

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2019



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 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	46.225.629,42	19,12%	542	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.926.135,19	2,45%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	25.911.235,27	10,72%	630	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	12.624.170,24	5,22%	333	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.350.928,59	0,97%	1.214	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.509.592,00	1,04%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	7.599.130,70	3,14%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	109.677,31	0,05%	875	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	26.891.861,70	11,12%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.495.612,59	8,89%	1.390	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.880.468,96	0,78%	52	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.429.335,98	1,00%	107	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	512,28	0,00%	362	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.318.069,39	0,96%	136	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.116.193,65	1,29%	733	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.521,65	0,01%	333	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.008.399,82	9,52%	94	2,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	531.443,13	0,22%	701	0,02%	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	2.355.648,40	0,97%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	2.627.406,30	1,09%	12.747	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	462.453,26	0,19%	97.323	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.798.832,10	0,74%	3.723	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

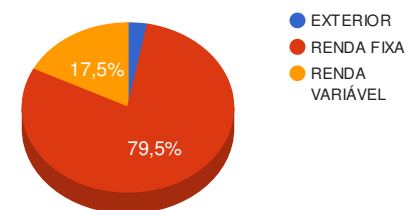
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	6.483.778,12	2,68%	46.226	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	8.756.982,58	3,62%	4.750	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.458.731,97	2,67%	431	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.391.539,77	1,40%	743	4,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.081.243,06	0,45%	10.173	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.774.040,39	2,80%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	3.066.213,73	1,27%	927	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.536.407,96	0,64%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5 du	Não há	2.263.862,11	0,94%	133	0,66%	Artigo 9º - A, Inciso III
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.958.896,10	2,05%	2.798	8,35%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			236.956.953,72				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.854.554,51				Artigo 6º
Total			241.811.508,23				

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

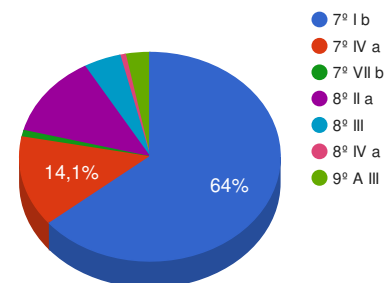
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	151.643.973,01	64,00%	40,00%	55,00%	100,00%	85.312.980,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	33.296.944,86	14,05%	0,00%	20,00%	40,00%	61.485.836,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.355.648,40	0,99%	0,00%	5,00%	5,00%	9.492.199,29
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	71.087.086,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	29.979.724,10	12,65%	0,00%	7,00%	20,00%	17.411.666,64
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.921.497,18	4,61%	0,00%	5,00%	10,00%	12.774.198,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.536.407,96	0,65%	0,00%	0,00%	5,00%	10.311.439,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	11.847.847,69
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	7.222.758,21	3,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.222.758,21
Total Carteira		236.956.953,72					

EXTERIOR	7.222.758,21	3,05%
RENDA FIXA	192.151.120,78	81,09%
RENDA VARIÁVEL	42.437.629,24	17,91%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 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 "	151.643.973,01	62,71%	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 "	33.296.944,86	13,77%	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 "	2.355.648,40	0,97%	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 "	29.979.724,10	12,40%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	10.921.497,18	4,52%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.536.407,96	0,64%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total	236.956.953,72	97,99%	40,00	690,00

Artigos	Base: agosto / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 9º - A, Inciso III	7.222.758,21	2,99%	0,00%	0,00%
Total	236.956.953,72	97,99%	40,00	690,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE JOÃO PESSOA - IPMJP

