

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	67.525.401,25	16,11%	600	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	12.809.107,93	3,06%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	30.370.595,85	7,25%	597	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	35.352.440,67	8,44%	877	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	72.600.162,69	17,33%	937	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.199.336,67	0,76%	1.391	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	19.333.780,63	4,61%	95	9,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	23.897.244,16	5,70%	126	3,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.362.658,06	0,56%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA ...	D+4	Não há	2.348.559,29	0,56%	5	14,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	6.328.045,45	1,51%	33	7,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	7.695.266,81	1,84%	31	1,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	15.449.369,43	3,69%	258	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.707.021,12	0,65%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	6.888.231,92	1,64%	8	18,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	318.699,37	0,08%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	4.819.391,40	1,15%	141	4,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.454.074,96	0,35%	150	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.017.201,20	1,91%	692	4,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.085.060,52	1,69%	1.952	3,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

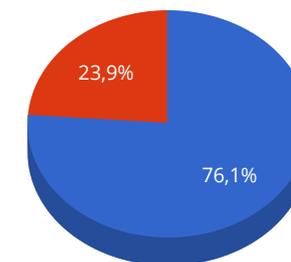
Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.085.060,52	1,69%	1.952	3,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	5.999.628,76	1,43%	135	3,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.017.201,20	1,91%	692	4,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	8.946.772,12	2,14%	5.376	3,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	9.130.766,83	2,18%	69	3,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.186.894,59	1,72%	77	4,89%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	3.443.801,62	0,82%	12	6,49%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	2.391.226,75	0,57%	30	3,82%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	11.030.963,96	2,63%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	8.167.146,50	1,95%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	5.129.031,54	1,22%		3,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.502.411,80	0,36%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.785.883,70	1,86%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.975.495,41	0,95%	10	6,12%	Desenquadrado - RF
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.873.309,36	1,40%	9	19,54%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			419.036.368,83				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	221.857.045,06	52,94%	15,00%	30,00%	70,00%	71.468.413,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	70,00%	293.325.458,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	251.421.821,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	251.421.821,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	77.414.923,83	18,47%	10,00%	30,00%	40,00%	90.199.623,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	167.614.547,53
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	4.190.363,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	9.913.952,41	2,37%	2,00%	5,00%	5,00%	11.037.866,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.951.818,44
Desenquadrado - RF	0,00%	9.848.804,77	2,35%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.848.804,77
Total Renda Fixa	100,00%	319.034.726,07	76,14%	27,00%	70,00%	351,00%	

Distribuição por Segmento

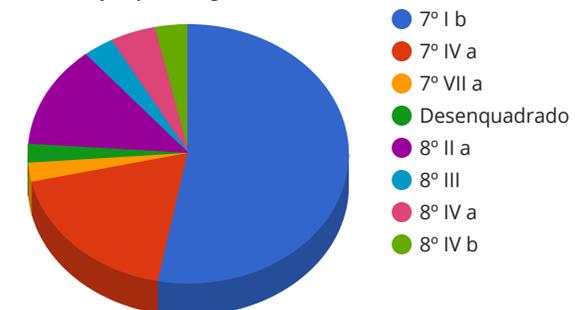


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	53.364.282,30	12,74%	0,00%	10,00%	20,00%	30.442.991,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.021.922,96	3,11%	5,00%	10,00%	10,00%	28.881.713,92
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	19.198.110,46	4,58%	2,00%	5,00%	5,00%	1.753.707,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.417.327,04	3,44%	2,00%	5,00%	5,00%	6.534.491,40
Total Renda Variável	30,00%	100.001.642,76	23,86%	9,00%	30,00%	40,00%	

Distribuição por Artigos



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	143.324.900,61	34,20	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	78.532.144,45	18,74	0,01
INFINITY ASSET MANAGEMENT	32.848.720,67	7,84	4,66
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	23.897.244,16	5,70	0,00
ITAÚ UNIBANCO	19.294.671,14	4,60	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	18.077.538,95	4,31	2,65
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	17.381.136,74	4,15	20,25
A5 CAPITAL PARTNERS	11.030.963,96	2,63	-
MULTINVEST CAPITAL	8.221.868,65	1,96	4,91
KINEA INVESTIMENTOS	8.167.146,50	1,95	0,00
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	8.017.201,20	1,91	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	7.695.266,81	1,84	0,05
PERFIN INVESTIMENTOS	7.085.060,52	1,69	0,13
META ASSET MANAGEMENT	5.999.628,76	1,43	2,63
NAVI CAPITAL	5.621.794,12	1,34	0,33
ZION INVEST	5.129.031,54	1,22	1,05
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	4.819.391,40	1,15	1,09
AURORA CAPITAL	3.975.495,41	0,95	5,54
CAPITÂNIA	3.443.801,62	0,82	0,04
RJI CORRETORA DE VALORES	2.362.658,06	0,56	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.289.592,39	0,55	0,01
CREDIT SUISSE HEDGING-GRIFFO C...	1.502.411,80	0,36	-
TRX	318.699,37	0,08	0,31

