



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

LEMA
ECONOMIA & FINANÇAS

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	7.522.265,88	3,24%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	108.553,80	0,05%	873	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	27.288.722,50	11,76%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.172.817,97	9,12%	1.419	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	6.027.866,58	2,60%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	41.617.179,22	17,93%	507	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.978.514,30	3,01%	308	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	15.792.493,57	6,80%	1.250	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.553.036,00	1,10%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.764.303,22	9,81%	98	2,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	569.903,77	0,25%	744	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.294.418,09	0,99%	115	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.410.482,44	1,04%	95	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.868.743,02	0,81%	49	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	506,99	0,00%	335	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.942.220,49	0,84%	719	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.585,37	0,00%	328	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	25.660.840,99	11,05%	560	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CDB - BRADESCO S.A.	s/info		4.749.592,83	2,05%			Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	2.333.449,77	1,01%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.699.497,43	0,73%	3.806	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

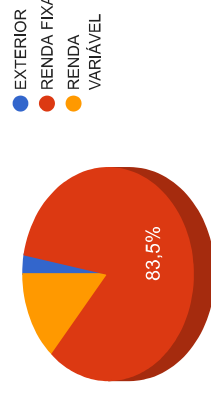
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	8.352.828,23	3,60%	4.983	0,64%	3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.060.154,12	2,61%	224	0,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.169.625,68	1,37%	751	4,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.060.686,01	0,46%	6.064	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.698.880,30	2,89%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	3.066.349,93	1,32%	960	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.536.564,85	0,66%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5 du	Não há	2.093.293,43	0,90%	114	0,75%	Artigo 9º - A, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.733.923,13	2,04%	2.621	8,37%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			232.129.299,91				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			682.493,84				Artigo 6º
Total			232.811.793,75				

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

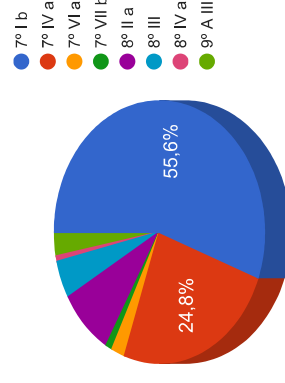
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea " b "	100,00%	129.061.449,82	55,60%	40,00%	55,00%	100,00%	103.067.850,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea " a "	40,00%	57.513.004,38	24,78%	0,00%	20,00%	40,00%	35.338.715,58
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea " a "	15,00%	4.749.592,83	2,05%	0,00%	0,00%	15,00%	30.069.802,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea " b "	5,00%	2.333.449,77	1,01%	0,00%	5,00%	5,00%	9.273.015,23
Artigo 8º, Inciso I, Alinea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	69.638.789,97
Artigo 8º, Inciso II, Alinea " a "	20,00%	19.282.105,46	8,31%	0,00%	7,00%	20,00%	27.143.754,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.825.916,24	4,66%	0,00%	5,00%	10,00%	12.387.013,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " a "	5,00%	1.536.564,85	0,66%	0,00%	0,00%	5,00%	10.069.900,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	11.606.465,00
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	6.827.216,56	2,94%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.827.216,56
Total Carteira		232.129.299,91					

EXTERIOR	6.827.216,56	2,94%
RENDA FIXA	194.339.990,64	83,72%
RENDA VARIÁVEL	31.644.586,55	13,63%

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%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	129.061.449,82	55,60%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
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 "	57.513.004,38	24,78%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	4.749.592,83	2,05%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	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 "	2.333.449,77	1,01%	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%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	19.282.105,46	8,31%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	10.825.916,24	4,66%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.536.564,85	0,66%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	232.129.299,91	100,00%	40,00	690,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (junho / 2019)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE JOÃO PESSOA - IPMJP
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 28/06/2019

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. (NIR)

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 9º - A, Inciso III	6.827.216,56	2,94%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	232.129.299,91	100,00%	40,00	690,00

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	137.679.396,23	59,31%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.147.846,64	24,62%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.803.930,34	6,81%	0,00%
Navi Capital	8.352.828,23	3,60%	0,49%
Itaú Unibanco	3.066.349,93	1,32%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.699.497,43	0,73%	0,00%
FL Asset Management	1.536.564,85	0,66%	1,39%