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/08/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	135.698.114,25	56,12%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.784.244,96	23,90%	0,01%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	16.478.658,35	6,81%	0,00%
Itaú Unibanco	9.549.991,85	3,95%	0,00%
Navi Capital	8.756.982,58	3,62%	0,52%
Moat Capital	2.627.406,30	1,09%	-
BANCO J. SAFRA S/A	2.263.862,11	0,94%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.798.832,10	0,74%	0,00%
LAD Capital	1.536.407,96	0,64%	-
Alaska Asset Management	462.453,26	0,19%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,60%	1,81%	4,78%	9,56%	20,95%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,06%	10,37%	3,42%	7,71%	18,66%	24,99%	0,15%	1,298%	4,81%
IRF-M 1	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,52%	4,50%	1,81%	3,45%	7,24%	14,42%	0,20%	0,181%	0,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,10%	0,181%	0,47%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	4,08%	1,51%	3,03%	6,16%	13,44%	0,20%	0,008%	0,10%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,49%	4,16%	1,54%	3,09%	6,53%	13,83%	0,20%	0,014%	0,28%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,49%	4,06%	1,50%	3,02%	6,10%	13,17%	0,15%	0,003%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,43%	3,60%	1,33%	2,68%	5,40%	11,68%	0,80%	0,003%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	3,43%	1,26%	2,55%	5,15%	11,14%	1,00%	0,005%	0,10%
IMA Geral ex-C	0,17%	8,94%	3,09%	6,43%	15,60%	22,43%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	9,42%	3,30%	6,85%	16,13%	22,79%	0,30%	1,176%	3,39%
IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,12%	7,75%	2,27%	5,56%	13,45%	23,04%	0,20%	0,950%	2,42%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,10%	8,82%	3,15%	6,29%	15,46%	-	0,40%	1,103%	3,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	10,17%	3,26%	7,43%	18,20%	24,74%	0,20%	1,286%	4,48%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	12,00%	3,74%	8,33%	16,60%	23,55%	0,002	1,744%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	6,86%	2,15%	4,94%	11,84%	19,96%	0,20%	0,710%	1,89%
IMA-B 5+	-0,77%	22,00%	5,82%	13,81%	38,20%	41,83%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,79%	21,63%	5,77%	13,60%	37,66%	40,89%	0,20%	3,599%	11,84%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,81%	21,64%	5,70%	13,53%	37,52%	40,79%	0,20%	3,600%	11,85%
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	6,70%	2,03%	4,74%	12,02%	19,92%	0,20%	0,554%	2,11%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,44%	16,08%	4,53%	10,54%	27,74%	32,89%	0,20%	2,521%	7,99%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,42%	-0,17%	-1,10%	0,97%	3,84%	6,03%	0,20%	4,181%	4,44%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

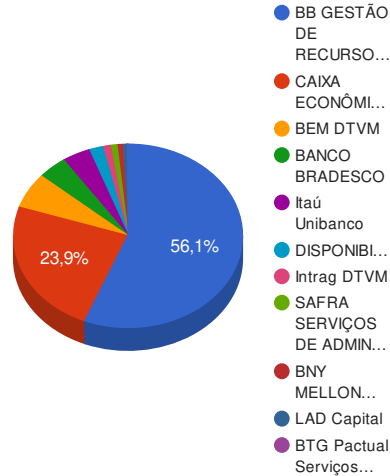
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,61%	12,10%	4,31%	8,13%	18,20%	26,34%	0,50%	2,028%	3,71%
SMLL	0,48%	27,92%	14,76%	19,08%	51,06%	47,54%	-	-	-
BRDESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	1,42%	22,34%	11,74%	15,18%	49,11%	62,89%	1,50%	10,868%	12,69%
S&P 500	-1,81%	16,74%	6,34%	5,10%	0,86%	18,40%	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-1,45%	18,99%	7,16%	6,84%	4,10%	27,76%	1,00%	11,960%	18,27%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3,35%	17,38%	10,78%	12,13%	35,81%	54,45%	2,00%	12,670%	12,17%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,52%	22,84%	9,57%	11,07%	46,30%	79,36%	1,50%	10,630%	16,14%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1,71%	26,80%	12,41%	16,75%	48,78%	60,56%	2,00%	13,217%	14,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,57%	24,51%	12,99%	14,33%	46,36%	62,65%	1,90%	11,003%	14,23%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,36%	5,45%	2,13%	4,21%	11,87%	-	1,60%	0,487%	2,66%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-0,08%	23,13%	11,31%	13,04%	54,71%	83,25%	1,85%	13,022%	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,29%	8,67%	7,45%	-0,02%	19,70%	60,69%	2,00%	14,323%	-
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

