

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 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	8.442.619,14	5,78%	588	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.444.192,82	7,16%	385	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	4.217.194,75	2,89%	285	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.931.430,02	7,49%	488	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.082.441,72	7,59%	854	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.521.316,20	4,47%	1.439	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.019.274,50	10,97%	897	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.835.198,26	8,79%	546	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	375.961,62	0,26%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.269.310,07	0,87%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.214.041,42	5,63%	866	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.649.550,63	2,50%	1.253	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.269.673,69	0,87%	34	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.552.903,38	5,17%	238	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.146.985,14	3,53%	413	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	7.887.770,81	5,40%	762	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.538.509,06	3,79%	687	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	3.431,42	0,00%	11	1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.324.052,55	0,91%	93	0,35%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.177.652,60	0,81%	156	0,23%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	3.013.145,98	2,06%	98	2,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	5.939.436,20	4,07%	150	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2019)

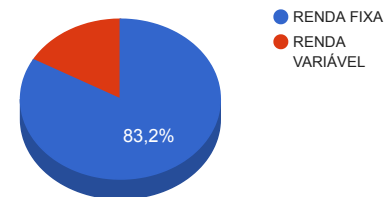
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.432.665,30	2,35%	30.639	0,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	158.282,60	0,11%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.210.528,73	1,51%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	984.016,21	0,67%	34	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.752.143,13	1,89%	729	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.888.180,00	1,29%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	757.230,96	0,52%		5,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	922.911,41	0,63%	7	8,35%	Desenquadrado - RV
Total			145.962.050,32				

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

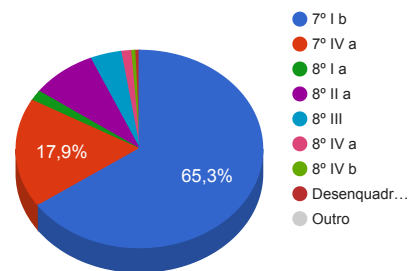
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	95.272.204,84	65,27%	0,00%	64,12%	100,00%	50.689.845,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	26.126.168,39	17,90%	0,00%	22,99%	40,00%	32.258.651,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.431,42	0,00%	0,00%	0,01%	5,00%	7.294.671,10
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.501.705,15	1,71%	0,00%	2,22%	15,00%	19.392.602,40
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	12.543.530,08	8,59%	0,00%	4,01%	15,00%	9.350.777,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.946.688,07	4,07%	0,00%	4,55%	10,00%	8.649.516,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.888.180,00	1,29%	0,00%	1,50%	5,00%	5.409.922,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	757.230,96	0,52%	0,00%	0,60%	5,00%	6.540.871,56
Desenquadrado - RV	0,00%	922.911,41	0,63%	0,00%	0,00%	0,00%	-922.911,41
Total Carteira		145.962.050,32					

