

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2019)

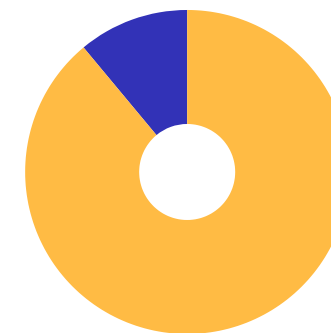
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.093.273,35	0,91%	16	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.954.388,55	2,45%	1.250	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	19.321.252,36	15,99%	1.419	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.721.228,95	2,25%	283	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	23.563.001,19	19,51%	889	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.896.616,85	2,40%	393	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.869.123,51	3,20%	920	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	18/08/2020	2.760.780,00	2,29%	19	2,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	3.829.554,00	3,17%	107	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.328.614,27	1,93%	104	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	8.822.404,40	7,30%	292	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	19.205.993,60	15,90%	821	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	173.572,11	0,14%	15.850	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	613.933,40	0,51%	15	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	40.591,10	0,03%	328	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIX...	D+61	Não há	415.273,93	0,34%	604	0,04%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	647.169,54	0,54%	29.937	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	773.457,96	0,64%	224	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	956.467,84	0,79%	285	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.035.976,53	0,86%	4.967	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	5.237.561,91	4,34%	1.627	1,59%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	3.100.269,06	2,57%	232	0,54%	Artigo 8º, Inciso III
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	Término...	Não há	25.754,39	0,02%	750	0,16%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			120.797.221,83				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			774,03				Artigo 6º
PL Total			120.797.995,86				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2019)

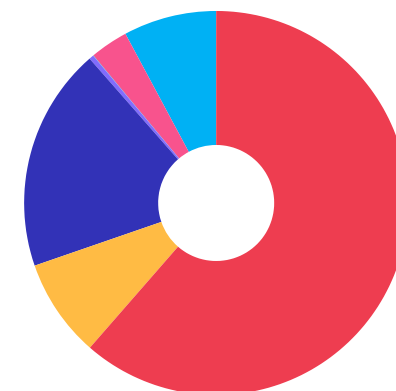
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	65.337.833,03	54,09%	15,00%	25,00%	70,00%	19.220.222,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	8.822.404,40	7,30%	5,00%	10,00%	60,00%	63.655.928,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	20.034.090,21	16,58%	10,00%	30,00%	40,00%	28.284.798,52
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	18.119.583,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.039.861,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	415.273,93	0,34%	0,00%	0,00%	5,00%	5.624.587,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.039.861,09
Desenquadrado - RF	0,00%	25.754,39	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-25.754,39
Total Renda Fixa	100,00%	94.635.355,96	78,34%	30,00%	70,00%	200,00%	



RENDA FIXA 94.635.355,96
RENDA VARIÁVEL 11.750.902,84

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	3.413.071,87	2,83%	7,00%	10,00%	20,00%	20.746.372,50
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.337.830,97	6,90%	7,00%	10,00%	10,00%	3.741.891,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.039.861,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.039.861,09
Total Renda Variável	30,00%	11.750.902,84	9,73%	18,00%	30,00%	40,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	104.131.414,06	86,20	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.054.657,61	5,01	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.823.301,18	4,82	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	1.707.206,75	1,41	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.603.637,38	1,33	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	1.451.250,46	1,20	0,00
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	25.754,39	0,02	0,10

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	65.337.833,03	54,09	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	8.822.404,40	7,30	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	20.034.090,21	16,58	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	415.273,93	0,34	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	3.413.071,87	2,83	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	8.337.830,97	6,90	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	2,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	1,82%	6,65%	4,37%	6,65%	15,16%	27,69%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,90%	6,62%	4,44%	6,62%	14,87%	26,97%	1,10%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,23%	6,25%	3,68%	6,25%	13,24%	24,54%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	5,98%	3,39%	5,98%	12,17%	23,08%	0,95%	0,02%
IMA-B 5+ (Benchmark)	5,06%	21,12%	12,50%	21,12%	40,78%	49,39%	-	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	3,44%	15,71%	9,14%	15,71%	-	-	2,13%	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,17%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,23%	1,74%	3,23%	7,09%	15,23%	0,15%	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	3,19%	1,70%	3,19%	6,98%	15,08%	0,15%	0,00%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,60%	3,21%	1,75%	3,21%	7,51%	15,84%	0,20%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,70%	7,17%	4,20%	7,17%	14,47%	25,32%	1,34%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,68%	14,95%	8,98%	14,95%	28,36%	38,56%	2,30%	0,08%

