Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2019

LEMA
ECONOMIA & FINANÇAS

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	40.733.187,15	18,45%	488	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.966.994,24	2,70%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.052.092,88	9,53%	1.439	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.537.460,00	1,15%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.643.653,05	3,01%	285	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	15.702.593,12	7,11%	1.253	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	107.366,89	0,05%	866	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	7.348.157,88	3,33%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	26.699.829,13	12,09%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.658.633,94	10,26%	102	1,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	504,69	0,00%	344	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.247.298,89	1,02%	105	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	24.977.749,17	11,31%	513	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	567.309,05	0,26%	762	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.323.976,94	1,05%	93	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.578,97	0,00%	329	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.870.169,45	0,85%	722	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	2.303.382,36	1,04%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.600.267,11	0,72%	3.849	0,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.992.052,27	3,62%	5.171	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.780.280,75	2,62%	220	0,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.061.407,60	1,39%	759	4,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.036.601,83	0,47%	5.225	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.632.797,77	3,00%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	2.861.367,97	1,30%	981	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.536.669,29	0,70%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5 du	Não há	1.996.644,04	0,90%	108	0,77%	Artigo 9º - A, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.584.037,30	2,08%	2.720	8,27%	Artigo 9º - A, Inciso III
		Total para cálculo dos limites da Resolução	**220.824.063,73**				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.433.882,16				Artigo 6º
		Total	**226.257.945,89**				

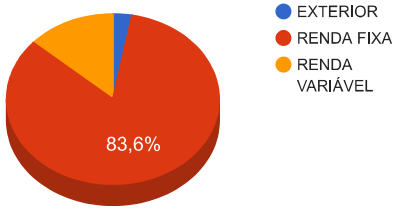
LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

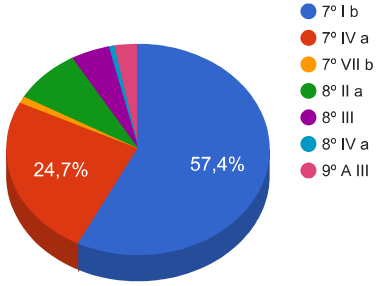
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	126.791.334,34	57,42%	40,00%	55,00%	100,00%	94.032.729,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	54.647.221,10	24,75%	0,00%	20,00%	40,00%	33.682.404,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.303.382,36	1,04%	0,00%	5,00%	5,00%	8.737.820,83
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	66.247.219,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	18.434.007,73	8,35%	0,00%	7,00%	20,00%	25.730.805,02
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.530.767,57	4,77%	0,00%	5,00%	10,00%	11.551.638,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.536.669,29	0,70%	0,00%	0,00%	5,00%	9.504.533,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	11.041.203,19
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	6.580.681,34	2,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.580.681,34
Total Carteira		220.824.063,73					

EXTERIOR	6.580.681,34	2,98%
RENDA FIXA	189.175.819,96	85,67%
RENDA VARIÁVEL	30.501.444,59	13,81%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	126.791.334,34	57,42%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
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 "	54.647.221,10	24,75%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	2.303.382,36	1,04%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	18.434.007,73	8,35%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	10.530.767,57	4,77%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.536.669,29	0,70%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	220.824.063,73	100,00%	40,00	690,00

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 9º - A, Inciso III	6.580.681,34	2,98%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	220.824.063,73	100,00%	40,00	690,00

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	135.185.313,56	61,22%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.238.280,62	25,47%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.413.468,87	6,07%	0,00%
Navi Capital	7.992.052,27	3,62%	0,46%
Itaú Unibanco	2.861.367,97	1,30%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.600.267,11	0,72%	0,00%
FL Asset Management	1.536.669,29	0,70%	1,41%

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%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,67%	11,05%	5,75%	12,94%	23,74%	34,32%	0,20%	2,178%	6,08%
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%
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%
IDKA IPCA 2 Anos	1,37%	4,95%	3,10%	6,27%	12,05%	24,00%	-	-	-
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%
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,64%	4,71%	2,92%	5,35%	10,91%	20,84%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,98%	6,73%	4,16%	8,77%	16,99%	27,76%	0,15%	1,271%	4,82%
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,53%	2,58%	1,52%	3,05%	6,58%	14,89%	0,20%	0,007%	0,29%