RENDA FIXA	121.401.804,65	83,17%
RENDA VARIÁVEL	24.560.245,67	16,83%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	95.272.204,84	65,27%	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 "	26.126.168,39	17,90%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.431,42	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 "	2.501.705,15	1,71%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	12.543.530,08	8,59%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.946.688,07	4,07%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.888.180,00	1,29%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	757.230,96	0,52%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	922.911,41	0,63%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	145.962.050,32	100,00%	0,00	365,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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	64.177.230,53	43,97%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.770.244,86	38,89%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	13.492.339,58	9,24%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	5.538.509,06	3,79%	0,00%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.253.689,90	1,54%	0,00%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.891.611,42	1,30%	0,01%
ROMA ASSET	922.911,41	0,63%	0,20%
Elleven Gestora de Recursos	757.230,96	0,52%	0,04%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,20%	15,29%	7,55%	17,45%	32,56%	42,12%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,12%	15,00%	7,40%	17,12%	32,02%	41,20%	0,20%	3,065%	8,49%
IMA-B	3,66%	11,06%	5,83%	12,89%	23,73%	34,52%	-	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,72%	11,72%	5,94%	14,12%	26,35%	37,22%	0,30%	2,358%	6,92%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,63%	10,98%	5,77%	12,79%	23,51%	33,98%	0,20%	2,128%	5,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,63%	10,92%	5,76%	12,71%	23,36%	33,78%	0,20%	2,156%	5,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	4,58%	2,66%	5,79%	11,49%	22,33%	0,20%	0,538%	2,08%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,54%	0,94%	2,09%	1,88%	3,51%	9,20%	0,20%	0,337%	4,44%
IRF-M 1+	2,17%	5,48%	3,48%	7,51%	15,86%	28,71%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	2,62%	1,59%	3,17%	6,96%	15,46%	0,10%	0,099%	0,52%
IMA Geral ex-C	1,83%	5,68%	3,24%	6,93%	13,55%	23,86%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	5,93%	3,44%	7,17%	13,73%	24,05%	0,30%	1,099%	2,94%
IRF-M	1,77%	4,72%	2,99%	6,33%	13,33%	25,08%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,73%	4,54%	2,86%	6,08%	13,17%	24,52%	0,20%	1,018%	3,47%
IMA-B 5	1,39%	5,47%	3,31%	6,91%	13,22%	24,34%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,37%	5,37%	3,25%	6,79%	12,98%	23,85%	0,20%	0,854%	2,96%
IDKA IPCA 2 Anos	1,37%	4,95%	3,10%	6,27%	12,05%	24,00%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 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	1,06%	4,70%	2,82%	5,91%	11,05%	22,36%	0,20%	0,634%	2,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	4,60%	2,73%	5,88%	11,07%	22,22%	0,20%	0,589%	2,28%
IRF-M 1	0,68%	2,72%	1,66%	3,30%	7,19%	15,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,64%	1,61%	3,20%	7,01%	15,56%	0,20%	0,098%	0,52%
120% do CDI	0,65%	3,12%	1,85%	3,73%	7,69%	17,67%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-	-39,78%	-29,38%	-44,50%	-60,90%	-83,19%	0,00%	-	-
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	2,57%	1,55%	3,06%	6,22%	14,27%	0,20%	0,035%	0,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,54%	2,61%	1,53%	3,13%	6,36%	14,58%	0,20%	0,002%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,53%	2,54%	1,51%	3,02%	6,24%	14,47%	0,20%	0,004%	0,04%
IPCA	0,13%	2,22%	1,46%	2,37%	4,66%	7,65%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,80%	5,67%	2,87%	7,27%	10,74%	22,76%	0,40%	0,985%	1,93%

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

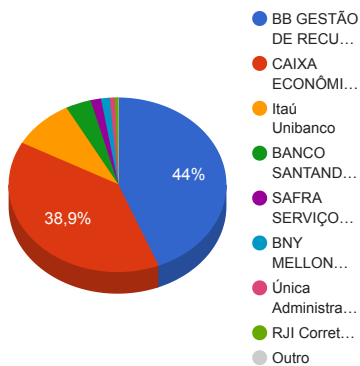
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	3,14%	15,08%	4,43%	15,83%	37,08%	54,07%	-	-	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3,14%	10,99%	4,54%	11,37%	30,80%	47,30%	2,00%	10,346%	19,20%
IFIX	1,76%	8,55%	4,85%	10,96%	15,29%	24,11%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
IGC	1,21%	10,94%	2,49%	10,28%	29,28%	48,72%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,37%	1,79%	9,41%	29,45%	49,68%	1,00%	9,331%	21,43%
Ibovespa	0,70%	10,40%	1,51%	8,41%	26,42%	54,73%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2,45%	9,72%	2,86%	13,75%	30,85%	68,35%	2,50%	9,608%	20,51%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1,80%	18,48%	6,13%	17,67%	42,05%	-	2,00%	8,754%	22,98%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1,17%	3,26%	2,04%	4,69%	-	-	1,60%	0,542%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,53%	2,11%	1,26%	2,96%	6,91%	-	1,60%	0,111%	2,10%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,23%	-1,45%	-1,02%	-1,66%	-3,63%	-8,67%	4,00%	0,128%	0,98%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-6,73%	-2,02%	-7,38%	-3,54%	-9,56%	7,17%	3,00%	4,962%	12,23%
IBX-50	0,46%	9,61%	0,96%	7,30%	24,69%	52,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,55%	8,83%	0,43%	6,43%	21,78%	50,63%	0,70%	9,473%	21,91%
IPCA	0,13%	2,22%	1,46%	2,37%	4,66%	7,65%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,060%	0,96%