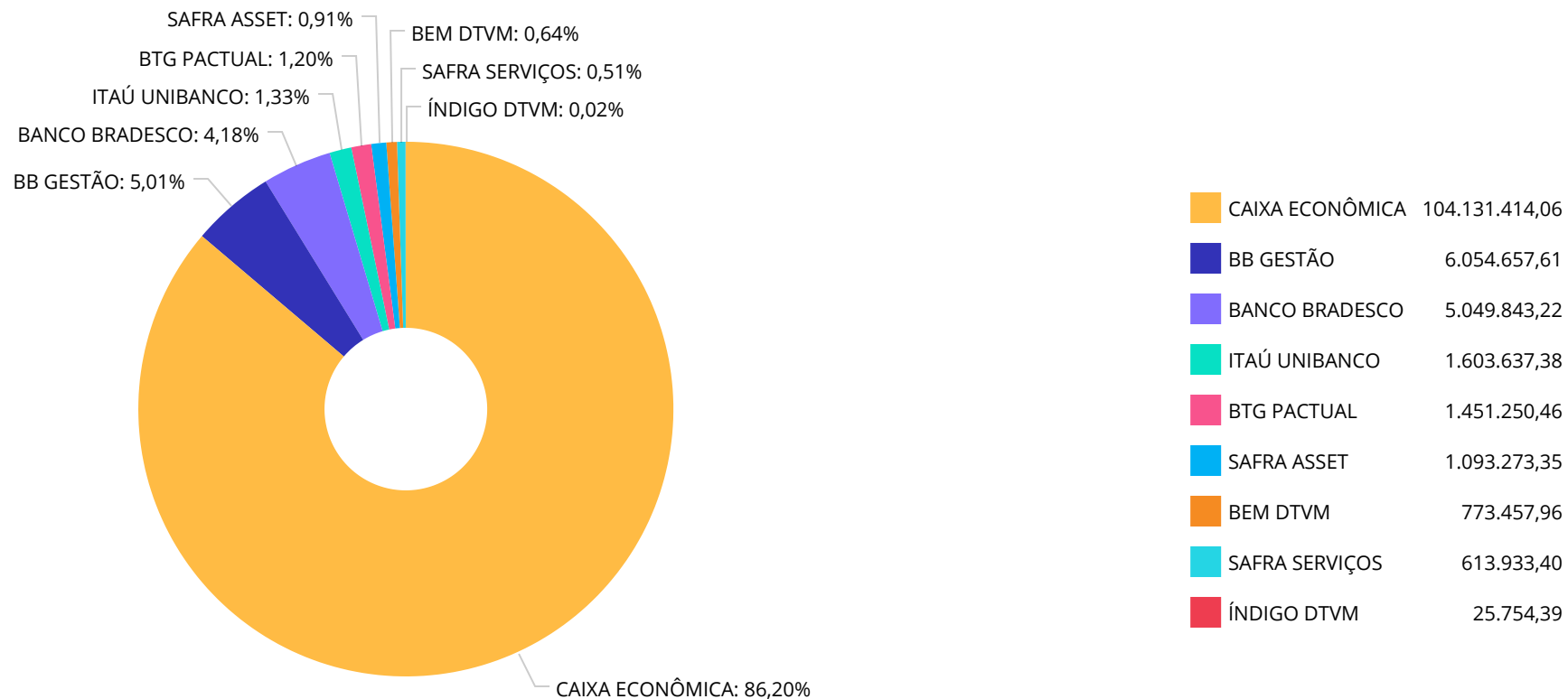
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	1,56%	2,12%	1,56%	4,04%	9,25%	0,46%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	2,16%	6,98%	4,59%	6,98%	15,72%	26,07%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,15%	6,78%	4,49%	6,78%	15,56%	25,51%	1,20%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,45%	3,01%	1,50%	3,01%	6,17%	13,82%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,41%	2,65%	1,33%	2,65%	5,44%	12,28%	0,00%	0,00%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	0,51%	3,45%	1,69%	3,45%	7,15%	-	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	2,34%	2,66%	2,34%	4,15%	8,18%	0,14%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,09%	0,58%	0,29%	0,58%	1,18%	3,39%	0,00%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,44%	-13,31%	-15,76%	-13,31%	22,78%	41,58%	0,16%	0,30%

