

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.027.054,66	5,72%	547	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.209.607,43	7,27%	368	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.942.772,92	2,81%	245	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.537.012,50	7,50%	777	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.446.605,28	4,59%	1.454	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.683.185,15	11,17%	830	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	368.636,91	0,26%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.525.262,38	8,92%	464	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.048.126,82	5,73%	819	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.622.828,82	7,57%	442	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.250.648,55	0,89%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.608.152,63	2,57%	1.248	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.204.049,08	0,86%	27	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	7.370.803,88	5,25%	213	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.864.688,02	4,89%	420	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	8.145.862,61	5,80%	775	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.534.157,10	2,52%	661	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	4.400,67	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.313.523,37	0,94%	91	0,45%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.154.607,19	0,82%	146	0,24%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	2.871.604,38	2,05%	63	3,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.735.145,62	2,66%	149	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

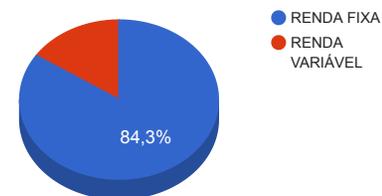
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.238.614,50	2,31%	29.990	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	159.555,72	0,11%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.174.517,09	1,55%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.006.032,41	0,72%	36	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.726.595,96	1,94%	729	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.888.589,61	1,35%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	758.020,67	0,54%		5,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	986.721,82	0,70%	7	8,35%	Desenquadrado - RV
Total			140.407.383,75				

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

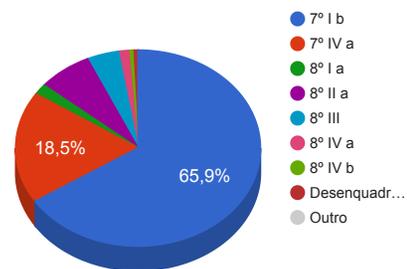
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	92.473.943,13	65,86%	0,00%	64,12%	100,00%	47.933.440,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	25.915.511,61	18,46%	0,00%	22,99%	40,00%	30.247.441,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.400,67	0,00%	0,00%	0,01%	5,00%	7.015.968,52
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.468.130,56	1,76%	0,00%	2,22%	15,00%	18.592.977,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	10.004.920,22	7,13%	0,00%	4,01%	15,00%	11.056.187,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.907.145,46	4,21%	0,00%	4,55%	10,00%	8.133.592,92
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.888.589,61	1,35%	0,00%	1,50%	5,00%	5.131.779,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	758.020,67	0,54%	0,00%	0,60%	5,00%	6.262.348,52
Desenquadrado - RV	0,00%	986.721,82	0,70%	0,00%	0,00%	0,00%	-986.721,82
Total Carteira		140.407.383,75					

RENDA FIXA	118.393.855,41	84,32%
RENDA VARIÁVEL	22.013.528,34	15,68%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	92.473.943,13	65,86%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	25.915.511,61	18,46%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.400,67	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 "	2.468.130,56	1,76%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	10.004.920,22	7,13%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.907.145,46	4,21%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.888.589,61	1,35%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	758.020,67	0,54%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	986.721,82	0,70%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	140.407.383,75	100,00%	0,00	365,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.553.523,82	44,55%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.206.383,35	40,74%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	11.105.949,50	7,91%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	3.534.157,10	2,52%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.210.081,49	1,57%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.892.990,28	1,35%	0,01%
ROMA ASSET	986.721,82	0,70%	0,29%
Elleven Gestora de Recursos	758.020,67	0,54%	0,04%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	0,78%	2,90%	2,90%	7,68%	9,19%	22,26%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	2,83%	2,83%	7,56%	8,97%	21,82%	0,20%	1,214%	3,06%
IPCA	0,75%	1,51%	1,51%	1,90%	4,58%	7,38%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,39%	3,12%	3,12%	5,99%	8,05%	18,72%	0,40%	1,888%	1,89%
IDKA IPCA 2 Anos	0,67%	2,48%	2,48%	5,97%	9,19%	22,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,66%	2,50%	2,50%	5,99%	8,71%	21,23%	0,20%	0,932%	2,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	2,49%	2,49%	6,03%	8,65%	21,14%	0,20%	0,893%	2,35%
IRF-M 1+	0,63%	2,58%	2,58%	10,76%	10,21%	25,80%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,46%	1,46%	3,49%	6,45%	16,15%	0,10%	0,106%	0,55%
IRF-M	0,59%	2,28%	2,28%	8,65%	9,14%	23,19%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	2,19%	2,19%	8,77%	8,90%	22,66%	0,20%	1,671%	3,63%
IMA-B	0,58%	5,54%	5,54%	15,99%	13,71%	25,92%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	2,54%	2,54%	6,49%	9,39%	21,05%	0,20%	0,895%	2,11%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	-0,55%	-0,55%	2,21%	2,10%	8,38%	0,20%	0,500%	4,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	5,52%	5,52%	15,95%	13,52%	25,44%	0,20%	4,050%	5,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	5,46%	5,46%	15,78%	13,40%	25,24%	0,20%	4,049%	5,94%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,47%	5,94%	5,94%	18,86%	15,60%	27,58%	0,30%	4,955%	7,06%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
120% do CDI	0,56%	1,82%	1,82%	3,70%	7,66%	18,58%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-9,43%	-22,77%	-22,77%	-38,89%	-62,62%	-79,77%	0,00%	-	-
IMA Geral ex-C	0,54%	2,92%	2,92%	8,54%	9,29%	21,13%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,94%	2,94%	8,60%	9,29%	20,53%	0,30%	1,947%	2,99%
IRF-M 1	0,47%	1,53%	1,53%	3,59%	6,68%	16,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	1,47%	1,47%	3,51%	6,50%	16,26%	0,20%	0,094%	0,54%
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	1,54%	1,54%	3,11%	6,31%	15,37%	0,20%	0,007%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	1,48%	1,48%	3,00%	6,23%	15,23%	0,20%	0,005%	0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,45%	1,46%	1,46%	2,99%	6,09%	14,86%	0,20%	0,028%	0,07%
IMA-B 5+	0,43%	7,66%	7,66%	23,23%	17,28%	29,29%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	7,52%	7,52%	22,95%	16,98%	28,38%	0,20%	6,231%	8,71%