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%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	5,04%	20,88%	12,40%	20,88%	40,14%	48,32%	0,20%	3,105%	11,688%
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%	11,688%
IMA-B	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,72%	15,18%	9,13%	15,18%	28,89%	39,11%	0,20%	2,337%	8,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	5,64%	3,03%	5,64%	11,98%	22,93%	0,20%	0,778%	2,21%
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%	4,61%
CDB - BRADESCO S.A.	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-
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%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,76%	3,19%	5,76%	11,97%	22,82%	0,20%	0,911%	1,98%
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,10%	0,171%	0,49%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,47%	3,05%	1,51%	3,05%	6,55%	14,45%	0,20%	0,007%	0,27%

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
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%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,46%	2,99%	1,49%	2,99%	6,14%	13,79%	0,15%	0,000%	0,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,80%	0,000%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,53%	1,27%	2,53%	5,19%	11,74%	1,00%	0,004%	0,10%
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	5,18%	2,17%	5,18%	9,49%	21,07%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,37%	9,26%	5,56%	9,26%	19,45%	30,57%	0,15%	1,929%	4,97%
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%
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%
BRADESCO 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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

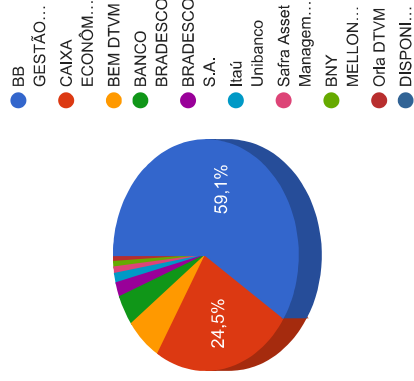
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,99%	19,26%	10,91%	19,26%	41,71%	61,51%	-	-	-
BRDESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	4,84%	14,79%	8,68%	14,79%	43,82%	73,59%	1,50%	6,789%	13,51%
S&P 500	6,89%	17,35%	3,79%	17,35%	8,22%	21,39%	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	7,16%	18,99%	4,76%	18,99%	12,13%	32,63%	1,00%	4,712%	18,64%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	6,20%	19,80%	11,92%	19,80%	38,67%	72,07%	2,00%	6,322%	18,86%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,51%	17,17%	6,71%	17,17%	43,39%	91,64%	1,50%	5,908%	18,84%
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3,53%	9,70%	5,10%	9,70%	31,76%	67,84%	2,00%	7,363%	13,75%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1,00%	4,28%	2,67%	4,28%	-	-	1,60%	0,604%	-
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,32%	9,97%	5,57%	9,97%	17,83%	28,99%	0,50%	1,757%	3,89%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

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

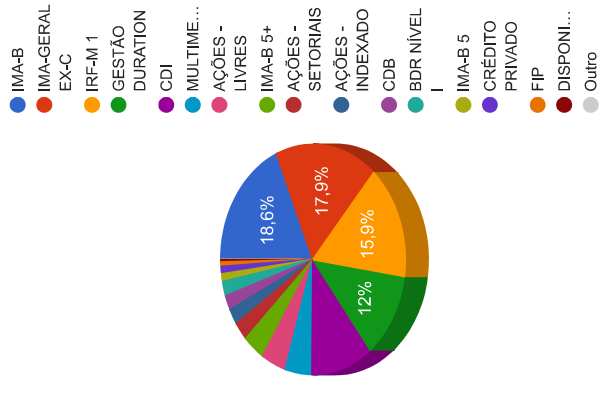
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	4,10%	15,59%	6,40%	15,59%	40,78%	61,42%	-	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,27%	13,71%	0,18%	13,71%	5,10%	37,23%	0,60%	5,719%	27,05%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	4,84%	20,88%	5,68%	20,88%	19,09%	58,68%	1,50%	5,425%	21,93%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	137.679.396,23	59,31%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.147.846,64	24,62%
BEM DTVM	14.412.982,35	6,21%
BANCO BRADESCO	9.743.776,22	4,20%
BRADESCO S.A.	4.749.592,83	2,05%
Itaú Unibanco	3.066.349,93	1,32%
Safra Asset Management	2.093.293,43	0,90%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.699.497,43	0,73%
Orla DTVM	1.536.564,85	0,66%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	682.493,84	0,29%