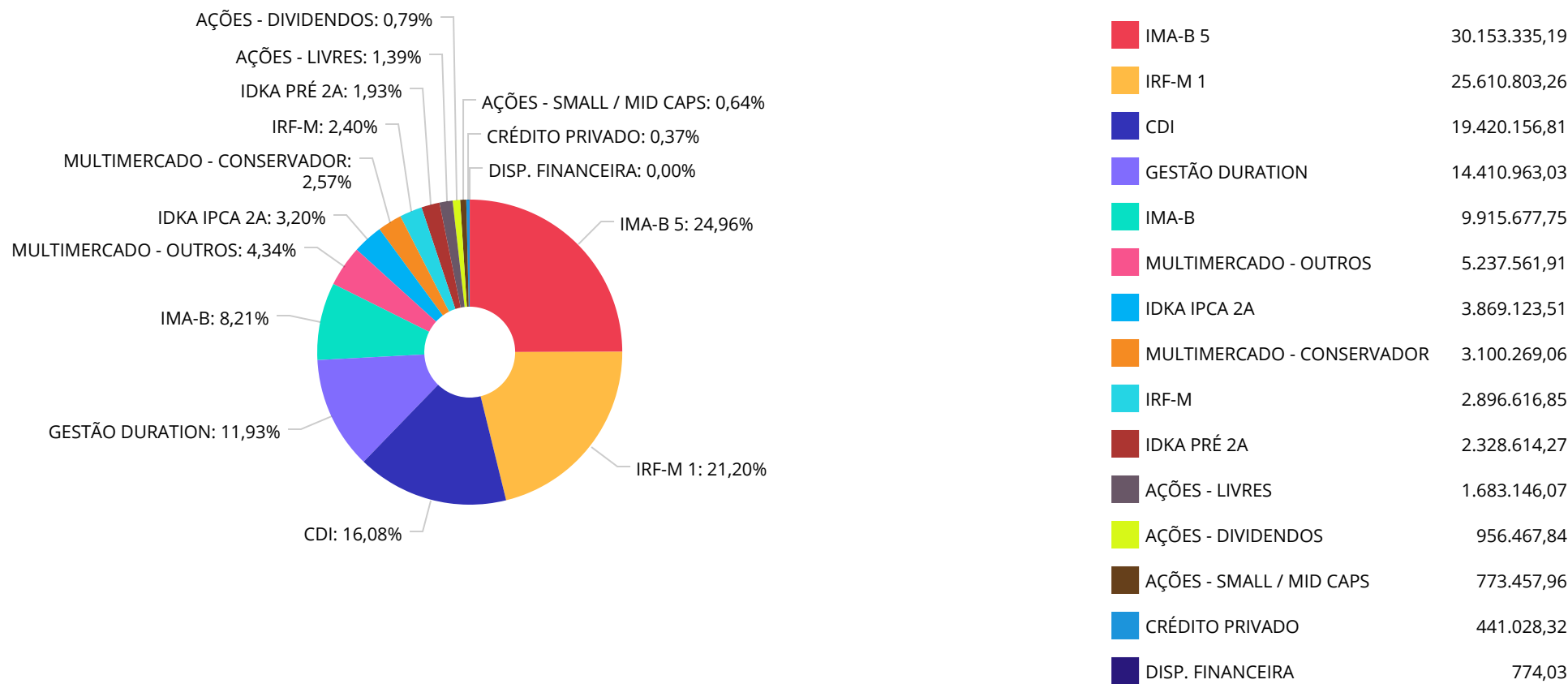
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,38%	16,41%	9,80%	16,41%	47,41%	66,77%	6,47%	0,19%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,85%	17,29%	12,65%	17,29%	45,85%	66,10%	7,05%	0,16%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,22%	18,16%	10,36%	18,16%	42,83%	74,12%	7,36%	0,16%
CDI (Benchmark)	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,69%	4,17%	2,27%	4,17%	7,98%	17,52%	0,28%	0,01%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,60%	3,32%	1,97%	3,32%	6,39%	13,70%	0,27%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	4,84%	14,79%	8,68%	14,79%	43,82%	73,59%	6,79%	0,14%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Junho / 2019)



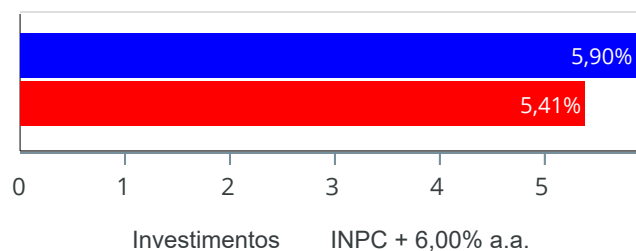
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2019)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2019