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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
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%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,53%	2,52%	1,49%	3,01%	6,19%	14,24%	0,15%	0,001%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	2,24%	1,33%	2,67%	5,49%	12,66%	0,80%	0,000%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	2,14%	1,27%	2,55%	5,24%	12,12%	1,00%	0,002%	0,01%
IPCA	0,13%	2,22%	1,46%	2,37%	4,66%	7,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,72%	7,97%	4,42%	9,40%	14,14%	23,38%	0,002	1,513%	3,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,93%	6,69%	4,04%	8,49%	16,22%	27,64%	0,20%	1,245%	4,60%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,76%	5,50%	3,04%	6,80%	12,96%	-	0,40%	0,976%	2,89%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,24%	5,36%	3,22%	6,52%	13,59%	26,70%	0,20%	0,646%	2,89%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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
SMLL	1,97%	11,47%	3,77%	13,81%	27,61%	51,54%	-	-	-
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	0,46%	9,49%	3,08%	14,79%	33,11%	66,38%	1,50%	8,633%	18,18%
Ibovespa	0,70%	10,40%	1,51%	8,41%	26,42%	54,73%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	3,35%	12,80%	3,86%	14,19%	27,01%	65,19%	2,00%	9,766%	22,22%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,63%	12,11%	1,37%	12,04%	31,89%	86,07%	1,50%	8,799%	19,45%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	1,20%	5,96%	1,21%	5,72%	22,15%	63,72%	2,00%	8,440%	20,58%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1,17%	3,26%	2,04%	4,69%	-	-	1,60%	0,542%	-
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,96%	7,47%	3,67%	8,51%	15,16%	27,21%	0,50%	1,889%	3,89%
S&P 500	-6,58%	9,78%	-1,16%	-0,29%	1,03%	14,11%	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-6,45%	11,04%	-0,30%	1,92%	4,73%	25,18%	1,00%	7,345%	13,87%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

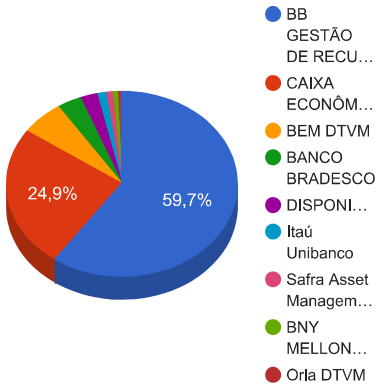
Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (maio / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	1,14%	11,04%	2,09%	9,61%	28,21%	55,53%	-	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,92%	10,11%	2,58%	-0,28%	5,54%	35,87%	0,60%	8,813%	18,24%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,23%	15,30%	7,32%	7,27%	17,98%	49,72%	1,50%	7,106%	-

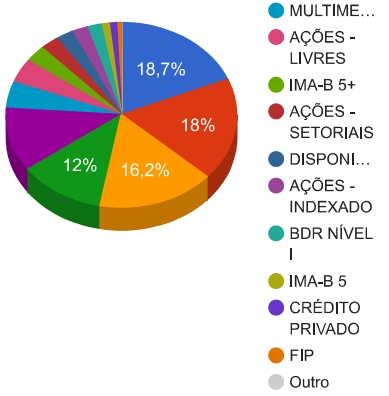
LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	135.185.313,56	61,22%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.238.280,62	25,47%
BEM DTVM	13.772.333,02	6,24%
BANCO BRADESCO	7.633.188,12	3,46%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.433.882,16	2,46%
Itaú Unibanco	2.861.367,97	1,30%
Safra Asset Management	1.996.644,04	0,90%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.600.267,11	0,72%
Orla DTVM	1.536.669,29	0,70%



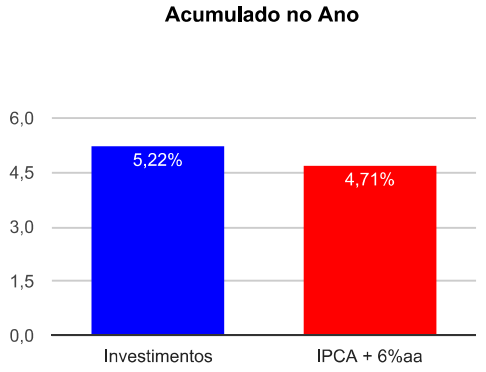
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	42.338.958,19	19,17%
IMA-GERAL EX-C	40.733.187,15	18,45%
IRF-M 1	36.754.686,00	16,64%
GESTÃO DURATION	27.225.048,06	12,33%
CDI	25.098.196,10	11,37%
MULTIMERCADO	10.530.767,57	4,77%
AÇÕES - LIVRES	9.592.319,38	4,34%
IMA-B 5+	6.643.653,05	3,01%
AÇÕES - SETORIAIS	5.780.280,75	2,62%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	5.433.882,16	2,46%
AÇÕES - INDEXADO	5.058.051,64	2,29%
BDR NÍVEL I	4.584.037,30	2,08%
IMA-B 5	2.537.460,00	1,15%
CRÉDITO PRIVADO	2.303.382,36	1,04%
FIP	1.536.669,29	0,70%
IDKA IPCA 2A	107.366,89	0,05%