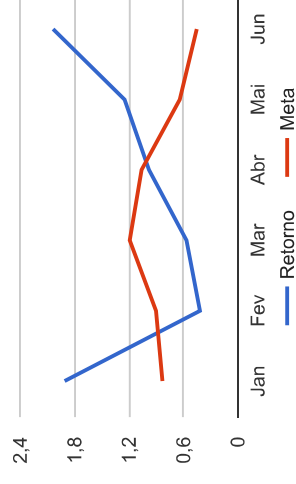
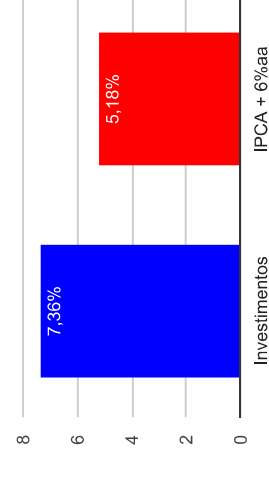
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	43.249.337,40	18,63%
IMA-GERAL EX-C	41.617.179,22	17,93%
IRF-M 1	36.965.311,54	15,92%
GESTÃO DURATION	27.955.259,08	12,04%
CDI	25.278.519,84	10,89%
MULTIMERCADO	10.825.916,24	4,66%
AÇÕES - LIVRES	10.052.325,66	4,33%
IMA-B 5+	8.847.257,32	3,81%
AÇÕES - SETORIAIS	6.060.154,12	2,61%
AÇÕES - INDEXADO	5.262.919,11	2,27%
CDB	4.749.592,83	2,05%
BDR NÍVEL I	4.733.923,13	2,04%
IMA-B 5	2.553.036,00	1,10%
CRÉDITO PRIVADO	2.333.449,77	1,01%
FIP	1.536.564,85	0,66%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	682.493,84	0,29%
IDKA IPCA 2A	108.553,80	0,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	199.411.604,80	20.626.986,59	16.650.150,24	207.272.364,46	3.883.923,31	1,91%	0,83%	229,62%	1,05%
Fevereiro	207.272.364,46	10.474.792,39	14.657.541,45	203.953.129,12	863.513,72	0,42%	0,90%	46,52%	1,61%
Março	203.953.129,12	15.891.091,15	9.701.658,82	211.329.677,18	1.187.115,73	0,56%	1,19%	47,33%	2,57%
Abril	211.329.677,18	5.484.736,28	3.092.687,54	215.814.157,01	2.092.431,09	0,98%	1,06%	92,40%	1,41%
Mai	215.814.157,01	9.099.821,58	6.810.104,16	220.824.063,73	2.720.189,30	1,25%	0,64%	194,68%	1,85%
Junho	220.824.063,73	18.978.751,74	12.308.350,77	232.129.299,91	4.634.835,21	2,04%	0,45%	452,40%	1,71%
Acumulado no ano					15.382.008,36	7,36%	5,18%	142,14%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.643.653,05	0,00	0,00	6.978.514,30	334.861,25	5,04%	3,10%	5,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.323.976,94	0,00	0,00	2.410.482,44	86.505,50	3,72%	2,34%	3,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	24.977.749,17	0,00	0,00	25.660.840,99	683.091,82	2,73%	1,65%	2,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.348.157,88	0,00	0,00	7.522.265,88	174.108,00	2,37%	1,93%	2,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.699.829,13	0,00	0,00	27.288.722,50	588.893,37	2,21%	1,71%	2,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.733.187,15	0,00	0,00	41.617.179,22	883.992,07	2,17%	1,21%	2,17%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.247.298,89	0,00	0,00	2.294.418,09	47.119,20	2,10%	1,14%	2,10%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2.303.382,36	0,00	0,00	2.333.449,77	30.067,41	1,31%	0,88%	1,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	107.366,89	0,00	0,00	108.553,80	1.186,91	1,11%	0,91%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.966.994,24	0,00	0,00	6.027.866,58	60.872,34	1,02%	0,78%	1,02%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.537.460,00	0,00	0,00	2.553.036,00	15.576,00	0,61%	0,46%	0,61%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	1.858.000,00	0,00	1.868.743,02	10.743,02	0,58%	3,10%	5,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.052.092,88	0,00	0,00	21.172.817,97	120.725,09	0,57%	0,15%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.702.593,12	0,00	0,00	15.792.493,57	89.900,45	0,57%	0,17%	0,57%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	22.658.633,94	0,00	0,00	22.764.303,22	105.669,28	0,47%	0,01%	0,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	567.309,05	0,00	0,00	569.903,77	2.594,72	0,46%	0,00%	0,46%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	504,69	0,00	0,00	506,99	2,30	0,46%	0,00%	0,46%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.578,97	0,00	0,00	1.585,37	6,40	0,41%	0,00%	0,41%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.870.169,45	1.378.293,79	1.314.427,60	1.942.220,49	8.184,85	0,25%	0,00%	0,39%
CDB - BRADESCO S.A.	0,00	15.742.457,95	10.993.923,17	4.749.592,83	1.058,05	0,01%	-	-
			Total Renda Fixa		3.245.159,03	1,70%	1,08%	

