

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.

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
TÍTULOS PÚBLICOS			85.323.705,84	16,20%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	51.762.750,81	9,83%	920	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	51.686.819,04	9,82%	616	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	56.024.246,40	10,64%	1.250	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	44.151.202,93	8,38%	507	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.720.956,25	10,39%	393	2,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	44.390.927,75	8,43%	245	0,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.720.571,91	0,71%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.356.667,29	0,26%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	45.722.197,23	8,68%	560	0,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	2.460.499,33	0,47%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.952.615,08	0,37%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	5.946,51	0,00%	11	2,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	5.596,76	0,00%	5	3,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.000.788,15	0,38%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	2.992,10	0,00%	2	2,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	15.086.152,21	2,86%	6.711	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	12.065.186,28	2,29%	4.851	1,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.672.969,12	1,65%	1.517	3,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	24.182.875,17	4,59%	29.937	1,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	233.643,39	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2019)

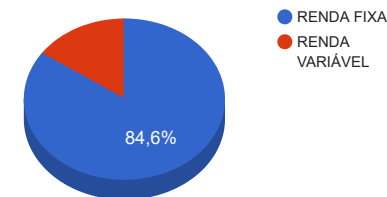
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.166.386,56	0,22%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.260.459,45	1,38%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.098,98	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.047.976,76	0,39%		4,34%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	2.677.800,00	0,51%		4,94%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.581.908,26	1,44%		10,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	309.668,40	0,06%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			526.574.607,96				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			517.783,73				Artigo 6º
Total			527.092.391,69				

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

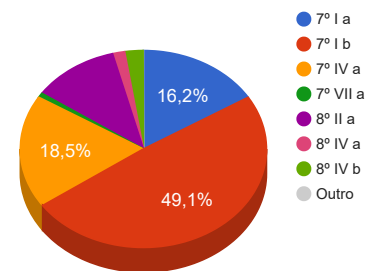
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	85.323.705,84	16,20%	0,00%	15,00%	100,00%	441.250.902,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	258.345.975,43	49,06%	0,00%	49,00%	100,00%	268.228.632,53
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	97.650.863,51	18,54%	0,00%	16,50%	40,00%	112.978.979,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.967.938,60	0,75%	0,00%	0,50%	2,00%	6.563.553,56
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	157.972.382,39
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	157.972.382,39
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	60.007.182,78	11,40%	0,00%	12,40%	20,00%	45.307.738,81
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	233.643,39	0,04%	0,00%	0,10%	3,00%	15.563.594,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.427.944,99	1,60%	0,00%	1,50%	3,00%	7.369.293,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	12.617.353,42	2,40%	0,00%	1,00%	3,00%	3.179.884,82
Total Carteira		526.574.607,96					

RENDA FIXA	445.806.267,11	84,66%
RENDA VARIÁVEL	81.286.124,58	15,44%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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 " a "	85.323.705,84	16,20%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	258.345.975,43	49,06%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	97.650.863,51	18,54%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.967.938,60	0,75%	0,00%	2,00%
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 "	60.007.182,78	11,40%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	233.643,39	0,04%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.427.944,99	1,60%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	12.617.353,42	2,40%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	526.574.607,96	100,00%	5,00	449,00

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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	152.205.904,29	28,90%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	151.862.268,37	28,84%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	85.323.705,84	16,20%	-
ITAÚ UNIBANCO	68.573.802,92	13,02%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	27.151.338,49	5,16%	0,08%
Queluz Gestão de Recursos	10.042.407,59	1,91%	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.672.969,12	1,65%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.274.994,82	1,38%	0,05%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.906.830,38	1,12%	3,67%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.677.800,00	0,51%	0,21%
Reditus Investimentos	2.047.976,76	0,39%	-
PETRA Capital	2.000.788,15	0,38%	0,04%
ROMA ASSET	1.356.667,29	0,26%	0,32%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.166.386,56	0,22%	5,42%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	309.668,40	0,06%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
VALORA INVESTIMENTOS	1.098,98	0,00%	0,00%