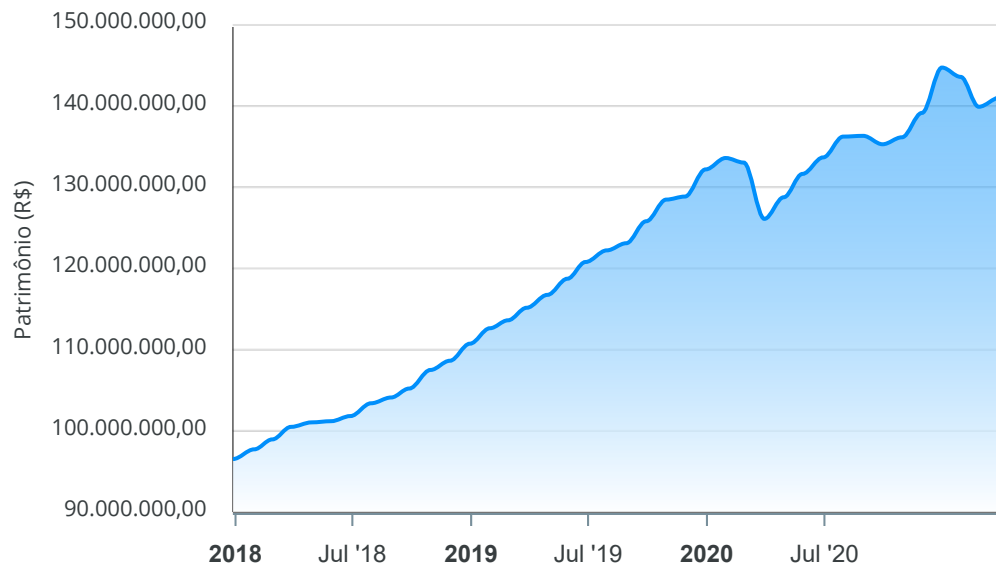
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	110.734.540,81	1.365.682,41	869.282,00	112.637.388,86	1.406.447,64	1.406.447,64	1,26%	1,26%	0,87%	0,87%	145,03%	0,52%
Fevereiro	112.637.388,86	23.094.027,89	22.432.297,42	113.615.393,79	316.274,46	1.722.722,10	0,28%	1,55%	1,01%	1,89%	82,00%	1,10%
Março	113.615.393,79	1.767.610,64	798.463,47	115.161.383,65	576.842,69	2.299.564,79	0,50%	2,06%	1,21%	3,12%	65,90%	1,29%
Abril	115.161.383,65	7.354.009,59	6.760.836,44	116.748.582,37	994.025,57	3.293.590,36	0,86%	2,93%	1,09%	4,25%	69,10%	0,66%
Mai	116.748.582,37	1.927.167,77	1.560.456,03	118.738.464,26	1.623.170,15	4.916.760,51	1,39%	4,36%	0,66%	4,94%	88,36%	0,87%
Junho	118.738.464,26	3.244.902,33	2.939.081,76	120.797.221,83	1.752.937,00	6.669.697,51	1,47%	5,90%	0,45%	5,41%	109,06%	0,99%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