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(%)
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.861.367,97	0,00	0,00	3.066.349,93	204.981,96	7,16%	4,71%	7,16%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.600.267,11	0,00	0,00	1.699.497,43	99.230,32	6,20%	6,32%	6,20%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	5.780.280,75	0,00	0,00	6.060.154,12	279.873,37	4,84%	6,79%	4,84%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.992.052,27	0,00	0,00	8.352.828,23	360.775,96	4,51%	5,91%	4,51%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.061.407,60	0,00	0,00	3.169.625,68	108.218,08	3,53%	7,36%	3,53%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.036.601,83	0,00	0,00	1.060.666,01	24.084,18	2,32%	1,76%	2,32%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.632.797,77	0,00	0,00	6.698.880,30	66.082,53	1,00%	0,60%	1,00%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.536.669,29	0,00	0,00	1.536.564,85	-104,44	-0,01%	-	-
Total Renda Variável					1.143.141,96	3,75%	4,81%	

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(%)
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.996.644,04	0,00	0,00	2.093.293,43	96.649,39	4,84%	5,43%	4,84%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.584.037,30	0,00	0,00	4.733.923,13	149.885,83	3,27%	5,72%	3,27%
Total Exterior					246.535,22	3,75%	5,63%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.583.263,46	0,00	0,00	41.617.179,22	2.033.915,76	5,14%	5,14%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	24.050.144,43	0,00	0,00	25.660.840,99	1.610.696,56	6,70%	6,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.876.268,04	0,00	0,00	27.288.722,50	1.412.454,46	5,46%	5,46%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.211.336,42	0,00	0,00	6.978.514,30	767.177,88	12,35%	12,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.313.111,17	0,00	191.174,88	7.522.265,88	400.329,59	5,54%	5,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.810.911,38	0,00	0,00	21.172.817,97	361.906,59	1,74%	1,74%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	22.424.996,15	0,00	0,00	22.764.303,22	339.307,07	1,51%	1,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.491.565,48	4.449.488,67	2.400.282,43	15.792.493,57	251.721,85	1,60%	1,73%
BRAPESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.208.899,44	0,00	0,00	2.410.482,44	201.583,00	9,13%	9,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.850.741,60	0,00	0,00	6.027.866,58	177.124,98	3,03%	3,03%
BRAPESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.191.661,67	0,00	0,00	2.294.418,09	102.756,42	4,69%	4,69%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.500.154,00	0,00	0,00	2.553.036,00	52.882,00	2,12%	2,12%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	2.290.000,00	0,00	2.333.449,77	43.449,77	1,90%	3,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.397.733,67	2.005.043,02	3.497.442,03	1.942.220,49	36.885,83	1,00%	1,27%
BRAPESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	3.020.722,17	2.090.000,00	5.128.319,96	506,99	18.104,78	0,97%	1,49%
BRAPESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	1.858.000,00	0,00	1.868.743,02	10.743,02	0,58%	12,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	561.472,37	0,00	0,00	569.903,77	8.431,40	1,50%	1,50%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	105.198,19	0,00	0,00	108.553,80	3.355,61	3,19%	3,19%
CDB - BRADESCO S.A.	0,00	15.742.457,95	10.993.923,17	4.749.592,83	1.058,05	0,01%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.564,58	0,00	0,00	1.565,37	20,79	1,33%	1,33%
			Total Renda Fixa		7.833.905,41	4,31%	