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 "	221.857.045,06	52,94	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	77.414.923,83	18,47	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	9.913.952,41	2,37	2,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	53.364.282,30	12,74	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	13.021.922,96	3,11	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	19.198.110,46	4,58	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.417.327,04	3,44	2,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,90%	7,09%	2,31%	6,04%	11,41%	25,64%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-5,82%	7,04%	-2,89%	-0,85%	5,10%	17,79%	-	0,01%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-4,33%	6,80%	-2,85%	-0,05%	4,88%	14,89%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-4,25%	6,95%	-2,75%	-0,10%	5,03%	15,14%	0,01%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,81%	6,52%	2,07%	5,55%	10,39%	23,35%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,86%	2,57%	1,32%	-0,03%	1,68%	686,52%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,72%	5,94%	1,83%	5,07%	9,36%	21,07%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-5,19%	10,44%	-3,18%	0,06%	7,78%	19,59%	0,01%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	1,51%	22,95%	12,19%	15,32%	38,55%	44,87%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-2,73%	5,59%	-2,07%	-0,06%	3,40%	11,80%	0,00%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,72%	4,06%	1,99%	3,46%	7,29%	15,22%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,85%	3,95%	-2,05%	-0,52%	2,91%	9,81%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-2,86%	2,25%	-0,53%	0,44%	2,00%	-17,99%	0,05%	0,05%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-4,69%	8,20%	-3,01%	-0,03%	6,02%	16,50%	0,01%	0,03%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,27%	7,85%	-2,81%	-0,39%	4,75%	9,17%	0,01%	0,05%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,33%	11,84%	-2,81%	-1,03%	10,75%	7,71%	0,02%	0,06%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-1,26%	2,64%	-0,88%	0,37%	1,10%	-10,45%	0,01%	0,05%
IMA-B (Benchmark)	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	-4,37%	8,28%	-3,74%	0,90%	4,57%	18,29%	0,01%	0,07%
CDI (Benchmark)	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	-2,35%	4,02%	-1,54%	-0,26%	2,77%	10,12%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-2,59%	9,39%	-1,92%	-0,32%	6,49%	15,79%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-4,46%	12,15%	-3,11%	0,13%	8,47%	18,94%	0,01%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-3,72%	8,71%	-2,49%	-0,10%	6,18%	16,44%	0,01%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-	-2,61%	-	0,63%	-4,22%	-38,28%	0,07%	0,12%