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

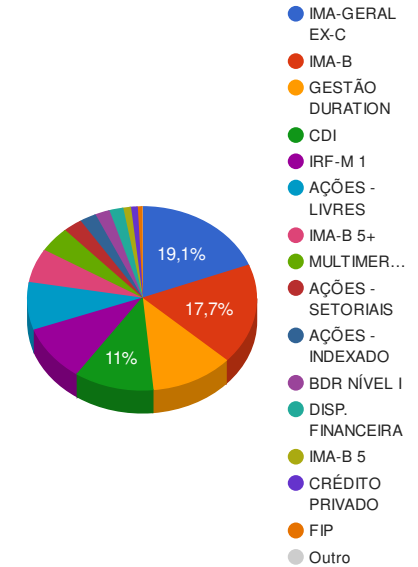
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	-0,16%	16,75%	5,14%	7,34%	34,86%	44,77%	-	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,76%	19,12%	8,18%	10,97%	-4,27%	47,08%	1,60%	10,681%	22,87%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,87%	30,73%	13,38%	21,68%	14,13%	70,00%	1,50%	8,803%	20,32%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	135.698.114,25	56,12%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.784.244,96	23,90%
BEM DTVM	15.215.714,55	6,29%
BANCO BRADESCO	10.019.926,38	4,14%
Itaú Unibanco	9.549.991,85	3,95%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.854.554,51	2,01%
Intrag DTVM	2.627.406,30	1,09%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA	2.263.862,11	0,94%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.798.832,10	0,74%
LAD Capital	1.536.407,96	0,64%
BTG Pactual Serviços Financeiros	462.453,26	0,19%

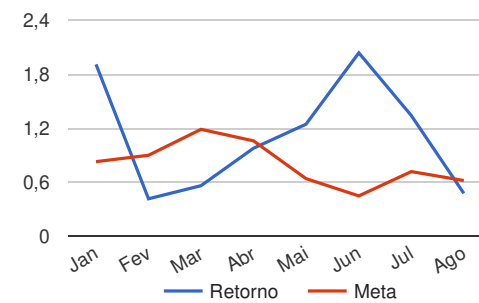
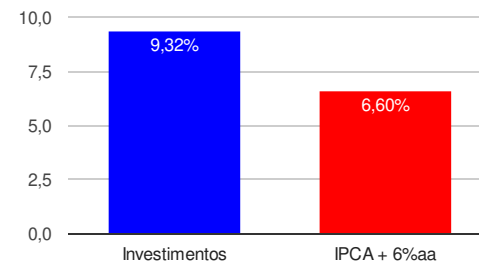