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

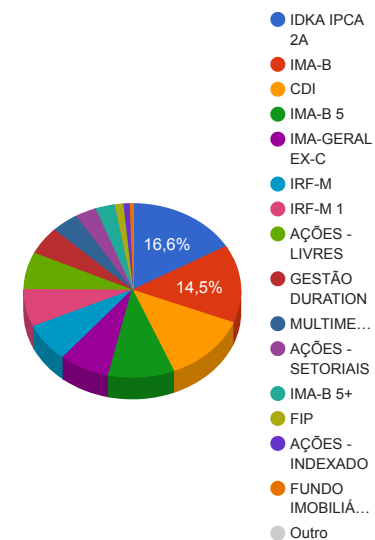
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	-6,58%	9,78%	-1,16%	-0,29%	1,03%	14,11%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-6,35%	10,94%	-0,26%	1,83%	4,77%	25,27%	1,00%	7,239%	13,69%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.177.230,53	43,97%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.770.244,86	38,89%
Itaú Unibanco	13.492.339,58	9,24%
BANCO SANTANDER	5.538.509,06	3,79%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA.	2.253.689,90	1,54%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.888.180,00	1,29%
Única Administradora	1.081.194,01	0,74%
RJI Corretora de Valores	757.230,96	0,52%
Brasil Plural	3.431,42	0,00%