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	3,73%	15,21%	9,15%	15,21%	28,76%	39,31%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	15,04%	9,08%	15,04%	28,39%	38,55%	0,20%	2,331%	7,63%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1,78%	8,61%	4,88%	8,61%	-13,46%	-13,25%	0,00%	1,207%	27,48%
BRA1 FI RENDA FIXA	0,51%	-2,80%	-4,11%	-2,80%	2,16%	23,07%	1,30%	1,027%	5,79%
IRF-M	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%	0,20%	1,196%	4,10%
IMA Geral ex-C	1,95%	7,74%	4,69%	7,74%	15,64%	25,19%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	8,23%	5,14%	8,23%	15,98%	25,74%	0,30%	1,213%	3,59%
IMA-B 5	1,72%	7,28%	4,27%	7,28%	14,65%	25,81%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-18,09%	-18,62%	-18,82%	-18,62%	-12,61%	-3,10%	1,30%	24,609%	19,19%
IDKA IPCA 2 Anos	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%	0,20%	0,954%	1,93%
IRF-M 1	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%	0,10%	0,171%	0,49%
120% do CDI	0,56%	3,70%	1,85%	3,70%	7,63%	17,19%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-13,50%	-47,91%	-32,55%	-47,91%	-64,79%	-86,51%	0,00%	-	9,75%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-13,50%	-47,91%	-32,55%	-47,91%	-64,79%	-84,84%	0,00%	-	9,75%

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
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-13,50%	-47,91%	-32,55%	-47,91%	-64,79%	-85,66%	0,00%	-	9,75%
IPCA + 7,00% ao ano	0,52%	5,66%	2,40%	5,66%	10,51%	23,34%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,54%	2,16%	1,26%	2,16%	-	3,47%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,31%	4,27%	1,71%	4,27%	7,56%	16,85%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,14%	-2,29%	-1,83%	-2,29%	-3,96%	-10,66%	0,15%	0,031%	1,25%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,73%	10,92%	6,70%	10,92%	16,74%	26,22%	0,002	1,653%	3,42%
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

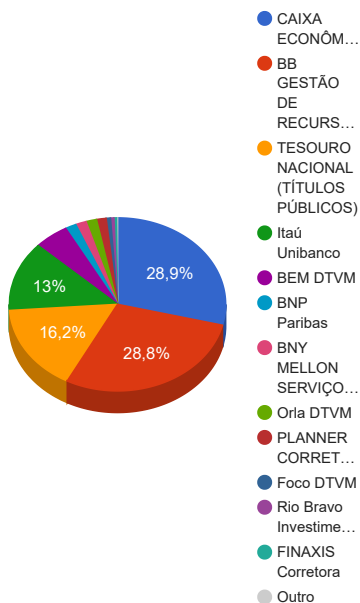
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,99%	19,26%	10,91%	19,26%	41,71%	61,51%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,50%	11,30%	9,50%	11,30%	35,83%	80,50%	2,00%	6,583%	18,02%
Ibovespa	4,06%	14,88%	5,82%	14,88%	38,76%	60,52%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,22%	18,16%	10,36%	18,16%	42,83%	74,12%	1,90%	7,359%	15,73%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,69%	23,70%	9,25%	23,70%	40,41%	36,97%	2,00%	4,940%	21,68%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,39%	9,97%	5,70%	9,97%	32,46%	71,65%	2,00%	7,647%	16,33%
IFIX	2,88%	11,67%	5,77%	11,67%	23,57%	26,61%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	6,72%	-6,67%	0,02%	-6,67%	8,79%	-4,35%	0,25%	8,222%	10,93%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	23,07%	15,66%	23,07%	18,52%	-4,97%	1,50%	0,000%	30,90%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	-89,46%	-88,84%	-88,78%	-88,84%	-87,37%	-90,06%	0,35%	10,058%	15,22%
IPCA + 11,00% ao ano	0,80%	7,57%	3,33%	7,57%	14,59%	32,62%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	144,869%	121,31%
CDI	0,47%	3,07%	1,54%	3,07%	6,32%	14,14%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,42%	4,30%	2,61%	4,30%	-94,70%	-94,22%	0,00%	0,864%	95,53%
IPCA	0,01%	2,23%	0,71%	2,23%	3,37%	7,91%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,001%	0,95%

