

# 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
TÍTULOS PÚBLICOS			107.218.916,17	8,27%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	15.951.517,98	1,23%	27	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.002.839,35	2,24%	909	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.082.991,39	4,09%	334	1,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	10.514.612,61	0,81%	165	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	89.194.562,54	6,88%	576	2,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.751.504,95	0,29%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	146.098.729,88	11,27%	920	1,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	45.833.642,89	3,53%	25.232	3,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	7.033.435,95	0,54%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	31.023.395,26	2,39%	24	8,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	14.420.476,81	1,11%	73	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	108.294.548,08	8,35%	245	2,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	85.837.868,07	6,62%	411	3,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.294.382,75	0,72%	335	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	40.880,05	0,00%	719	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	162.559.042,51	12,54%	95	10,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	37.231.604,23	2,87%	560	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ou D+5 du	Não há	10.996.167,71	0,85%	8.639	2,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.670.242,61	1,36%	74	11,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	89.318.122,50	6,89%	17	11,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	64.470,91	0,00%	127	2,50%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

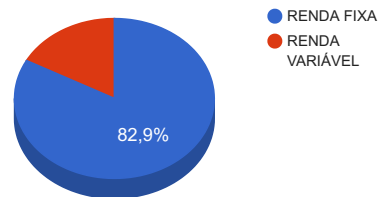
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	21.281.388,44	1,64%	52	2,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	16.195.911,84	1,25%	6.711	1,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	20.936.301,14	1,61%	111	6,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	27.311.938,65	2,11%	74	11,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.465.233,28	0,34%	4.011	1,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.575.909,76	0,58%	2.236	6,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	44.529.460,07	3,43%	4.983	3,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	D+2 a D+61	Não há	9.751.181,93	0,75%	4.690	2,67%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	691.254,03	0,05%	12	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	18.931.633,60	1,46%	45	5,52%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	31.025.246,55	2,39%	7.178	3,92%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	470.150,28	0,04%		0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.778.331,65	0,14%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.230.328,95	0,09%	17	1,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.337.183,05	0,41%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	1.981.257,76	0,15%		1,82%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	8.655.792,86	0,67%		11,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total</b>			<b>1.296.582.459,04</b>				

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

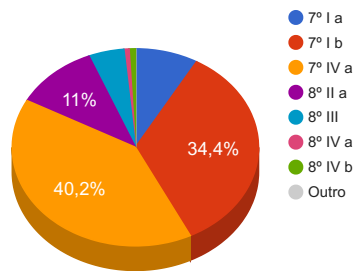
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	107.218.916,17	8,27%	7,00%	11,00%	15,00%	87.268.452,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	445.907.709,61	34,39%	25,00%	33,00%	60,00%	332.041.765,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	259.316.491,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	388.974.737,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	521.242.858,51	40,20%	5,00%	21,00%	40,00%	-2.609.874,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	64.470,91	0,00%	1,00%	3,00%	5,00%	64.764.652,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	64.829.122,95
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	8,00%	10,00%	129.658.245,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	142.296.143,18	10,97%	0,00%	1,00%	10,00%	-12.637.897,28
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	60.399.316,11	4,66%	2,00%	5,00%	10,00%	69.258.929,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.815.993,93	0,68%	1,00%	3,00%	5,00%	56.013.129,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.637.050,62	0,82%	1,00%	3,00%	5,00%	54.192.072,33
<b>Total Carteira</b>		<b>1.296.582.459,04</b>					

RENDA FIXA	1.074.433.955,20	82,87%
RENDA VARIÁVEL	222.148.503,84	17,13%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	107.218.916,17	8,27%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	445.907.709,61	34,39%	25,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	521.242.858,51	40,20%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	64.470,91	0,00%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	1,00%	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%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	142.296.143,18	10,97%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	60.399.316,11	4,66%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.815.993,93	0,68%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.637.050,62	0,82%	1,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>1.296.582.459,04</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00</b>	<b>220,00</b>