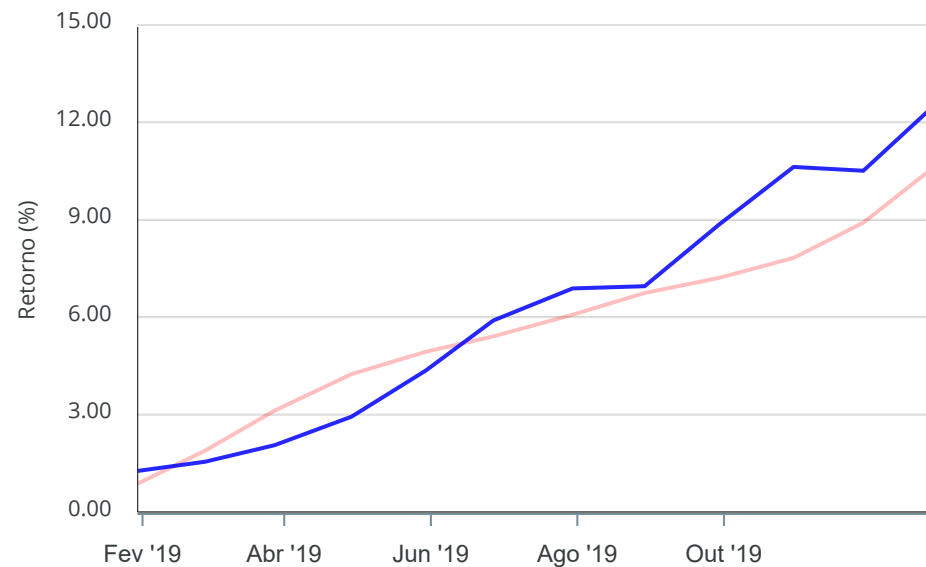
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	8.509.076,30	0,00	0,00	8.822.404,40	313.328,10	3,68%	3,68%	2,30%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	1.056.873,50	0,00	0,00	1.093.273,35	36.399,85	3,44%	3,44%	2,13%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.027.343,06	0,00	0,00	14.410.963,03	383.619,97	2,73%	2,73%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.835.743,99	0,00	0,00	2.896.616,85	60.872,86	2,15%	2,15%	1,20%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.285.102,74	0,00	0,00	2.328.614,27	43.511,53	1,90%	1,90%	1,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.468.382,49	1.383.801,64	678.466,12	23.563.001,19	389.283,18	1,63%	1,70%	1,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.822.530,16	0,00	0,00	3.869.123,51	46.593,35	1,22%	1,22%	0,95%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.806.190,00	0,00	0,00	3.829.554,00	23.364,00	0,61%	0,61%	0,46%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	610.291,31	0,00	0,00	613.933,40	3.642,09	0,60%	0,60%	0,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.937.570,38	0,00	0,00	2.954.388,55	16.818,17	0,57%	0,57%	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	20.075.102,94	0,00	868.600,00	19.321.252,36	114.749,42	0,57%	0,57%	0,15%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.706.055,58	0,00	0,00	2.721.228,95	15.173,37	0,56%	0,56%	0,15%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIXA ...	413.185,67	0,00	0,00	415.273,93	2.088,26	0,51%	0,51%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	19.119.174,58	0,00	0,00	19.205.993,60	86.819,02	0,45%	0,45%	0,00%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	25.640,65	0,00	0,00	25.754,39	113,74	0,44%	0,44%	0,16%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.748.610,00	0,00	0,00	2.760.780,00	12.170,00	0,44%	0,44%	0,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	44.994,55	72.916,31	77.355,61	40.591,10	35,85	0,03%	0,41%	0,00%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00	300.000,00	300.072,10	0,00	72,10	0,02%	0,46%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.188.112,28	1.014.587,93	173.572,11	47,76	0,00%	0,09%	0,00%
Total Renda Fixa	107.491.867,90	2.944.830,23	2.939.081,76	109.046.318,99	1.548.702,62	1,44%		0,86%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	988.090,55	0,00	0,00	1.035.976,53	47.885,98	4,85%	4,85%	7,05%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	737.737,70	0,00	0,00	773.457,96	35.720,26	4,84%	4,84%	6,79%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	319.161,07	300.072,10	0,00	647.169,54	27.936,37	4,51%	7,22%	7,36%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	916.355,23	0,00	0,00	956.467,84	40.112,61	4,38%	4,38%	6,47%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.079.146,87	0,00	0,00	3.100.269,06	21.122,19	0,69%	0,69%	0,28%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	5.206.104,94	0,00	0,00	5.237.561,91	31.456,97	0,60%	0,60%	0,27%
Total Renda Variável	11.246.596,36	300.072,10	0,00	11.750.902,84	204.234,38	1,77%		2,20%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.379.293,19	2.770.153,83	3.549.720,38	23.563.001,19	963.274,55	3,68%	4,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	11.021.907,19	2.500.000,00	0,00	14.410.963,03	889.055,84	6,57%	6,70%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	8.095.225,36	0,00	0,00	8.822.404,40	727.179,04	8,98%	8,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.864.459,42	0,00	5.909.561,00	19.321.252,36	366.353,94	1,47%	1,74%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.921.401,26	0,00	0,00	19.205.993,60	284.592,34	1,50%	1,50%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.772.050,79	0,00	0,00	2.896.616,85	124.566,06	4,49%	4,49%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.229.628,16	0,00	0,00	2.328.614,27	98.986,11	4,44%	4,44%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	1.001.732,97	0,00	0,00	1.093.273,35	91.540,38	9,14%	9,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	3.784.966,05	0,00	3.869.123,51	84.157,46	2,22%	3,39%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.750.231,00	0,00	0,00	3.829.554,00	79.323,00	2,12%	2,12%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.689.276,00	0,00	0,00	2.760.780,00	71.504,00	2,66%	2,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.904.248,59	0,00	0,00	2.954.388,55	50.139,96	1,73%	1,73%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.675.632,91	0,00	0,00	2.721.228,95	45.596,04	1,70%	1,70%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	603.403,90	0,00	0,00	613.933,40	10.529,50	1,75%	1,75%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIXA ...	