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 (%)
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.827.611,55	0,00	0,00	8.352.828,23	525.216,68	6,71%	6,71%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FIC AÇÕES	5.576.278,51	0,00	0,00	6.060.154,12	483.875,61	8,68%	8,68%
XP INVESTOR FIC AÇÕES	1.518.450,41	0,00	0,00	1.699.497,43	181.047,02	11,92%	11,92%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.524.743,11	0,00	0,00	6.698.680,30	174.137,19	2,67%	2,67%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.015.764,73	0,00	0,00	3.169.625,68	153.860,95	5,10%	5,10%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.004.699,99	0,00	0,00	1.060.686,01	55.986,02	5,57%	5,57%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	3.032.309,96	0,00	3.066.349,93	34.039,97	1,12%	4,76%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.536.773,86	0,00	0,00	1.536.564,85	-209,01	-0,01%	-
Total Renda Variável					1.607.954,43	4,65%	

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 (%)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.725.610,80	0,00	0,00	4.733.923,13	8.312,33	0,18%	0,18%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.096.010,00	0,00	2.093.293,43	-2.716,57	-0,13%	5,68%
			Total Exterior		5.595,76	1,34%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.454.028,55	0,00	0,00	41.617.179,22	3.163.150,67	8,23%	8,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	23.134.093,72	0,00	0,00	25.660.840,99	2.526.747,27	10,92%	10,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.677.622,58	0,00	667.944,80	27.288.722,50	2.279.044,72	9,04%	9,04%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.777.086,07	0,00	0,00	6.978.514,30	1.201.428,23	20,80%	20,80%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	28.045.501,45	7.930.000,00	13.930.000,00	22.764.303,22	718.801,77	2,84%	3,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.490.298,59	0,00	4.000.000,00	21.172.817,97	682.519,38	3,22%	3,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.065.827,83	0,00	191.174,88	7.522.265,88	647.612,93	9,23%	9,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.297.482,98	4.449.488,67	2.400.282,43	15.792.493,57	445.804,35	3,09%	3,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.865.082,54	0,00	161.750,34	6.027.866,58	324.534,38	5,64%	5,64%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	2.197.652,00	0,00	2.410.482,44	212.830,44	9,68%	15,18%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.513.898,00	0,00	68.250,97	2.553.036,00	107.388,97	4,35%	1,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.293.151,70	8.509.474,34	11.960.832,64	1.942.220,49	100.427,09	1,99%	2,53%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.197.652,00	0,00	2.294.418,09	96.766,09	4,40%	7,71%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.244.096,00	0,00	2.297.011,50	0,00	52.915,50	2,36%	9,90%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	2.290.000,00	0,00	2.333.449,77	43.449,77	1,90%	6,74%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.898,03	7.732.339,97	7.756.876,78	1.585,37	24.224,15	1,96%	2,65%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,00	5.110.000,00	5.128.319,96	506,99	18.826,95	0,99%	2,99%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	553.266,70	0,00	0,00	569.903,77	16.637,07	3,01%	3,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	1.858.000,00	0,00	1.868.743,02	10.743,02	0,58%	20,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	102.640,50	0,00	0,00	108.553,80	5.913,30	5,76%	5,76%
CDB - BRADESCO S.A.	0,00	15.742.457,95	10.993.923,17	4.749.592,83	1.058,05	0,01%	-
			Total Renda Fixa		12.680.824,10	7,09%	

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 (%)
BRDESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	0,00	5.480.794,84	0,00	6.060.154,12	579.359,28	13,38%	14,79%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	7.930.000,00	0,00	8.352.828,23	422.828,23	5,33%	17,17%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3.353.032,92	0,00	3.664.125,51	0,00	311.092,59	9,28%	19,81%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.418.640,56	0,00	0,00	1.699.497,43	280.856,87	19,60%	19,80%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.423.668,94	0,00	0,00	6.698.880,30	275.211,36	4,28%	4,28%
BRDESCO VALUATION IBOVSPA FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.169.625,68	169.625,68	5,65%	9,70%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.060.686,01	60.686,01	6,07%	9,97%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	3.032.309,96	0,00	3.066.349,93	34.039,97	1,12%	18,99%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.537.263,81	0,00	0,00	1.536.564,85	-698,96	-0,05%	-
Total Renda Variável					2.133.001,03	9,97%	

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 (%)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.163.023,33	0,00	0,00	4.733.923,13	570.899,80	13,71%	13,71%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.096.010,00	0,00	2.093.293,43	-2.716,57	-0,13%	20,88%
			Total Exterior		568.183,23	15,04%	