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

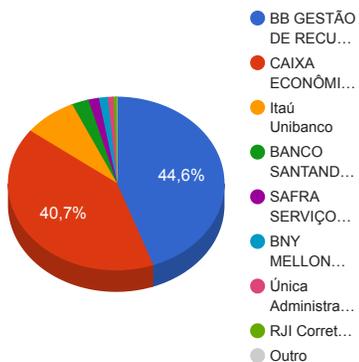
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,99%	5,58%	5,58%	16,31%	5,32%	22,14%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
S&P 500	1,79%	13,07%	13,07%	-2,73%	7,33%	19,96%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1,98%	13,43%	13,43%	-1,06%	11,34%	33,04%	1,00%	6,235%	13,94%
IPCA	0,75%	1,51%	1,51%	1,90%	4,58%	7,38%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	0,96%
IGC	0,06%	8,31%	8,31%	21,70%	13,34%	43,40%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,20%	8,21%	8,21%	22,82%	15,30%	44,84%	1,00%	12,248%	21,74%
IDIV	-1,79%	8,23%	8,23%	30,23%	13,71%	37,90%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,37%	4,72%	4,72%	21,32%	9,87%	34,19%	2,00%	12,053%	19,76%
IBX-50	-0,18%	8,38%	8,38%	18,90%	10,57%	46,05%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-0,36%	7,97%	7,97%	17,63%	8,03%	43,79%	0,70%	12,608%	22,70%
Ibovespa	-0,18%	8,56%	8,56%	20,26%	11,77%	46,83%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,14%	12,91%	12,91%	40,92%	21,13%	-	2,00%	13,024%	23,80%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,37%	1,57%	1,57%	7,03%	-	-	1,60%	0,937%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,32%	1,16%	1,16%	4,49%	5,58%	-	1,60%	0,274%	2,30%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,22%	-0,65%	-0,65%	-1,13%	-3,77%	-8,72%	4,00%	0,136%	0,80%

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

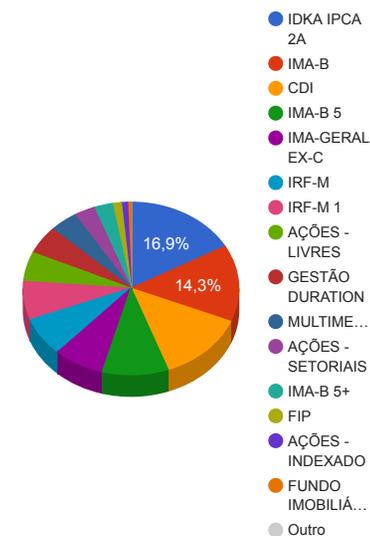
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,92%	5,69%	5,69%	28,79%	19,15%	57,15%	2,50%	13,650%	20,53%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-0,98%	4,75%	4,75%	-2,49%	-13,07%	10,74%	3,00%	6,676%	13,41%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.553.523,82	44,55%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.206.383,35	40,74%
Itaú Unibanco	11.105.949,50	7,91%
BANCO SANTANDER	3.534.157,10	2,52%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	2.210.081,49	1,57%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.888.589,61	1,35%
Única Administradora	1.146.277,54	0,82%
RJI Corretora de Valores	758.020,67	0,54%
Brasil Plural	4.400,67	0,00%