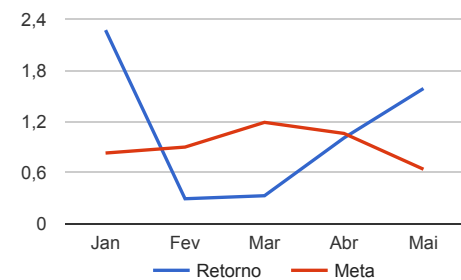
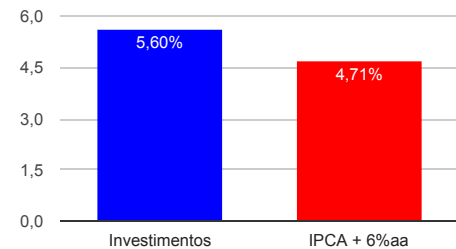
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	24.233.315,92	16,60%
IMA-B	21.170.696,17	14,50%
CDI	18.573.265,01	12,72%
IMA-B 5	14.104.508,33	9,66%
IMA-GERAL EX-C	10.931.430,02	7,49%
IRF-M	10.444.192,82	7,16%
IRF-M 1	10.170.866,83	6,97%
AÇÕES - LIVRES	10.033.776,19	6,87%
GESTÃO DURATION	7.552.903,38	5,17%
MULTIMERCADO	5.946.688,07	4,07%
AÇÕES - SETORIAIS	4.610.317,90	3,16%
IMA-B 5+	4.217.194,75	2,89%
FIP	1.888.180,00	1,29%
AÇÕES - INDEXADO	1.324.052,55	0,91%
FUNDO IMOBILIÁRIO	757.230,96	0,52%
FIDC - FECHADO	3.431,42	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%
Abril	140.407.383,75	10.222.706,00	9.585.160,51	142.465.590,30	1.420.661,06	1,01%	1,06%	95,06%	1,35%
Mai	142.465.590,30	20.275.063,12	19.058.807,97	145.962.050,32	2.280.204,87	1,59%	0,64%	247,71%	1,87%
Acumulado no ano					7.642.163,44	5,60%	4,71%	118,91%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de maio / 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	4.011.734,78	0,00	0,00	4.217.194,75	205.459,97	5,12%	3,06%	5,12%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.224.142,85	0,00	0,00	1.269.673,69	45.530,84	3,72%	2,36%	3,72%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.693.890,27	0,00	0,00	11.082.441,72	388.551,45	3,63%	2,13%	3,63%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.147.131,73	0,00	0,00	8.442.619,14	295.487,41	3,63%	2,16%	3,63%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.715.229,91	0,00	0,00	10.931.430,02	216.200,11	2,02%	1,10%	2,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.266.950,30	0,00	0,00	10.444.192,82	177.242,52	1,73%	1,02%	1,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.661.183,75	0,00	0,00	12.835.198,26	174.014,51	1,37%	0,85%	1,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.850.662,48	0,00	0,00	16.019.274,50	168.612,02	1,06%	0,63%	1,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	7.481.926,76	0,00	7.552.903,38	70.976,62	0,95%	0,98%	1,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.137.037,85	0,00	0,00	8.214.041,42	77.003,57	0,95%	0,59%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	372.488,24	0,00	0,00	375.961,62	3.473,38	0,93%	0,54%	0,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	7.419.550,99	0,00	7.473.846,58	0,00	54.295,59	0,73%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.478.933,36	0,00	0,00	6.521.316,20	42.382,84	0,65%	0,10%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.626.132,80	0,00	0,00	3.649.550,63	23.417,83	0,65%	0,10%	0,65%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.262.432,93	0,00	0,00	1.269.310,07	6.877,14	0,54%	0,34%	0,54%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.666.651,77	554.136,36	2.101.853,26	5.146.985,14	28.050,27	0,39%	0,04%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	7.815.309,12	6.712.000,00	6.685.108,13	7.887.770,81	45.569,82	0,31%	0,00%	0,53%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.792.579,78	3.527.000,00	2.798.000,00	5.538.509,06	16.929,28	0,20%	0,00%	0,54%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	3.916,79	0,00	0,00	3.431,42	-485,37	-12,39%	-	-
Total Renda Fixa					2.039.589,80	1,70%	0,95%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3.328.155,46	0,00	0,00	3.432.665,30	104.509,84	3,14%	10,35%	3,14%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.784.784,18	2.000.000,00	0,00	5.939.436,20	154.652,02	2,67%	9,61%	2,45%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.959.850,40	0,00	0,00	3.013.145,98	53.295,58	1,80%	8,75%	1,80%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.162.803,31	0,00	0,00	1.177.652,60	14.849,29	1,28%	9,33%	1,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.184.871,98	0,00	0,00	2.210.528,73	25.656,75	1,17%	0,54%	1,17%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	1.316.848,49	0,00	0,00	1.324.052,55	7.204,06	0,55%	9,47%	0,55%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.737.561,53	0,00	0,00	2.752.143,13	14.581,60	0,53%	0,11%	0,53%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.888.018,93	0,00	0,00	1.888.180,00	161,07	0,01%	0,06%	0,01%
HAZ FII - ATCR11	757.847,47	0,00	0,00	757.230,96	-616,51	-0,08%	-	0,00%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	158.641,45	0,00	0,00	158.282,60	-358,85	-0,23%	0,13%	-0,23%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.050.728,85	0,00	0,00	984.016,21	-66.712,64	-6,35%	7,24%	-6,35%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	989.518,55	0,00	0,00	922.911,41	-66.607,14	-6,73%	4,96%	-6,73%
Total Renda Variável					240.615,07	0,99%	6,55%	