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	385.377.532,66	29,72%	0,08%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	261.171.547,76	20,14%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	125.964.790,69	9,72%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	107.218.916,17	8,27%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.750.055,20	7,69%	0,01%
WESTERN ASSET	80.980.275,41	6,25%	0,18%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	45.833.642,89	3,53%	0,13%
Navi Capital	44.529.460,07	3,43%	2,62%
XP GESTÃO DE RECURSOS	32.788.492,68	2,53%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	27.311.938,65	2,11%	4,35%
ITAÚ DTVM	21.281.388,44	1,64%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	20.936.301,14	1,61%	0,09%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	16.195.911,84	1,25%	0,05%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.655.792,86	0,67%	1,96%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	7.033.435,95	0,54%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.337.183,05	0,41%	-%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.981.257,76	0,15%	0,03%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.778.331,65	0,14%	0,00%%
ROMA ASSET	1.230.328,95	0,09%	0,29%%
CAPITÂNIA	691.254,03	0,05%	0,01%%
BRASIL PLURAL	470.150,28	0,04%	0,00%%
Gradual Investimentos	64.470,91	0,00%	0,63%%

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%	-	-	-
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%	11,62%

IMA-B	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	4,26%	16,24%	10,23%	16,24%	29,71%	39,78%	0,50%	2,739%	7,97%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	4,16%	15,99%	10,00%	15,99%	30,68%	42,59%	0,30%	2,593%	8,36%
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%
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%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,66%	13,48%	9,42%	13,48%	25,34%	27,11%	0,20%	2,154%	11,27%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3,24%	14,77%	8,72%	14,77%	28,29%	40,15%	0,40%	1,901%	7,06%
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%	8,39%
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%

IMA-B 5	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,45%	9,41%	5,87%	9,41%	19,62%	30,98%	0,40%	1,790%	4,37%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,97%	7,85%	4,53%	7,85%	15,37%	26,24%	0,50%	1,384%	3,08%
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%

IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-	-
------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

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
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%
130% do CDI	0,61%	4,01%	2,00%	4,01%	8,29%	18,75%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-9,65%	-	-	-	-	-37,09%	2,50%	-	-
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,48%	3,06%	1,58%	3,06%	6,22%	13,89%	0,20%	0,041%	0,13%
BRANCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,46%	2,99%	1,49%	2,99%	6,14%	13,79%	0,15%	0,000%	0,12%
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	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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,73%	4,78%	4,42%	4,78%	10,13%	14,83%	0,15%	1,345%	6,25%



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,99%	19,26%	10,91%	19,26%	41,71%	61,51%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,50%	11,30%	9,50%	11,30%	35,83%	80,50%	2,00%	6,583%	18,02%
S&P 500	6,89%	17,35%	3,79%	17,35%	8,22%	21,39%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7,12%	18,92%	4,73%	18,92%	12,44%	32,60%	1,00%	4,673%	18,51%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4,68%	14,51%	6,76%	14,51%	38,04%	57,96%	1,50%	6,684%	16,61%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,51%	17,17%	6,71%	17,17%	43,39%	91,64%	1,50%	5,908%	18,84%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	4,33%	14,65%	6,49%	14,65%	37,00%	62,24%	0,97%	6,163%	15,76%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3,95%	15,48%	5,67%	15,48%	39,58%	61,37%	2,00%	7,509%	17,40%
IDIV	3,11%	18,67%	9,64%	18,67%	47,74%	60,82%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,61%	23,94%	13,04%	23,94%	55,08%	60,67%	3,00%	5,282%	21,20%
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	0,14%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	-2,58%	-22,16%	-14,53%	-22,16%	-9,40%	13,25%	0,95%	20,273%	44,62%
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%	-	-	-

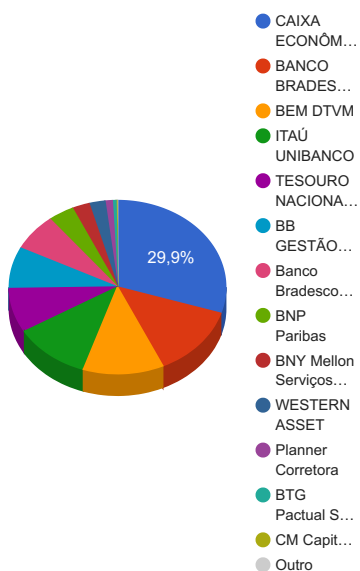
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	1,48%	3,52%	1,65%	3,52%	4,06%	15,01%	2,00%	1,720%	3,71%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,71%	2,28%	0,92%	2,28%	5,13%	15,42%	2,00%	0,752%	1,70%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-10,76%	-14,29%	-13,68%	-14,29%	-13,54%	-16,08%	0,55%	18,803%	10,97%

