,21%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	870.062,12	0,00	0,00	906.796,84	36.734,72	4,22%	-1,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.623.919,58	0,00	3.651.953,10	0,00	28.033,52	0,77%	3,01%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.224.951,97	0,00	2.240.392,72	0,00	15.440,75	0,69%	2,99%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	759.378,66	0,00	0,00	773.709,39	14.330,73	1,89%	1,89%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	383.437,27	0,00	0,00	395.118,69	11.681,42	3,05%	3,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5.355,21	0,00	0,00	6.168,17	812,96	15,18%	15,18%

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 (%)
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.124,99	0,00	0,00	4.895,17	-2.229,82	-31,30%	-31,30%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	266.098,62	0,00	0,00	247.506,26	-18.592,36	-6,99%	2,42%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.019.239,65	0,00	0,00	1.972.972,42	-46.267,23	-2,29%	-2,29%
Total Renda Fixa					6.919.014,16	9,06%	

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	1.037.722,01	0,00	0,00	1.154.626,89	116.904,88	11,27%	11,27%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	935.173,09	0,00	962.655,16	0,00	27.482,07	2,94%	3,37%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	31,24%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.049.663,66	0,00	0,00	3.044.563,40	-5.100,26	-0,17%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.083.767,94	0,00	0,00	2.725.078,93	-358.689,01	-11,63%	23,07%
Total Renda Variável					-219.402,32	-0,68%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2019

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.013.064,88	0,00	0,00	1.170.623,96	157.559,08	15,55%	15,55%
				Total Exterior	157.559,08	15,55%	