

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.



[Handwritten signatures and initials in blue ink]

prodebran
cl ll

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	37.870.837,32	30,50%	889	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.709.742,30	3,79%	1.250	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.728.550,38	10,25%	1.419	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.851.087,68	1,49%	119	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.122.638,87	11,37%	283	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.141.654,88	2,53%	245	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BARCELONA FI RENDA FIXA	D+1 ou D+1261	90 dias	2.593.823,79	2,09%	10	5,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	5.370.291,13	4,33%	744	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	887.758,20	0,71%	45	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ILLUMINATI FIDC	D+1 ou D+1260	30 dias	5.701.230,17	4,59%	11	2,47%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.769.498,87	3,84%	33	2,27%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.290,75	0,00%	41	0,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.999,18	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+60	Não há	2.941.420,09	2,37%	37	2,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.644.240,00	1,32%	76	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.120.472,58	1,71%	2.407	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+2	1280 dias	291.090,14	0,23%	13	8,00%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	3.610.290,55	2,91%	14	1,76%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.208.463,96	1,78%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	3.345.762,06	2,69%	955	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	758.151,26	0,61%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

Handwritten signatures and initials in blue ink.

Azêdo Soares

Cl. Cl.

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
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.452.091,89	1,17%	33	0,54%	Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " a "
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	482.115,82	0,39%			Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	937.201,57	0,75%		6,31%	Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " b "
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	Não se aplica	Não se aplica	1.653.528,25	1,33%		4,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " b "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	1.963.225,46	1,58%		1,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " b "
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	D+31 ou D+91	1800 dias	6.606.665,80	5,32%	8	11,96%	Desenquadrado - RF
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	397.575,34	0,32%	7	3,64%	Desenquadrado - RV
	Total para cálculo dos limites da Resolução		124.165.698,29				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			8.518,67				Artigo 6º
		Total	124.174.216,96				



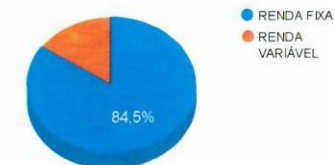

 Aryde Schen
 01.11.

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

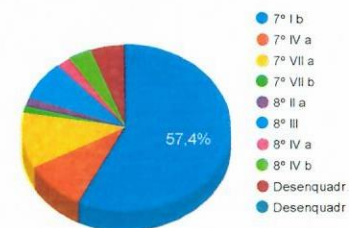
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	71.282.856,55	57,41%	15,00%	25,00%	70,00%	15.633.132,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	74.499.418,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.993.528,00	9,66%	10,00%	30,00%	40,00%	37.672.751,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	13.418.439,06	10,81%	2,00%	5,00%	5,00%	-7.210.154,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.644.240,00	1,32%	0,00%	0,00%	5,00%	4.564.044,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.120.472,58	1,71%	7,00%	10,00%	20,00%	22.712.667,08
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.455.606,71	7,62%	7,00%	10,00%	10,00%	2.960.963,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.692.358,97	2,17%	2,00%	5,00%	5,00%	3.515.925,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.553.955,28	3,67%	2,00%	5,00%	5,00%	1.654.329,63
Desenquadrado - RF	0,00%	6.606.665,80	5,32%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.606.665,80
Desenquadrado - RV	0,00%	397.575,34	0,32%	0,00%	0,00%	0,00%	-397.575,34
Total Carteira		124.165.698,29					

RENTA FIXA	104.954.248,08	84,53%
RENTA VARIÁVEL	19.219.968,88	15,48%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



[Handwritten signatures and notes]

Azede Sören

Dist. e f.

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	71.282.856,55	57,41%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.993.528,00	9,66%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	13.418.439,06	10,51%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.644.240,00	1,32%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.120.472,58	1,71%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.455.606,71	7,62%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.692.358,97	2,17%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.553.955,28	3,67%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	6.606.665,80	5,32%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RV	397.575,34	0,32%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	124.165.698,29	100,00%	50,00	240,00