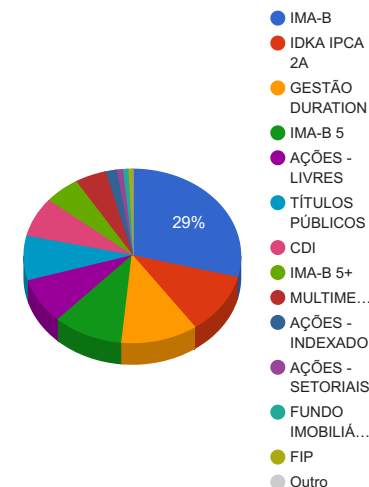
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	4,53%	23,30%	12,69%	23,30%	53,43%	55,08%	3,00%	5,211%	20,77%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	0,000%	0,41%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	0,014%	0,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	387.626.014,59	29,90%
BANCO BRADESCO	171.853.425,26	13,25%
BEM DTVM	154.807.254,59	11,94%
ITAÚ UNIBANCO	147.246.179,13	11,36%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	107.218.916,17	8,27%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.750.055,20	7,69%
Banco Bradesco S.A.	89.318.122,50	6,89%
BNP Paribas	49.955.028,86	3,85%
BNY Mellon Serviços Financeiros	33.479.746,71	2,58%
WESTERN ASSET	31.025.246,55	2,39%
Planner Corretora	13.992.975,91	1,08%
BTG Pactual Serviços Financeiros	7.033.435,95	0,54%
CM Capital Markets DTVM	1.981.257,76	0,15%
Orla DTVM	1.230.328,95	0,09%
Genial Investimentos	64.470,91	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	376.352.415,23	29,03%
IDKA IPCA 2A	146.098.729,88	11,27%
GESTÃO DURATION	145.526.152,31	11,22%
IMA-B 5	134.965.630,46	10,41%
AÇÕES - LIVRES	108.973.611,70	8,40%
TÍTULOS PÚBLICOS	107.218.916,17	8,27%
CDI	95.173.130,87	7,34%
IMA-B 5+	69.034.509,37	5,32%
MULTIMERCADO	60.399.316,11	4,66%
AÇÕES - INDEXADO	21.281.388,44	1,64%
AÇÕES - SETORIAIS	12.041.143,04	0,93%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.637.050,62	0,82%
FIP	8.815.993,93	0,68%
FIDC - FECHADO	64.470,91	0,00%



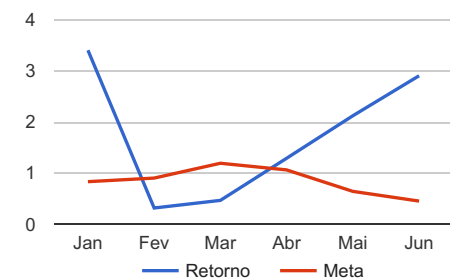
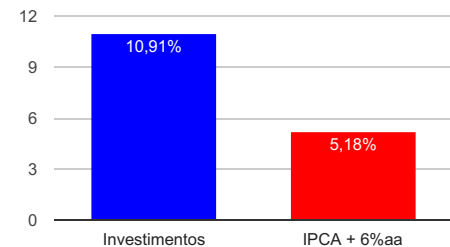
Carteira de Títulos Públicos - base (junho / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	2.964,257204	14.080.221,72	14.080.221,72
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	2.515,509771	16.929.380,76	16.929.380,76
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	2.315,991673	14.324.408,50	14.324.408,50
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	2.838,144079	6.243.916,97	6.243.916,97
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	2.412,107871	20.044.616,41	20.044.616,41