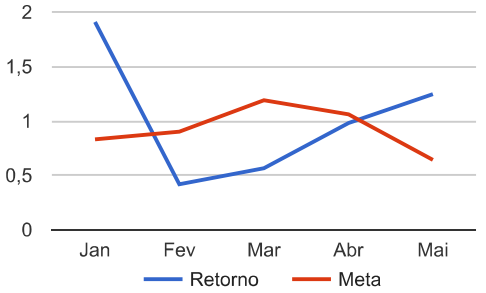


LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno ($)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	199.411.604,80	20.626.986,59	16.650.150,24	207.272.364,46	3.883.923,31	1,91%	0,83%	229,62%	1,05%
Fevereiro	207.272.364,46	10.474.792,39	14.657.541,45	203.953.129,12	863.513,72	0,42%	0,90%	46,52%	1,61%
Março	203.953.129,12	15.891.091,15	9.701.658,82	211.329.677,18	1.187.115,73	0,56%	1,19%	47,33%	2,57%
Abril	211.329.677,18	5.484.736,28	3.092.687,54	215.814.157,01	2.092.431,09	0,98%	1,06%	92,40%	1,41%
Maio	215.814.157,01	9.099.821,58	6.810.104,16	220.824.063,73	2.720.189,30	1,25%	0,64%	194,68%	1,85%
Acumulado no ano					10.747.173,15	5,22%	4,71%	110,83%	





LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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	6.319.977,05	0,00	0,00	6.643.653,05	323.676,00	5,12%	3,06%	5,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.241.615,57	0,00	0,00	2.323.976,94	82.361,37	3,67%	2,18%	3,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	24.316.987,55	0,00	0,00	24.977.749,17	660.761,62	2,72%	1,51%	2,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.927.572,56	0,00	0,00	40.733.187,15	805.614,59	2,02%	1,10%	2,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.394.869,69	0,00	191.174,88	7.348.157,88	144.463,07	1,95%	1,27%	1,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.193.997,91	0,00	0,00	26.699.829,13	505.831,22	1,93%	1,25%	1,93%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.208.356,96	0,00	0,00	2.247.298,89	38.941,93	1,76%	0,98%	1,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	106.360,36	0,00	0,00	107.366,89	1.006,53	0,95%	0,59%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.911.867,20	0,00	0,00	5.966.994,24	55.127,04	0,93%	0,54%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.915.272,85	0,00	0,00	21.052.092,88	136.820,03	0,65%	0,10%	0,65%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	2.290.000,00	0,00	2.303.382,36	13.382,36	0,58%	0,65%	1,24%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.523.712,00	0,00	0,00	2.537.460,00	13.748,00	0,54%	0,34%	0,54%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	22.538.705,19	0,00	0,00	22.658.633,94	119.928,75	0,53%	0,01%	0,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	564.321,21	0,00	0,00	567.309,05	2.987,84	0,53%	0,00%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.558.796,73	4.449.488,67	2.400.282,43	15.702.593,12	94.590,15	0,53%	0,10%	0,65%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.571,59	0,00	0,00	1.578,97	7,38	0,47%	0,00%	0,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.715.263,04	264.322,91	2.122.636,85	1.870.169,45	13.220,35	0,33%	0,00%	0,45%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.091.000,73	0,00	2.096.010,00	504,69	5.513,96	0,26%	0,00%	0,53%
			Total Renda Fixa		3.017.982,19	1,67%	0,88%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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(%)
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.548.359,91	0,00	0,00	1.600.267,11	51.907,20	3,35%	9,77%	3,35%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.016.699,40	0,00	0,00	1.036.601,83	19.902,43	1,96%	1,89%	1,96%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.864.135,19	0,00	0,00	7.992.052,27	127.917,08	1,63%	8,80%	1,63%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.025.112,43	0,00	0,00	3.061.407,60	36.295,17	1,20%	8,44%	1,20%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.555.813,44	0,00	0,00	6.632.797,77	76.984,33	1,17%	0,54%	1,17%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	5.753.707,74	0,00	0,00	5.780.280,75	26.573,01	0,46%	8,63%	0,46%
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	1.536.616,65	0,00	0,00	1.536.669,29	52,64	0,00%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.058.609,45	0,00	0,00	2.861.367,97	-197.241,48	-6,45%	7,34%	-6,45%
			Total Renda Variável		142.390,38	0,47%	6,50%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.096.010,00	0,00	1.996.644,04	-99.365,96	-4,74%	7,11%	-5,23%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.924.854,61	0,00	0,00	4.584.037,30	-340.817,31	-6,92%	8,81%	-6,92%
			Total Exterior		-440.183,27	-6,27%	8,30%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886