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

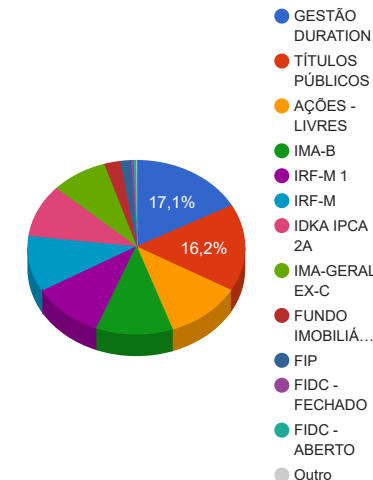
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	152.205.904,29	28,90%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	151.862.268,37	28,84%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	85.323.705,84	16,20%
Itaú Unibanco	68.573.802,92	13,02%
BEM DTVM	27.152.437,47	5,16%
BNP Paribas	8.672.969,12	1,65%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	8.426.846,01	1,60%
Orla DTVM	8.367.329,71	1,59%
PLANNER CORRETORA	7.581.908,26	1,44%
Foco DTVM	3.404.644,05	0,65%
Rio Bravo Investimentos	2.677.800,00	0,51%
FINAXIS Corretora	2.000.788,15	0,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	517.783,73	0,10%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	309.668,40	0,06%
Brasil Plural	14.535,37	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	90.113.124,98	17,11%
TÍTULOS PÚBLICOS	85.323.705,84	16,20%
AÇÕES - LIVRES	60.007.182,78	11,40%
IMA-B	59.224.557,57	11,25%
IRF-M 1	56.024.246,40	10,64%
IRF-M	54.720.956,25	10,39%
IDKA IPCA 2A	51.762.750,81	9,83%
IMA-GERAL EX-C	44.151.202,93	8,38%
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.617.353,42	2,40%
FIP	8.427.944,99	1,60%
FIDC - FECHADO	2.015.323,52	0,38%
FIDC - ABERTO	1.952.615,08	0,37%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	517.783,73	0,10%
MULTIMERCADO	233.643,39	0,04%



Carteira de Títulos Públicos - base (junho / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.738,985831	992.130,00	2.804.239,37
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.738,985831	998.799,60	2.841.629,23
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.738,985831	1.000.585,27	2.879.019,09
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.738,985831	1.124.114,15	3.178.137,96
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.738,985831	1.006.644,67	2.804.239,37
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.738,985831	999.750,00	2.804.239,37
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.738,985831	1.487.280,45	4.112.884,41
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.738,985831	859.423,87	2.355.561,07
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.738,985831	136.416,48	373.898,58
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.738,985831	997.614,60	2.729.459,66
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.738,985831	1.479.584,78	4.112.884,41
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.738,985831	1.098.188,08	3.290.307,53
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.407,393630	895.805,83	2.688.510,11
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	4.407,393630	1.483.219,48	4.451.467,57
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	4.407,393630	1.732.870,29	5.200.724,48
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.407,393630	1.249.170,73	4.037.172,57
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.337,090512	1.411.663,50	3.838.325,10
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.337,090512	1.171.463,51	3.218.121,16
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.337,090512	798.050,50	2.168.545,26
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.337,090512	1.046.269,96	2.871.153,92
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.337,090512	960.617,17	2.602.254,31
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.337,090512	1.479.336,56	4.068.190,90