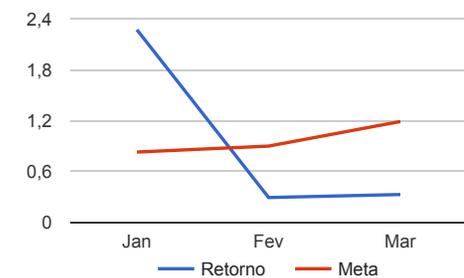
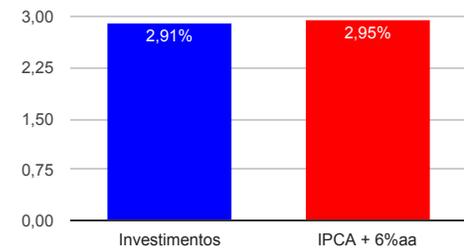
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	23.731.311,97	16,90%
IMA-B	20.136.753,15	14,34%
CDI	18.544.707,73	13,21%
IMA-B 5	13.775.910,93	9,81%
IMA-GERAL EX-C	10.622.828,82	7,57%
IRF-M	10.209.607,43	7,27%
IRF-M 1	10.054.757,91	7,16%
AÇÕES - LIVRES	7.753.027,54	5,52%
GESTÃO DURATION	7.370.803,88	5,25%
MULTIMERCADO	5.907.145,46	4,21%
AÇÕES - SETORIAIS	4.393.221,69	3,13%
IMA-B 5+	3.942.772,92	2,81%
FIP	1.888.589,61	1,35%
AÇÕES - INDEXADO	1.313.523,37	0,94%
FUNDO IMOBILIÁRIO	758.020,67	0,54%
FIDC - FECHADO	4.400,67	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	132.102.144,23	9.712.189,44	6.560.351,48	138.327.247,77	3.073.265,58	2,27%	0,83%	273,23%	1,34%
Fevereiro	138.327.247,77	6.550.453,39	6.002.000,76	139.283.275,24	407.574,84	0,29%	0,90%	32,77%	1,72%
Março	139.283.275,24	16.762.499,96	16.098.848,54	140.407.383,75	460.457,09	0,33%	1,19%	27,57%	2,65%
Acumulado no ano					3.941.297,51	2,91%	2,95%	98,68%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.431.070,80	0,00	0,00	12.525.262,38	94.191,58	0,76%	1,21%	0,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.580.076,77	0,00	0,00	15.683.185,15	103.108,38	0,66%	0,93%	0,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	366.236,46	0,00	0,00	368.636,91	2.400,45	0,66%	0,90%	0,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.996.106,34	0,00	0,00	8.048.126,82	52.020,48	0,65%	0,89%	0,65%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.243.336,20	0,00	0,00	1.250.648,55	7.312,35	0,59%	0,50%	0,59%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.478.324,37	0,00	0,00	10.537.012,50	58.688,13	0,56%	4,05%	0,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.982.471,19	0,00	0,00	8.027.054,66	44.583,47	0,56%	4,05%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.153.812,60	0,00	0,00	10.209.607,43	55.794,83	0,55%	1,67%	0,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.567.961,20	0,00	0,00	10.622.828,82	54.867,62	0,52%	1,95%	0,52%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.198.459,63	0,00	0,00	1.204.049,08	5.589,45	0,47%	4,96%	0,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.418.116,50	0,00	0,00	6.446.605,28	28.488,78	0,44%	0,09%	0,44%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.592.402,97	0,00	0,00	3.608.152,63	15.749,66	0,44%	0,11%	0,44%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.926.510,66	0,00	0,00	3.942.772,92	16.262,26	0,41%	6,23%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	7.341.994,86	0,00	0,00	7.370.803,88	28.809,02	0,39%	1,89%	0,39%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.448.457,89	538.130,71	1.152.616,47	6.864.688,02	30.715,89	0,38%	0,03%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.417.034,40	6.849.208,54	5.159.409,38	8.145.862,61	39.029,05	0,29%	0,00%	0,46%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.397.908,59	6.171.000,00	7.047.500,00	3.534.157,10	12.748,51	0,12%	0,01%	0,47%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.741.722,47	0,00	2.739.322,69	0,00	-2.399,78	-0,09%	2,76%	0,92%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 2	4.858,92	0,00	0,00	4.400,67	-458,25	-9,43%	-	-
Total Renda Fixa					647.501,88	0,54%	1,66%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	986.536,16	0,00	0,00	1.006.032,41	19.496,25	1,98%	6,24%	1,98%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.166.408,48	0,00	0,00	2.174.517,09	8.108,61	0,37%	0,94%	0,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.717.792,01	0,00	0,00	2.726.595,96	8.803,95	0,32%	0,27%	0,32%