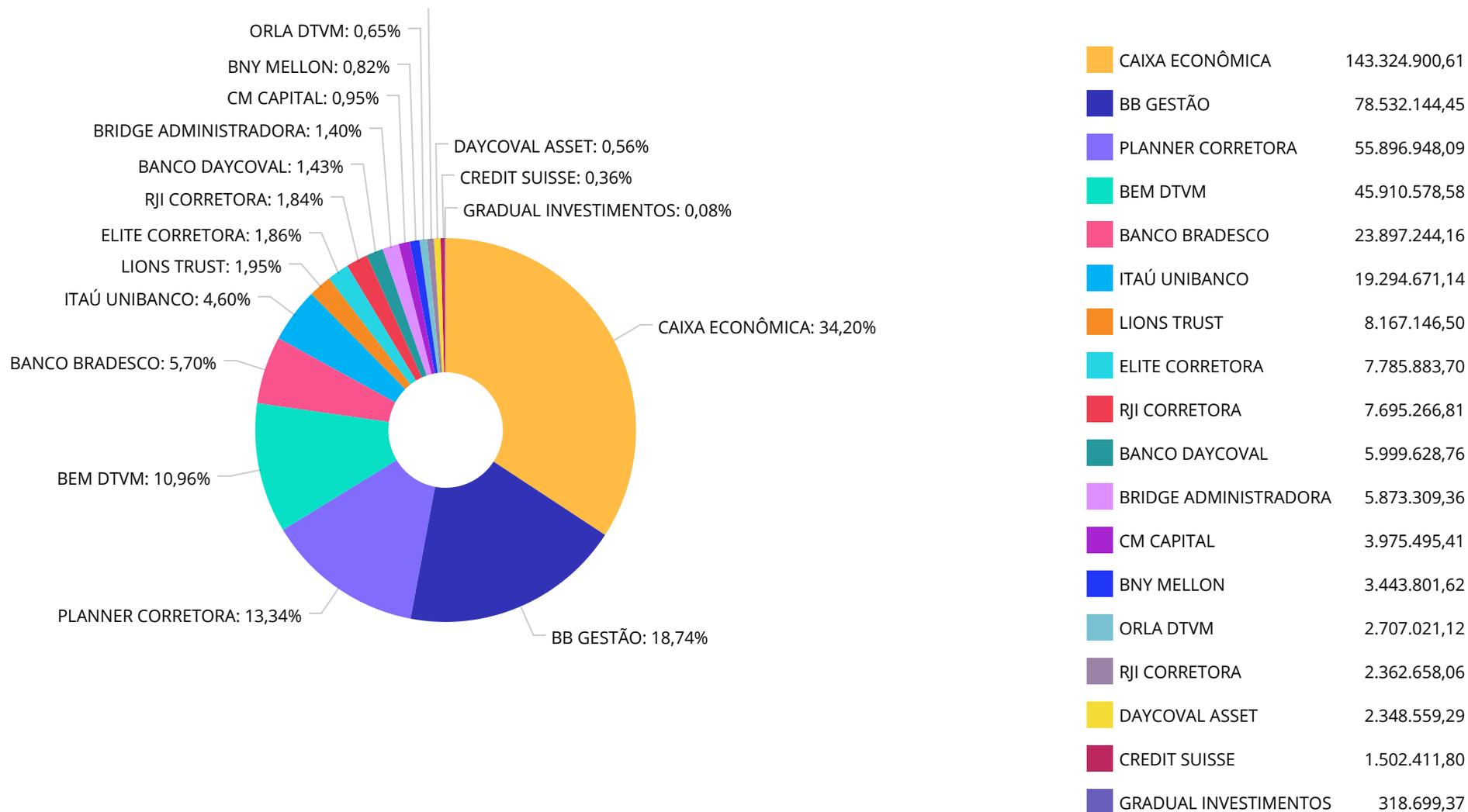
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	2,76%	21,95%	9,29%	8,41%	41,54%	57,67%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-14,89%	21,13%	-7,90%	-0,98%	7,98%	20,12%	0,05%	0,17%
IBX (Benchmark)	1,17%	16,94%	6,52%	5,62%	30,86%	55,67%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-17,77%	13,69%	-5,01%	2,69%	5,84%	21,61%	0,07%	0,19%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-12,36%	19,18%	-5,66%	-0,06%	9,52%	26,31%	0,06%	0,16%
Ibovespa (Benchmark)	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-17,21%	18,88%	-8,14%	0,73%	10,81%	26,44%	0,04%	0,14%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-14,47%	14,19%	-4,51%	-1,06%	8,89%	24,10%	0,07%	0,16%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	-13,30%	16,32%	-6,50%	0,37%	6,22%	23,93%	0,06%	0,16%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-18,99%	24,34%	-7,61%	-0,97%	12,85%	40,19%	0,06%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-14,88%	20,77%	-4,82%	-1,55%	13,22%	38,65%	0,06%	0,17%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-13,22%	19,82%	-7,55%	-2,46%	8,34%	38,79%	0,07%	0,18%
CDI (Benchmark)	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	-2,23%	4,12%	-1,49%	-0,23%	2,89%	9,98%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	-2,90%	4,39%	-2,10%	-0,40%	3,24%	10,54%	0,00%	0,01%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	13,39%	-14,56%	12,73%	0,06%	-14,18%	-16,57%	0,00%	0,11%