Azedo
Chel




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	Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.797.853,72	46,55%	0,01%	AURORA CAPITAL	291.090,14	0,23%	-%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	16.243.111,45	13,08%	0,00%	VILA RICA CAPITAL	4.999,18	0,00%	0,39%%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.931.121,11	9,61%	0,00%	BRASIL PLURAL	1.290,75	0,00%	0,00%%
ROMA ASSET	8.657.769,39	6,97%	2,04%				
Queluz Gestão de Recursos	5.701.230,17	4,59%	-				
SUPERNOVA CAPITAL	4.769.498,87	3,84%	-				
ITAÚ UNIBANCO	4.029.413,08	3,25%	0,00%				
RJI Gestão & Investimentos	3.610.290,55	2,91%	-				
SUL BRASIL ASSET	2.941.420,09	2,37%	0,51%				
Veritas Capital Management	2.593.823,79	2,09%	0,21%				
ZION Invest	1.963.225,46	1,58%	0,40%				
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	1.452.091,89	1,17%	6,75%				
Elleven Gestora de Recursos	937.201,57	0,75%	0,05%				
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	758.151,26	0,61%	3,52%				
RJI Corretora de Valores	482.115,82	0,39%	-				

Handwritten signatures and notes in blue ink:
 - A large signature: "Alderson"
 - A signature: "cl. il."
 - Several other illegible signatures and initials.

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	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%	0,20%	1,343%	2,98%
CDI + 3,50% ao ano	0,73%	4,82%	2,40%	4,82%	10,00%	22,17%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	18,14%	57,70%	40,40%	57,70%	75,65%	87,93%	0,20%	-	15,45%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	36,00%	439,78%	107,02%	439,78%	49,49%	82,81%	0,39%	-	-
IPCA + 8,50% ao ano	0,63%	6,38%	2,75%	6,38%	12,04%	26,78%	-	-	-
ILLUMINATI FIDC	1,61%	-8,63%	2,03%	-8,63%	-6,38%	1,87%	1,50%	-	-
130% do CDI	0,61%	4,01%	2,00%	4,01%	8,29%	18,75%	-	-	-
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,61%	4,01%	2,00%	4,01%	8,29%	18,78%	0,18%	0,000%	0,16%
IRF-M 1	0,58%	3,32%	1,77%	3,32%	7,23%	15,60%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,23%	1,74%	3,23%	7,09%	15,23%	0,20%	0,148%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	3,21%	1,73%	3,21%	7,04%	15,12%	0,10%	0,171%	0,49%
BRANDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	3,19%	1,70%	3,19%	6,98%	15,08%	0,20%	0,148%	0,47%
IPCA + 7,00% ao ano	0,52%	5,66%	2,40%	5,66%	10,51%	23,34%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,29%	-6,64%	1,66%	-6,64%	-0,24%	-22,04%	1,65%	-	-
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,99%	5,81%	3,82%	5,81%	-	-	0,50%	1,490%	-

gyp
Azede Solen
dt. 11

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


	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	3,01%	1,50%	3,01%	6,19%	14,07%	0,20%	0,003%	0,11%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	-12,16%	-13,95%	-12,75%	-13,95%	-10,73%	-	0,80%	19,883%	12,77%
Selic	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,15%	-	-	-
BARCELONA FI RENDA FIXA	0,36%	-	-	-	-	13,21%	0,00%	0,120%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	5,18%	2,17%	5,18%	9,49%	21,07%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	4,36%	2,12%	4,36%	9,53%	20,32%	0,15%	0,460%	1,54%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,78%	9,90%	6,44%	9,90%	16,31%	23,14%	0,20%	2,042%	3,04%
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 definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



 Alexandre
 Diretor

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
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1,00%	4,28%	2,67%	4,28%	-	-	1,60%	0,604%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,48%	2,61%	1,43%	2,61%	7,71%	-	1,60%	0,168%	1,88%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-1,18%	3,18%	-7,57%	-3,18%	-8,40%	3,28%	3,00%	4,553%	10,42%
IDIV	3,11%	18,67%	9,64%	18,67%	47,74%	60,82%	-	-	-
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,81%	12,27%	4,92%	12,27%	39,61%	60,09%	1,50%	7,488%	14,57%
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano	0,59%	6,14%	2,64%	6,14%	11,53%	25,63%	-	-	-
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-54,67%	-86,58%	-74,62%	-86,58%	-86,35%	-	0,15%	156,037%	71,16%
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,45%	5,18%	2,17%	5,18%	9,49%	21,07%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-4,40%	-8,05%	-4,91%	-8,05%	-	-8,86%	1,50%	5,269%	-
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	0,95%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	20,13%	4,07%	20,95%	4,07%	-26,94%	1,13%	1,60%	47,871%	32,55%


 André Schen
 Alt. e L.