HAZ FII - ATCR11	757.723,14	0,00	0,00	758.020,67	297,53	0,04%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.889.052,66	0,00	0,00	1.888.589,61	-463,05	-0,02%	0,00%	-0,02%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.156.961,24	0,00	0,00	1.154.607,19	-2.354,05	-0,20%	12,25%	-0,20%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	1.112.163,49	204.160,71	0,00	1.313.523,37	-2.800,83	-0,21%	12,61%	-0,36%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	159.914,56	0,00	0,00	159.555,72	-358,84	-0,22%	0,14%	-0,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.769.847,20	0,00	0,00	3.735.145,62	-34.701,58	-0,92%	13,65%	-0,92%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	996.471,22	0,00	0,00	986.721,82	-9.749,40	-0,98%	6,68%	-0,98%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3.283.542,26	0,00	0,00	3.238.614,50	-44.927,76	-1,37%	12,05%	-1,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.000.000,00	0,00	2.871.604,38	-128.395,62	-4,28%	13,02%	1,14%
Total Renda Variável					-187.044,79	-0,84%	8,18%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.018.227,19	0,00	34.122,83	10.537.012,50	552.908,14	5,52%	5,52%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.611.480,37	0,00	0,00	8.027.054,66	415.574,29	5,46%	5,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.412.314,83	0,00	114.123,89	15.683.185,15	384.994,21	2,50%	2,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.181.086,03	0,00	0,00	12.525.262,38	344.176,35	2,83%	2,83%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.319.779,81	0,00	0,00	10.622.828,82	303.049,01	2,94%	2,94%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.667.123,62	0,00	0,00	3.942.772,92	275.649,30	7,52%	7,52%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.990.991,53	0,00	0,00	10.209.607,43	218.615,90	2,19%	2,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.166.456,84	2.000.000,00	0,00	7.370.803,88	204.347,04	2,85%	3,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.852.451,97	0,00	0,00	8.048.126,82	195.674,85	2,49%	2,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.353.992,96	12.220.657,19	10.539.409,38	8.145.862,61	110.621,84	1,07%	1,48%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.477.722,85	1.645.183,80	1.355.364,39	6.864.688,02	97.145,76	1,31%	1,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.406.706,49	0,00	2.056.025,13	6.446.605,28	95.923,92	1,36%	1,47%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.136.518,08	0,00	0,00	1.204.049,08	67.531,00	5,94%	5,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.554.982,02	0,00	1.000.000,00	3.608.152,63	53.170,61	1,36%	1,46%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.257.523,69	0,00	34.141,09	1.250.648,55	27.265,95	2,18%	-0,55%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.364.952,42	12.921.000,00	10.778.500,00	3.534.157,10	26.704,68	0,34%	1,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	369.540,48	0,00	10.191,38	368.636,91	9.287,81	2,53%	2,54%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	5.697,60	0,00	0,00	4.400,67	-1.296,93	-22,76%	-22,77%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.779.845,05	0,00	2.739.322,69	0,00	-40.522,36	-1,46%	-0,46%
Total Renda Fixa					3.340.821,37	2,85%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.534.023,49	0,00	0,00	3.735.145,62	201.122,13	5,69%	5,69%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	886.946,36	0,00	0,00	1.006.032,41	119.086,05	13,43%	13,43%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.130.308,88	1.000.000,00	0,00	3.238.614,50	108.305,62	3,46%	4,72%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.067.012,12	0,00	0,00	1.154.607,19	87.595,07	8,21%	8,21%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	995.566,10	238.301,80	0,00	1.313.523,37	79.655,47	8,12%	7,97%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	942.169,75	0,00	0,00	986.721,82	44.552,07	4,73%	4,75%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.140.831,86	0,00	0,00	2.174.517,09	33.685,23	1,57%	1,57%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.695.241,12	0,00	0,00	2.726.595,96	31.354,84	1,16%	1,16%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	1.872.953,41	0,00	0,00	1.888.589,61	15.636,20	0,83%	-
HAZ FII - ATCR11	749.092,11	0,00	0,00	758.020,67	8.928,56	1,19%	0,00%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	160.605,20	0,00	0,00	159.555,72	-1.049,48	-0,65%	-0,65%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.000.000,00	0,00	2.871.604,38	-128.395,62	-4,28%	12,91%
Total Renda Variável					600.476,14	3,45%	