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.141.917.993,47	95.215.761,54	78.335.150,43	1.198.207.490,61	39.408.886,03	3,40%	0,83%	408,94%	2,04%
Fevereiro	1.198.207.490,61	82.922.503,27	85.993.182,74	1.198.910.406,03	3.773.594,89	0,31%	0,90%	35,17%	2,54%
Março	1.198.910.406,03	24.125.861,96	21.274.753,47	1.207.336.133,89	5.574.619,37	0,46%	1,19%	38,86%	3,85%
Abril	1.207.336.133,89	21.419.310,76	17.281.213,69	1.227.075.509,54	15.601.278,58	1,29%	1,06%	121,54%	1,92%
Mai	1.227.075.509,54	193.552.763,06	190.070.280,01	1.256.633.223,52	26.075.230,93	2,12%	0,64%	330,75%	2,46%
Junho	1.256.633.223,52	61.792.710,06	67.598.792,68	1.287.288.076,29	36.460.935,39	2,90%	0,45%	644,29%	2,35%
Acumulado no ano					126.894.545,19	10,91%	5,18%	210,78%	

**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(%)
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	61.220,19	0,00	0,00	64.470,91	3.250,72	5,31%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	50.553.442,57	0,00	0,00	53.082.991,39	2.529.548,82	5,00%	3,08%	5,00%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	79.032.625,30	7.000.000,00	0,00	89.318.122,50	3.285.497,20	3,82%	2,59%	4,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	156.725.251,17	0,00	0,00	162.559.042,51	5.833.791,34	3,72%	2,34%	3,72%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.969.603,97	0,00	0,00	29.002.839,35	1.033.235,38	3,69%	2,31%	3,69%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.388.785,22	0,00	0,00	15.951.517,98	562.732,76	3,66%	2,15%	3,66%
TÍTULOS PÚBLICOS	104.005.114,80	0,00	0,00	107.218.916,17	3.213.801,37	3,09%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	64.821.738,13	0,00	20.975.786,10	45.833.642,89	1.987.690,86	3,07%	1,90%	3,24%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	12.152.069,32	5.000.000,00	0,00	17.670.242,61	518.173,29	3,02%	2,74%	4,26%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.003.880,25	0,00	0,00	14.420.476,81	416.596,56	2,97%	2,15%	2,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	36.240.498,58	0,00	0,00	37.231.604,23	991.105,65	2,73%	1,65%	2,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	110.494.285,68	0,00	5.000.000,00	108.294.548,08	2.800.262,40	2,53%	1,49%	2,55%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	30.281.510,54	0,00	0,00	31.023.395,26	741.884,72	2,45%	1,79%	2,45%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	10.783.499,09	0,00	0,00	10.996.167,71	212.668,62	1,97%	1,38%	1,97%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.913.491,51	0,00	0,00	7.033.435,95	119.944,44	1,73%	1,34%	1,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	87.703.309,00	0,00	0,00	89.194.562,54	1.491.253,54	1,70%	1,35%	1,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	144.339.357,32	0,00	0,00	146.098.729,88	1.759.372,56	1,22%	0,95%	1,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.408.430,92	0,00	0,00	10.514.612,61	106.181,69	1,02%	0,78%	1,02%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.728.617,13	0,00	0,00	3.751.504,95	22.887,82	0,61%	0,46%	0,61%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	9.252.235,54	0,00	0,00	9.294.382,75	42.147,21	0,46%	0,00%	0,46%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	77.062.366,63	46.751.977,62	38.384.087,21	85.837.868,07	407.611,03	0,33%	0,04%	0,48%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.399,60	40.732,44	13.352,03	40.880,05	100,04	0,18%	0,00%	0,39%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>28.079.738,02</b>	<b>2,67%</b>	<b>1,67%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	28.963.160,63	0,00	0,00	31.025.246,55	2.062.085,92	7,12%	4,67%	7,12%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.351.175,84	0,00	0,00	16.195.911,84	844.736,00	5,50%	6,58%	5,50%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	20.329.969,25	0,00	0,00	21.281.388,44	951.419,19	4,68%	6,68%	4,68%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.268.517,69	0,00	0,00	4.465.233,28	196.715,59	4,61%	5,28%	4,61%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	7.247.894,95	0,00	0,00	7.575.909,76	328.014,81	4,53%	5,21%	4,53%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	42.606.140,38	0,00	0,00	44.529.460,07	1.923.319,69	4,51%	5,91%	4,51%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	20.066.638,38	0,00	0,00	20.936.301,14	869.662,76	4,33%	6,16%	4,33%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	23.368.997,72	3.000.000,00	0,00	27.311.938,65	942.940,93	3,58%	7,51%	3,95%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	8.475.441,63	0,00	0,00	8.655.792,86	180.351,23	2,13%	-	2,13%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.608.876,98	0,00	0,00	9.751.181,93	142.304,95	1,48%	1,72%	1,48%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	18.798.088,71	0,00	0,00	18.931.633,60	133.544,89	0,71%	0,75%	0,71%
LSH FIP	1.230.872,02	0,00	0,00	1.230.328,95	-543,07	-0,04%	0,01%	-0,04%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	5.345.161,42	0,00	0,00	5.337.183,05	-7.978,37	-0,15%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.782.706,75	0,00	0,00	1.778.331,65	-4.375,10	-0,25%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.989.244,91	0,00	0,00	1.981.257,76	-7.987,15	-0,40%	20,27%	-2,58%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	3.262.500,00	0,00	3.225.567,34	0,00	-36.932,66	-1,13%	6,86%	7,64%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	480.730,62	0,00	0,00	470.150,28	-10.580,34	-2,20%	0,00%	0,00%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	774.608,72	0,00	0,00	691.254,03	-83.354,69	-10,76%	18,80%	-10,76%
Total Renda Variável					8.423.344,58	3,94%	5,52%	