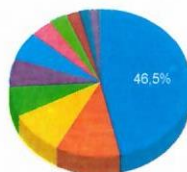
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SÃO DOMINGOS FII - FID11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	1,50%	0,000%	0,00%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	-	-

Handwritten signatures and notes in blue ink.
 Azide Schoen
 D. L. L.

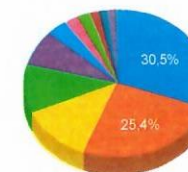
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.797.853,72	46,55%
BANCO BRADESCO	14.122.638,87	11,37%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.931.121,11	9,61%
Foco DTVM	8.260.194,05	6,65%
Planner Corretora	7.664.455,63	6,17%
RJI Corretora de Valores	7.623.431,73	6,14%
CM Capital Markets DTVM	5.060.589,01	4,08%
Itaú Unibanco	4.029.413,08	3,25%
Socopa	2.941.420,09	2,37%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.210.243,15	1,78%
BEM DTVM	2.120.472,58	1,71%
Única Administradora	397.575,34	0,32%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	8.518,67	0,01%
BRL Trust Investimentos	4.999,18	0,00%
Genial Investimentos	1.290,75	0,00%



CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
BANCO BRADESCO
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
Foco DTVM
Planner Corretora
RJI Corretora de Valores
CM Capital Markets DTVM
Itaú Unibanco
Socopa
BNY MELLON
BEM DTVM
Única Administradora
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA
BRL Trust Investimentos
Genial Investimentos

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	37.870.837,32	30,50%
IRF-M 1	31.580.931,55	25,42%
CDI	15.458.538,92	12,45%
FIDC - ABERTO	13.412.149,13	10,80%
MULTIMERCADO	9.455.606,71	7,62%
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.553.955,28	3,67%
GESTÃO DURATION	3.141.654,88	2,53%
FIP	2.692.358,97	2,17%
AÇÕES - SETORIAIS	2.120.472,58	1,71%
IDKA IPCA 3A	1.851.087,68	1,49%
CRÉDITO PRIVADO	1.644.240,00	1,32%
AÇÕES - LIVRES	397.575,34	0,32%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	8.518,67	0,01%
FIDC - FECHADO	6.289,93	0,01%

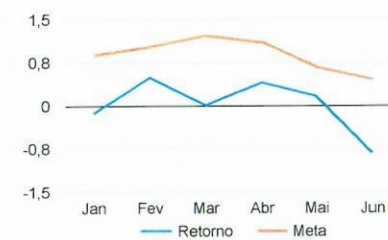


IMA-B 5
IRF-M 1
CDI
FIDC - ABERTO
MULTIMERCADO
FUNDO IMOBILIÁRIO
GESTÃO DURATION
FIP
AÇÕES - SETORIAIS
IDKA IPCA 3A
CRÉDITO PRIVADO
AÇÕES - LIVRES
Outro

Handwritten signatures and notes:
Azêck Schuen
Alt. II.

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Acumulado no Ano



[Handwritten signatures and notes in blue ink]

Azede Scheen
Alt. 4 h

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(%)
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.955,46	0,00	295,58	4.999,18	339,30	6,85%	-	-
BARCELONA FI RENDA FIXA	2.429.607,61	0,00	0,00	2.593.823,79	164.216,18	6,76%	0,12%	0,36%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.599.762,00	0,00	0,00	1.644.240,00	44.478,00	2,78%	2,04%	2,78%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.063.609,56	0,00	0,00	3.141.654,88	78.045,32	2,55%	1,49%	2,55%
ILLUMINATI FIDC	5.610.642,10	0,00	0,00	5.701.230,17	90.588,07	1,61%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	430.643,45	448.205,69	0,00	887.758,20	8.909,06	1,01%	1,49%	1,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.574.165,64	25.000.000,00	0,00	37.870.837,32	296.671,68	0,79%	1,34%	1,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.839.775,52	0,00	0,00	1.851.087,68	11.312,16	0,61%	0,46%	0,61%
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.923.589,84	0,00	0,00	2.941.420,09	17.830,25	0,61%	0,00%	0,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.682.931,59	0,00	0,00	4.709.742,30	26.810,71	0,57%	0,17%	0,57%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.043.892,07	0,00	0,00	14.122.638,87	78.746,80	0,56%	0,15%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	37.341.426,35	1.517.000,00	26.330.000,00	12.728.550,38	200.124,03	0,52%	0,15%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.345.840,69	0,00	0,00	5.370.291,13	24.450,44	0,46%	0,00%	0,46%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.755.874,33	0,00	0,00	4.769.498,87	13.624,54	0,29%	-	-
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	7.521.157,09	0,00	0,00	6.606.665,80	-914.491,29	-12,16%	19,88%	-12,16%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.576,84	0,00	0,00	1.290,75	-286,09	-18,14%	-	-
Total Renda Fixa					141.369,16	0,13%	2,09%	

Handwritten signatures and notes:
 Azule Solen
 Ch. U. L.