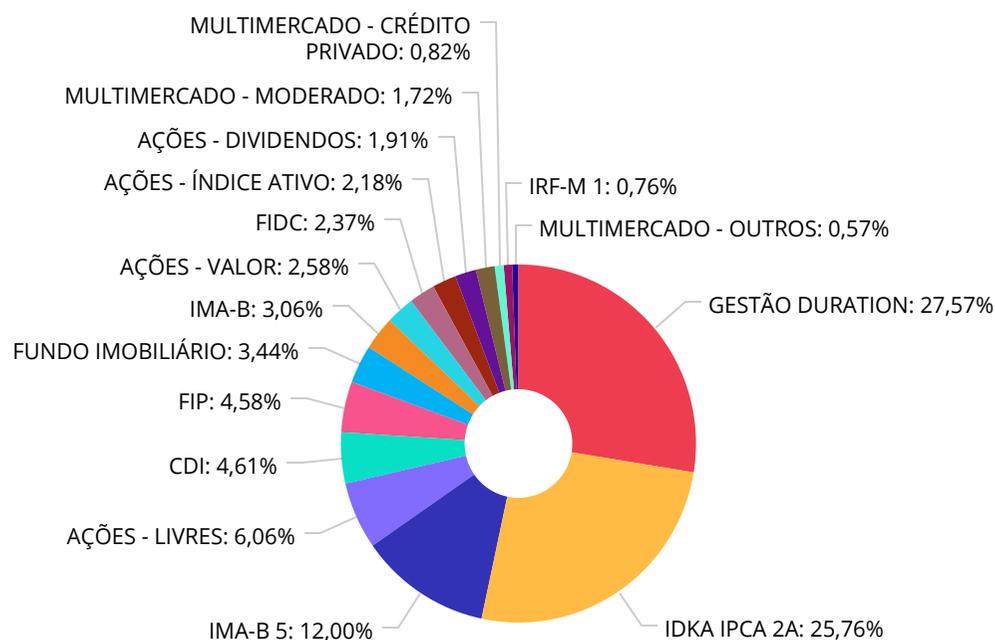
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-13,24%	5,42%	-12,58%	-1,60%	0,37%	-89,41%	0,03%	0,09%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	38,26%	-7,56%	51,43%	1,92%	-6,47%	-22,44%	0,28%	0,29%

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



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

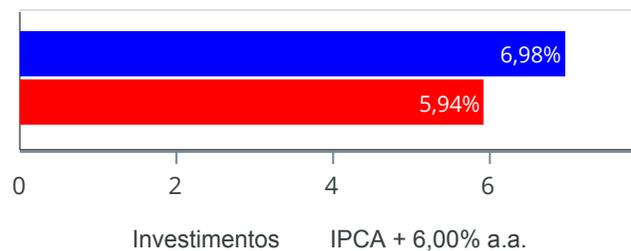


GESTÃO DURATION	115.548.619,58
IDKA IPCA 2A	107.952.603,36
IMA-B 5	50.277.325,49
AÇÕES - LIVRES	25.397.294,11
CDI	19.333.780,63
FIP	19.198.110,46
FUNDO IMOBILIÁRIO	14.417.327,04
IMA-B	12.809.107,93
AÇÕES - VALOR	10.819.020,16
FIDC	9.913.952,41
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	9.130.766,83
AÇÕES - DIVIDENDOS	8.017.201,20
MULTIMERCADO - MODERADO	7.186.894,59
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	3.443.801,62
IRF-M 1	3.199.336,67
MULTIMERCADO - OUTROS	2.391.226,75

Retorno e Meta Atuarial 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	394.885.791,79	2.862.951,32	3.442.592,75	402.622.721,45	8.316.571,09	8.316.571,09	2,11%	2,11%	0,83%	0,83%	253,25%	1,60%
Fevereiro	402.622.721,45	32.519.057,91	32.897.340,00	401.061.889,24	-1.182.550,12	7.134.020,97	-0,29%	1,81%	0,90%	1,73%	104,13%	1,78%
Março	401.061.889,24	3.430.027,19	3.831.892,53	400.900.304,33	240.280,43	7.374.301,40	0,06%	1,87%	1,19%	2,95%	63,32%	2,97%
Abril	400.900.304,33	2.939.896,70	3.433.930,33	403.689.398,36	3.283.127,66	10.657.429,06	0,82%	2,70%	1,06%	4,04%	66,87%	1,69%
Mai	403.689.398,36	3.306.171,05	3.785.408,14	408.234.310,95	5.024.149,68	15.681.578,74	1,24%	3,98%	0,64%	4,71%	84,56%	4,37%
Junho	408.234.310,95	51.053.947,27	51.538.947,70	416.049.080,21	8.299.769,69	23.981.348,43	2,03%	6,09%	0,45%	5,18%	117,69%	2,71%
Julho	416.049.080,21	3.053.998,06	3.534.445,60	419.036.368,83	3.467.736,16	27.449.084,59	0,83%	6,98%	0,72%	5,94%	117,48%	1,83%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5

IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+

Ibovespa IBX SMLL IDIV

Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5

IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+

Ibovespa IBX SMLL IDIV

ANO 36M

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	311.317,46	0,00	0,00	318.699,37	7.381,91	2,37%	2,37%	7,03%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.897.020,62	0,00	0,00	3.975.495,41	78.474,79	2,01%	2,01%	2,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	66.536.585,56	251.263,87	0,00	67.525.401,25	737.551,82	1,10%	1,11%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	12.672.147,36	0,00	0,00	12.809.107,93	136.960,57	1,08%	1,08%	1,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	35.008.593,31	0,00	0,00	35.352.440,67	343.847,36	0,98%	0,98%	0,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	30.151.279,92	0,00	71.888,45	30.370.595,85	291.204,38	0,97%	0,97%	0,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	15.304.386,76	0,00	0,00	15.449.369,43	144.982,67	0,95%	0,95%	0,57%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	23.678.043,39	0,00	0,00	23.897.244,16	219.200,77	0,93%	0,93%	0,65%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	72.359.915,93	2.765.637,06	3.207.468,94	72.600.162,69	682.078,64	0,91%	0,92%	0,58%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	6.837.747,57	0,00	0,00	6.888.231,92	50.484,35	0,74%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.418.497,23	0,00	243.108,21	3.199.336,67	23.947,65	0,70%	0,70%	0,12%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.288.255,54	0,00	0,00	6.328.045,45	39.789,91	0,63%	0,63%	0,26%
INFINITY LÔTUS FI RENDA FIXA LP	19.221.573,14	0,00	0,00	19.333.780,63	112.207,49	0,58%	0,58%	0,14%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FI...	2.335.979,31	0,00	0,00	2.348.559,29	12.579,98	0,54%	0,54%	1,17%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.843.268,26	0,00	0,00	5.873.309,36	30.041,10	0,51%	0,51%	0,89%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.696.176,36	0,00	0,00	2.707.021,12	10.844,76	0,40%	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.357.438,84	0,00	0,00	2.362.658,06	5.219,22	0,22%	0,22%	0,52%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.682.115,41	0,00	0,00	7.695.266,81	13.151,40	0,17%	3,31%	4,98%
Total Renda Fixa	316.600.341,97	3.016.900,93	3.522.465,60	319.034.726,07	2.939.948,77	0,92%		0,83%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8.509.099,96	0,00	0,00	8.946.772,12	437.672,16	5,14%	5,14%	5,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.385.540,04	0,00	0,00	1.454.074,96	68.534,92	4,95%	4,95%	6,18%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.204.994,58	0,00	0,00	2.289.592,39	84.597,81	3,84%	3,84%	6,99%
META VALOR FI AÇÕES	5.795.121,36	0,00	0,00	5.999.628,76	204.507,40	3,53%	3,53%	6,99%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.497.724,68	0,00	0,00	5.621.794,12	124.069,44	2,26%	2,26%	6,58%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4.734.282,30	0,00	0,00	4.819.391,40	85.109,10	1,80%	1,80%	5,73%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.010.903,50	0,00	0,00	7.085.060,52	74.157,02	1,06%	1,06%	3,83%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	9.064.440,68	0,00	0,00	9.130.766,83	66.326,15	0,73%	0,73%	5,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	2.337.718,59	37.097,13	0,00	2.391.226,75	16.411,03	0,69%	0,70%	0,16%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.145.789,51	0,00	0,00	7.186.894,59	41.105,08	0,58%	0,58%	0,15%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.974.046,52	0,00	0,00	8.017.201,20	43.154,68	0,54%	0,54%	5,49%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.791.259,82	0,00	0,00	7.785.883,70	-5.376,12	-0,07%	-0,07%	0,00%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	8.173.104,32	0,00	0,00	8.167.146,50	-5.957,82	-0,07%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	11.050.925,68	0,00	0,00	11.030.963,96	-19.961,72	-0,18%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.454.653,16	0,00	0,00	3.443.801,62	-10.851,54	-0,31%	-0,31%	0,41%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.544.940,80	0,00	11.980,00	1.502.411,80	-30.549,00	-1,98%	-2,71%	3,49%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	5.774.192,74	0,00	0,00	5.129.031,54	-645.161,20	-11,17%	-11,17%	28,03%
Total Renda Variável	99.448.738,24	37.097,13	11.980,00	100.001.642,76	527.787,39	0,53%		5,68%