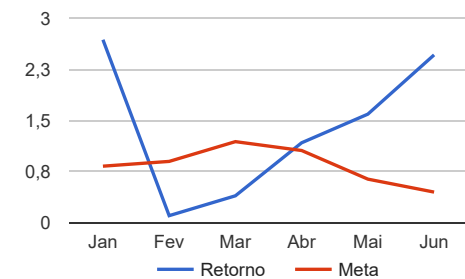
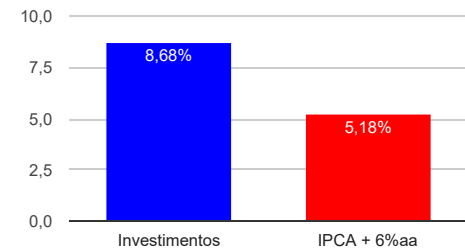
Carteira de Títulos Públicos - base (junho / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.337,090512	798.050,50	2.168.545,26
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.337,090512	1.002.194,60	2.992.592,45
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.337,090512	258.043,50	780.676,29
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.337,090512	909.797,78	2.736.704,11
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.337,090512	429.654,20	1.301.127,15
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.337,090512	2.083.308,72	5.638.217,67
TDA - Título da Dívida Agrária	01/07/2019	27/02/2004	893	67,21931691	104,510000	60.026,85	93.327,43
TDA - Título da Dívida Agrária	01/12/2019	27/02/2004	1782	61,61359147	101,880000	109.795,42	181.550,16

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	467.642.250,96	4.900.000,00	2.655.136,10	482.501.862,21	12.614.747,35	2,68%	0,83%	322,82%	1,94%
Fevereiro	482.501.862,21	5.913.071,48	3.583.646,50	485.336.511,02	505.223,83	0,10%	0,90%	11,64%	2,02%
Março	485.336.511,02	48.067.650,69	44.732.641,08	490.604.118,18	1.932.597,55	0,40%	1,19%	33,13%	3,26%
Abril	490.604.118,18	4.190.243,99	3.800.177,72	496.753.963,42	5.759.778,97	1,17%	1,06%	110,72%	1,77%
Mai	496.753.963,42	67.431.373,41	78.563.264,11	493.537.200,28	7.915.127,56	1,59%	0,64%	248,71%	2,08%
Junho	493.537.200,28	27.281.265,70	13.423.666,88	519.888.643,79	12.493.844,69	2,46%	0,45%	546,78%	2,14%
Acumulado no ano					41.221.319,95	8,68%	5,18%	167,72%	

Acumulado no Ano



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(%)	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.835.964,17	0,00	0,00	51.686.819,04	1.850.854,87	3,71%	2,33%	3,71%	
TÍTULOS PÚBLICOS	82.893.906,37	0,00	0,00	85.323.705,84	2.429.799,47	2,93%	-	-	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	44.505.071,92	0,00	0,00	45.722.197,23	1.217.125,31	2,73%	1,65%	2,73%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	43.288.163,67	0,00	0,00	44.390.927,75	1.102.764,08	2,55%	1,49%	2,55%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.213.385,56	0,00	0,00	44.151.202,93	937.817,37	2,17%	1,21%	2,17%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.570.986,72	0,00	0,00	54.720.956,25	1.149.969,53	2,15%	1,20%	2,15%	
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.655.615,88	0,00	0,00	3.720.571,91	64.956,03	1,78%	1,21%	1,78%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.139.405,44	0,00	0,00	51.762.750,81	623.345,37	1,22%	0,95%	1,22%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.042.475,72	4.640.000,00	2.980.000,00	56.024.246,40	321.770,68	0,55%	0,17%	0,57%	
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.942.100,33	0,00	0,00	1.952.615,08	10.514,75	0,54%	-	-	
BRA1 FI RENDA FIXA	2.448.025,12	0,00	0,00	2.460.499,33	12.474,21	0,51%	1,03%	0,51%	
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.003.685,12	0,00	0,00	2.000.788,15	-2.896,97	-0,14%	0,03%	-0,14%	
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	6.874,83	0,00	0,00	5.946,51	-928,32	-13,50%	-	-	
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	6.470,49	0,00	0,00	5.596,76	-873,73	-13,50%	-	-	
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	3.459,21	0,00	0,00	2.992,10	-467,11	-13,50%	-	-	
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.656.328,10	0,00	70.698,37	1.356.667,29	-228.962,44	-13,82%	24,61%	-18,09%	
Total Renda Fixa						9.487.263,10	2,18%	1,34%	