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(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	1.634.193,26	0,00	0,00	1.963.225,46	329.032,20	20,13%	47,87%	20,13%
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	642.116,35	0,00	448.105,69	291.090,14	97.079,48	15,12%	156,04%	-54,67%
BRABESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.042.660,43	0,00	0,00	2.120.472,58	77.812,15	3,81%	7,49%	3,81%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.312.757,08	0,00	0,00	3.345.762,06	33.004,98	1,00%	0,60%	1,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.197.817,15	0,00	0,00	2.208.463,96	10.646,81	0,48%	0,17%	0,48%
HAZ FII - ATCR11	936.845,84	0,00	0,00	937.201,57	355,73	0,04%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.452.446,15	0,00	0,00	1.452.091,89	-354,26	-0,02%	0,00%	-0,02%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	761.234,63	0,00	0,00	758.151,26	-3.083,37	-0,41%	-	-
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	485.006,80	0,00	0,00	482.115,82	-2.890,98	-0,60%	-	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	402.331,06	0,00	0,00	397.575,34	-4.755,72	-1,18%	4,55%	-1,18%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.144.315,81	0,00	0,00	3.610.290,55	-534.025,26	-12,89%	5,27%	-4,40%
SÃO DOMINGOS FII - FID11	2.854.155,07	0,00	0,00	1.653.528,25	-1.200.626,82	-42,07%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					-1.197.805,06	-5,74%	10,47%	

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

Azede S. Silva
Alt. I. L.

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.730.062,32	3.082.962,54	35.756.000,00	12.728.550,38	671.525,52	1,66%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.119.343,85	34.248.000,00	0,00	37.870.837,32	503.493,47	2,50%	4,20%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.886.004,44	0,00	0,00	14.122.638,87	236.634,43	1,70%	1,70%
BARCELONA FI RENDA FIXA	2.429.607,61	0,00	0,00	2.593.823,79	164.216,18	6,76%	-
ILLUMINATI FIDC	5.587.721,34	0,00	0,00	5.701.230,17	113.508,83	2,03%	2,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	3.034.820,01	0,00	3.141.654,88	106.834,87	3,52%	5,08%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.544.719,00	0,00	0,00	1.644.240,00	99.521,00	6,44%	6,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.290.840,76	0,00	0,00	5.370.291,13	79.450,37	1,50%	1,50%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.691.706,44	0,00	0,00	4.769.498,87	77.792,43	1,66%	1,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.799.697,27	1.832.697,44	0,00	4.709.742,30	77.347,59	1,67%	1,73%
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.883.635,26	0,00	0,00	2.941.420,09	57.784,83	2,00%	2,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.989.746,33	0,00	3.031.542,52	0,00	41.796,19	1,40%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.812.672,51	0,00	0,00	1.851.087,68	38.415,17	2,12%	2,12%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	876.206,67	0,00	887.758,20	11.551,53	1,64%	3,82%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.531,90	0,00	1.696,07	4.999,18	5.163,35	346,09%	107,02%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.165,65	0,00	0,00	1.290,75	-874,90	-40,40%	-40,40%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	7.572.056,88	0,00	0,00	6.606.665,80	-965.391,08	-12,75%	-12,75%
Total Renda Fixa					1.318.769,78	1,28%	

Handwritten signatures and notes:
 Azêdo Schen
 Alt. L.L.