Sub-segmento	Valor	%
IMA-GERAL EX-C	46.225.629,42	19,12%
IMA-B	42.846.463,57	17,72%
GESTÃO DURATION	28.229.304,66	11,67%
CDI	26.669.070,53	11,03%
IRF-M 1	23.846.541,18	9,86%
AÇÕES - LIVRES	20.129.452,36	8,32%
IMA-B 5+	14.504.639,20	6,00%
MULTIMERCADO	10.921.497,18	4,52%
AÇÕES - SETORIAIS	6.458.731,97	2,67%
AÇÕES - INDEXADO	5.655.401,88	2,34%
BDR NÍVEL I	4.958.896,10	2,05%
DISP. FINANCEIRA	4.854.554,51	2,01%
IMA-B 5	2.509.592,00	1,04%
CRÉDITO PRIVADO	2.355.648,40	0,97%
FIP	1.536.407,96	0,64%
IDKA IPCA 2A	109.677,31	0,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.338.838,33	0,00	0,00	2.350.928,59	12.090,26	0,52%	0,18%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	528.836,83	0,00	0,00	531.443,13	2.606,30	0,49%	0,01%	0,49%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	22.896.058,11	0,00	0,00	23.008.399,82	112.341,71	0,49%	0,01%	0,49%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	509,79	0,00	0,00	512,28	2,49	0,49%	0,00%	0,49%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.946.060,25	2.971.234,75	1.812.810,90	3.116.193,65	11.709,55	0,24%	0,00%	0,41%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.571.816,00	0,00	68.247,04	2.509.592,00	6.023,04	0,23%	4,18%	-2,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.321.000,68	21.484.912,09	21.394.220,97	21.495.612,59	83.920,79	0,20%	0,18%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.077.732,02	0,00	162.070,08	5.926.135,19	10.473,25	0,17%	0,55%	0,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.593,13	21.462.468,01	21.484.912,09	12.521,65	33.372,60	0,16%	0,00%	0,43%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2.352.752,77	0,00	0,00	2.355.648,40	2.895,63	0,12%	0,95%	0,12%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.315.658,79	0,00	0,00	2.318.069,39	2.410,60	0,10%	1,10%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.186.491,90	0,00	0,00	46.225.629,42	39.137,52	0,08%	1,18%	0,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	109.619,99	0,00	0,00	109.677,31	57,32	0,05%	0,71%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.558.320,71	0,00	680.525,39	26.891.861,70	14.066,38	0,05%	1,29%	0,05%
CDB - BRABESCO S.A.	85.849,92	0,00	85.858,79	0,00	8,87	0,01%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.603.566,54	0,00	0,00	7.599.130,70	-4.435,84	-0,06%	1,30%	-0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	25.944.834,93	0,00	0,00	25.911.235,27	-33.599,66	-0,13%	1,74%	-0,13%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.440.136,97	0,00	0,00	2.429.335,98	-10.800,99	-0,44%	2,52%	-0,44%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.724.598,88	0,00	0,00	12.624.170,24	-100.428,64	-0,79%	3,60%	-0,79%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.895.825,01	0,00	0,00	1.880.468,96	-15.356,05	-0,81%	3,60%	-0,81%
Total Renda Fixa					166.495,13	0,09%	1,20%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.627.406,30	127.406,30	5,10%	13,02%	-0,08%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.281.699,54	0,00	0,00	3.391.539,77	109.840,23	3,35%	12,67%	3,35%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.541.329,98	0,00	0,00	8.756.982,58	215.652,60	2,52%	10,63%	2,52%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.768.554,20	0,00	0,00	1.798.832,10	30.277,90	1,71%	13,22%	1,71%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.383.841,59	0,00	0,00	6.483.778,12	99.936,53	1,57%	11,00%	1,57%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	6.368.224,06	0,00	0,00	6.458.731,97	90.507,91	1,42%	10,87%	1,42%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.074.732,92	0,00	0,00	1.081.243,06	6.510,14	0,61%	2,03%	0,61%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.749.868,26	0,00	0,00	6.774.040,39	24.172,13	0,36%	0,49%	0,36%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.536.512,40	0,00	0,00	1.536.407,96	-104,44	-0,01%	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	465.537,78	0,00	462.453,26	-3.084,52	-0,66%	14,32%	-3,29%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.111.267,05	0,00	0,00	3.066.213,73	-45.053,32	-1,45%	11,96%	-1,45%
				Total Renda Variável	656.061,46	1,57%	9,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	2.138.424,87	0,00	0,00	2.263.862,11	125.437,24	5,87%	8,80%	5,87%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.779.190,83	0,00	0,00	4.958.896,10	179.705,27	3,76%	10,68%	3,76%
				Total Exterior	305.142,51	4,41%	10,09%	