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(%)
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	2.540.000,00	0,00	18.000,00	2.677.800,00	155.800,00	6,13%	10,06%	-89,46%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	293.763,00	0,00	1.460,70	309.668,40	17.366,10	5,91%	8,22%	6,72%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	14.299.298,33	0,00	0,00	15.086.152,21	786.853,88	5,50%	6,58%	5,50%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	22.941.265,70	0,00	24.182.875,17	1.241.609,47	5,41%	7,36%	7,22%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.284.709,63	0,00	0,00	8.672.969,12	388.259,49	4,69%	4,94%	4,69%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.669.972,04	0,00	0,00	12.065.186,28	395.214,24	3,39%	7,65%	3,39%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.423.932,37	0,00	0,00	7.581.908,26	157.975,89	2,13%	-	0,00%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.343.515,45	0,00	10.497.675,03	0,00	154.159,58	1,49%	6,47%	5,49%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	232.663,07	0,00	0,00	233.643,39	980,32	0,42%	0,86%	0,42%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.262.230,75	0,00	0,00	7.260.459,45	-1.771,30	-0,02%	0,00%	-0,02%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.168.157,30	0,00	0,00	1.166.386,56	-1.770,74	-0,15%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	6.953,85	0,00	5.832,78	1.098,98	-22,09	-0,32%	144,87%	-84,20%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.297.813,39	0,00	0,00	2.047.976,76	-249.836,63	-10,87%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					3.044.818,21	3,89%	6,10%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	81.122.251,30	0,00	1.276.121,89	85.323.705,84	5.477.576,43	6,83%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.367.371,69	20.000.000,00	0,00	51.686.819,04	3.319.447,35	7,52%	9,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	42.852.276,25	0,00	0,00	45.722.197,23	2.869.920,98	6,70%	6,70%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	70.636.850,66	1.310.000,00	20.000.000,00	54.720.956,25	2.774.105,59	4,46%	4,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.993.444,29	0,00	0,00	44.151.202,93	2.157.758,64	5,14%	5,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	50.066.484,90	0,00	0,00	51.762.750,81	1.696.265,91	3,39%	3,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	42.881.373,41	0,00	44.390.927,75	1.509.554,34	3,52%	5,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.812.293,40	14.130.243,99	8.850.000,00	56.024.246,40	931.709,01	1,65%	1,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	42.244.491,75	0,00	42.845.063,22	0,00	600.571,47	1,42%	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.547.353,43	0,00	0,00	3.720.571,91	173.218,48	4,88%	4,88%
BRA1 FI RENDA FIXA	2.565.852,46	0,00	139.999,50	2.460.499,33	34.646,37	1,39%	-4,11%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.928.367,45	0,00	0,00	1.952.615,08	24.247,63	1,26%	1,26%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	4.436,31	0,00	0,00	2.992,10	-1.444,21	-32,55%	-32,55%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	8.298,16	0,00	0,00	5.596,76	-2.701,40	-32,55%	-32,55%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	8.816,72	0,00	0,00	5.946,51	-2.870,21	-32,55%	-32,55%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.038.138,54	0,00	0,00	2.000.788,15	-37.350,39	-1,83%	-1,83%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.671.223,94	0,00	70.698,37	1.356.667,29	-243.858,28	-14,59%	-18,82%
Total Renda Fixa					21.280.797,71	5,03%	