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	1.623.196,51	0,00	0,00	1.963.225,46	340.028,95	20,95%	20,95%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.020.953,74	0,00	0,00	2.120.472,58	99.518,84	4,92%	4,92%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.258.789,07	0,00	0,00	3.345.762,06	86.972,99	2,67%	2,67%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.177.415,58	0,00	0,00	2.208.463,96	31.048,38	1,43%	1,43%
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.147.061,94	0,00	876.206,67	291.090,14	20.234,87	7,41%	-74,62%
HAZ FII - ATCR11	937.059,94	0,00	0,00	937.201,57	141,63	0,02%	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.452.761,24	0,00	0,00	1.452.091,89	-669,35	-0,05%	-
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	487.731,12	0,00	0,00	482.115,82	-5.615,30	-1,15%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	430.148,36	0,00	0,00	397.575,34	-32.573,02	-7,57%	-7,57%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.262.188,37	0,00	0,00	758.151,26	-504.037,11	-39,93%	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.144.315,81	0,00	0,00	3.610.290,55	-534.025,26	-12,89%	-4,91%
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	2.860.928,42	0,00	0,00	1.653.528,25	-1.207.400,17	-42,20%	0,00%
Total Renda Variável					-1.706.374,55	-7,94%	

Handwritten signatures and notes:
 Azede Schuen
 Cl. H. f.

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.906.713,81	35.985.294,17	67.305.160,50	12.728.550,38	1.141.702,90	2,98%	3,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	44.248.000,00	7.000.000,00	37.870.837,32	622.837,32	3,72%	7,17%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.432.593,12	2.250.000,00	2.000.000,00	14.122.638,87	440.045,75	3,11%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	20.311.406,29	0,00	311.406,29	1,56%	15,08%
BARCELONA FI RENDA FIXA	2.429.607,61	0,00	0,00	2.593.823,79	164.216,18	6,76%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	5.213.517,49	0,00	0,00	5.370.291,13	156.773,64	3,01%	3,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.669.149,98	1.884.491,00	3.000.000,00	4.709.742,30	156.101,32	3,07%	3,21%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.496.064,00	0,00	0,00	1.644.240,00	148.176,00	9,90%	9,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	3.409.486,83	0,00	3.533.579,87	0,00	124.093,04	3,64%	14,99%
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.827.890,45	0,00	0,00	2.941.420,09	113.529,64	4,01%	4,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	3.034.820,01	0,00	3.141.654,88	106.834,87	3,52%	8,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.823.598,89	0,00	50.497,31	1.851.087,68	77.986,10	4,35%	4,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	3.000.000,00	3.031.542,52	0,00	31.542,52	1,05%	-
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	876.206,67	0,00	887.758,20	11.551,53	1,64%	5,81%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	587,52	0,00	3.639,09	4.999,18	8.050,75	2.582,54%	439,78%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.051,22	0,00	0,00	1.290,75	-1.760,47	-57,70%	-57,70%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	5.108.448,73	0,00	0,00	4.769.498,87	-338.949,86	-6,64%	-6,64%
ILLUMINATI FIDC	6.239.821,75	0,00	0,00	5.701.230,17	-538.591,58	-8,63%	-8,63%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	7.677.536,15	0,00	0,00	6.606.665,80	-1.070.870,35	-13,95%	-13,95%
Total Renda Fixa					1.664.675,59	1,62%	

Azilda Schenck
cel: 22.

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.672.770,99	0,00	1.829.537,90	0,00	156.766,91	9,37%	17,48%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.208.307,48	0,00	0,00	3.345.762,06	137.454,58	4,28%	4,28%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.120.472,58	120.472,58	6,02%	12,27%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	932.761,09	0,00	1.027.452,70	0,00	94.691,61	10,15%	14,51%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	1.886.451,28	0,00	0,00	1.963.225,46	76.774,18	4,07%	4,07%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.152.376,12	0,00	0,00	2.208.463,96	56.087,84	2,61%	2,61%
HAZ FII - ATCR11	926.022,53	0,00	0,00	937.201,57	11.179,04	1,21%	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.441.184,80	0,00	0,00	1.452.091,89	10.907,09	0,76%	-
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	491.835,21	0,00	0,00	482.115,82	-9.719,39	-1,98%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	410.726,47	0,00	0,00	397.575,34	-13.151,13	-3,20%	-3,18%
HORUS VETOR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.168.572,38	0,00	1.856.437,88	291.090,14	-21.044,36	5,17%	-86,58%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.262.188,37	0,00	0,00	758.151,26	-504.037,11	-39,93%	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.144.315,81	0,00	0,00	3.610.290,55	-534.025,26	-12,89%	-8,05%
SÃO DOMINGOS FII - FID11	2.878.489,22	0,00	0,00	1.653.528,25	-1.224.960,97	-42,56%	0,00%
Total Renda Variável					-1.642.604,39	-7,74%	

[Handwritten signatures and initials in blue ink]

Azide Schen
Cláudio