408.354,52	0,00	0,00	415.273,93	6.919,41	1,69%	1,69%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	297.045,23	0,00	299.645,75	0,00	2.600,52	0,88%	1,47%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	45.611,88	181.581,62	186.787,07	40.591,10	184,67	0,08%	1,33%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00	300.000,00	300.072,10	0,00	72,10	0,02%	1,50%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.188.112,28	1.014.587,93	173.572,11	47,76	0,00%	0,29%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	30.572,31	0,00	0,00	25.754,39	-4.817,92	-15,76%	-15,76%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Fixa	3.891.804,76	3,34%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	919.676,33	0,00	0,00	1.035.976,53	116.300,20	12,65%	12,65%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	4.240.416,53	900.000,00	0,00	5.237.561,91	97.145,38	1,89%	1,97%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	871.134,21	0,00	0,00	956.467,84	85.333,63	9,80%	9,80%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.030.083,96	1.548,06	0,00	3.100.269,06	68.637,04	2,26%	2,26%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	409.997,94	299.645,75	0,00	773.457,96	63.814,27	8,99%	8,68%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	600.072,10	0,00	647.169,54	47.097,44	7,85%	10,36%
				Total Renda Variável	478.327,96	4,24%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.602.091,59	2.500.000,00	0,00	14.410.963,03	1.308.871,44	9,99%	10,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	25.903.784,30	3.569.742,82	23.563.001,19	1.228.959,71	4,74%	7,17%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	7.674.814,29	0,00	0,00	8.822.404,40	1.147.590,11	14,95%	14,95%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	46.971.874,70	1.320.679,07	29.862.061,00	19.321.252,36	890.759,59	1,84%	3,23%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.644.404,16	0,00	0,00	19.205.993,60	561.589,44	3,01%	3,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.712.693,52	0,00	0,00	2.896.616,85	183.923,33	6,78%	6,78%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.183.940,94	0,00	0,00	2.328.614,27	144.673,33	6,62%	6,62%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.093.273,35	93.273,35	9,33%	15,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.862.469,60	0,00	0,00	2.954.388,55	91.918,95	3,21%	3,21%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.637.063,22	0,00	0,00	2.721.228,95	84.165,73	3,19%	3,19%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	3.784.966,05	0,00	3.869.123,51	84.157,46	2,22%	5,98%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.697.650,00	0,00	0,00	2.760.780,00	63.130,00	2,34%	2,34%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.770.847,00	0,00	0,00	3.829.554,00	58.707,00	1,56%	1,56%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,00	600.000,00	0,00	613.933,40	13.933,40	2,32%	3,21%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIXA ...	401.441,21	0,00	0,00	415.273,93	13.832,72	3,45%	3,45%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	292.813,08	0,00	299.645,75	0,00	6.832,67	2,33%	2,94%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,26	354.593,02	314.307,52	40.591,10	304,34	0,09%	2,65%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00	300.000,00	300.072,10	0,00	72,10	0,02%	3,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.188.112,28	1.014.587,93	173.572,11	47,76	0,00%	0,58%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	29.707,49	0,00	0,00	25.754,39	-3.953,10	-13,31%	-13,31%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Fixa	5.972.789,33	5,79%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	883.256,03	0,00	0,00	1.035.976,53	152.720,50	17,29%	17,29%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	4.184.845,20	900.000,00	0,00	5.237.561,91	152.716,71	3,00%	3,32%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	821.650,15	0,00	0,00	956.467,84	134.817,69	16,41%	16,41%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.974.811,50	1.548,06	0,00	3.100.269,06	123.909,50	4,16%	4,16%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	388.165,87	299.645,75	0,00	773.457,96	85.646,34	12,45%	14,79%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	600.072,10	0,00	647.169,54	47.097,44	7,85%	18,16%
				Total Renda Variável	696.908,18	6,30%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.