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 (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.777.354,54	0,00	0,00	15.086.152,21	1.308.797,67	9,50%	9,50%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	22.941.265,70	0,00	24.182.875,17	1.241.609,47	5,41%	10,36%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	11.501.614,84	0,00	12.443.590,67	0,00	941.975,83	8,19%	13,46%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.938.694,17	0,00	0,00	8.672.969,12	734.274,95	9,25%	9,25%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.414.355,00	0,00	0,00	12.065.186,28	650.831,28	5,70%	5,70%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.050.186,20	0,00	10.497.675,03	0,00	447.488,83	4,45%	8,57%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.227.071,68	0,00	0,00	7.581.908,26	354.836,58	4,91%	0,00%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	2.386.000,00	0,00	52.000,00	2.677.800,00	343.800,00	14,52%	-88,78%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	227.700,59	0,00	0,00	233.643,39	5.942,80	2,61%	2,61%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	313.206,54	0,00	6.127,25	309.668,40	2.589,11	0,91%	0,02%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	7.131,33	0,00	5.832,78	1.098,98	-199,57	-2,80%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.263.806,20	0,00	0,00	7.260.459,45	-3.346,75	-0,05%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.305.379,56	0,00	0,00	2.047.976,76	-257.402,80	-11,17%	15,66%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.941.828,27	0,00	0,00	1.166.386,56	-775.441,71	-39,93%	-
Total Renda Variável					4.995.755,69	6,55%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	78.260.604,70	0,00	2.135.248,35	85.323.705,84	9.198.349,49	11,92%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.898.744,55	20.000.000,00	0,00	51.686.819,04	4.788.074,49	13,39%	15,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	41.220.067,43	0,00	0,00	45.722.197,23	4.502.129,80	10,92%	10,92%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.238.573,38	2.210.000,00	20.000.000,00	54.720.956,25	4.272.382,87	6,74%	6,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.843.314,34	0,00	0,00	51.762.750,81	2.919.436,47	5,98%	5,98%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	83.376.988,22	30.108.566,16	59.650.000,00	56.024.246,40	2.188.692,02	3,06%	3,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	42.000.000,00	0,00	44.151.202,93	2.151.202,93	5,12%	8,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	40.964.785,32	0,00	42.845.063,22	0,00	1.880.277,90	4,59%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	42.881.373,41	0,00	44.390.927,75	1.509.554,34	3,52%	8,36%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.425.702,04	0,00	0,00	3.720.571,91	294.869,87	8,61%	8,61%
BRA1 FI RENDA FIXA	2.531.471,30	0,00	139.999,50	2.460.499,33	69.027,53	2,77%	-2,80%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.911.302,44	0,00	0,00	1.952.615,08	41.312,64	2,16%	2,16%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	5.743,75	0,00	0,00	2.992,10	-2.751,65	-47,91%	-47,91%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	10.743,75	0,00	0,00	5.596,76	-5.146,99	-47,91%	-47,91%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	11.415,13	0,00	0,00	5.946,51	-5.468,62	-47,91%	-47,91%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.047.707,67	0,00	0,00	2.000.788,15	-46.919,52	-2,29%	-2,29%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.666.994,26	0,00	70.698,37	1.356.667,29	-239.628,60	-14,37%	-18,62%
				Total Renda Fixa	33.515.394,97	8,22%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.011.303,99	0,00	0,00	8.672.969,12	1.661.665,13	23,70%	23,70%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	10.818.902,99	0,00	12.443.590,67	0,00	1.624.687,68	15,02%	20,62%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.554.329,24	0,00	0,00	15.086.152,21	1.531.822,97	11,30%	11,30%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	22.941.265,70	0,00	24.182.875,17	1.241.609,47	5,41%	18,16%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	9.319.705,47	0,00	10.497.675,03	0,00	1.177.969,56	12,64%	17,08%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.970.940,68	0,00	0,00	12.065.186,28	1.094.245,60	9,97%	9,97%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.127.731,81	0,00	128.189,18	7.581.908,26	582.365,63	8,27%	0,00%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	2.399.980,00	0,00	98.000,00	2.677.800,00	375.820,00	16,08%	-88,84%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.203.666,95	0,00	0,00	7.260.459,45	56.792,50	0,79%	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	335.668,86	0,00	44.235,29	309.668,40	18.234,83	5,64%	-6,67%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	224.008,44	0,00	0,00	233.643,39	9.634,95	4,30%	4,30%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	179.642,81	2.400,00	5.832,78	1.098,98	-175.111,05	-96,19%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.317.542,08	0,00	0,00	2.047.976,76	-269.565,32	-11,63%	23,07%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.941.828,27	0,00	0,00	1.166.386,56	-775.441,71	-39,93%	-
Total Renda Variável					8.154.730,24	11,13%	