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 (%)
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	148.964.610,87	0,00	0,00	162.559.042,51	13.594.431,64	9,13%	9,13%
TÍTULOS PÚBLICOS	126.637.248,31	0,00	27.316.392,78	107.218.916,17	7.898.060,64	6,90%	-
BRABESCO H NILO FI RENDA FIXA	74.832.438,64	7.000.000,00	0,00	89.318.122,50	7.485.683,86	9,65%	10,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.262.799,24	0,00	0,00	53.082.991,39	5.820.192,15	12,31%	12,31%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	61.557.387,85	0,00	20.975.786,10	45.833.642,89	5.252.041,14	8,53%	8,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	141.311.072,93	0,00	0,00	146.098.729,88	4.787.656,95	3,39%	3,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	109.337.733,73	5.000.000,00	108.294.548,08	3.956.814,35	3,62%	5,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	85.585.507,52	0,00	0,00	89.194.562,54	3.609.055,02	4,22%	4,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.624.945,97	0,00	32.843,53	29.002.839,35	2.410.736,91	9,06%	9,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	34.894.626,38	0,00	0,00	37.231.604,23	2.336.977,85	6,70%	6,70%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	29.304.569,11	0,00	0,00	31.023.395,26	1.718.826,15	5,87%	5,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	107.830.283,00	0,00	109.337.733,73	0,00	1.507.450,73	1,40%	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.578.289,36	0,00	0,00	15.951.517,98	1.373.228,62	9,42%	9,42%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.013.012,86	11.620.002,47	0,00	17.670.242,61	1.037.227,28	8,63%	10,23%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.539.143,55	119.366.345,36	74.056.698,80	85.837.868,07	989.077,96	1,08%	1,58%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.517.108,58	0,00	0,00	14.420.476,81	903.368,23	6,68%	6,68%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	10.519.717,24	0,00	0,00	10.996.167,71	476.450,47	4,53%	4,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.205.647,48	0,00	0,00	10.514.612,61	308.965,13	3,03%	3,03%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.735.473,09	0,00	0,00	7.033.435,95	297.962,86	4,42%	4,42%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	9.157.538,66	0,00	0,00	9.294.382,75	136.844,09	1,49%	1,49%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.673.798,61	0,00	0,00	3.751.504,95	77.706,34	2,12%	2,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	68.340,43	26.440.702,32	26.479.404,51	40.880,05	11.241,81	0,42%	1,27%



Microsoft VBScript runtime error '800a000b'

Division by zero

/plataforma/relatorios/uRetornoTriRF.asp, line 27