



Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2019

PAR ENGENHARIA
FINANCEIRA

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 (dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			88.318.066,14	15,33%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	55.633.950,24	9,66%	964	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	55.102.065,89	9,57%	681	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	47.993.612,34	8,33%	695	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	55.608.050,96	9,65%	1.198	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	46.127.643,40	8,01%	580	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	58.182.748,23	10,10%	443	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	971.978,74	0,17%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	45.846.027,99	7,96%	289	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.832.557,60	0,67%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.261.044,81	0,22%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	1.657,31	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.860.759,49	0,32%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	886,02	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.926.713,32	0,33%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	1.760,88	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	21.877.760,32	3,80%	9.213	2,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	17.713.357,78	3,08%	1.982	5,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	29.731.209,04	5,16%	59.465	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	24.155.652,52	4,19%	7.423	1,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	221.821,76	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.275.542,15	1,26%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

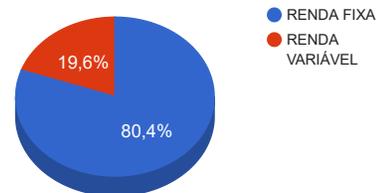
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	640,98	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.289.720,88	0,22%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	4.903.018,34	0,85%		8,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se aplica	Não se aplica	3.380.000,00	0,59%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	S/Info	Não se aplica	382.054,20	0,07%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.044.456,38	0,35%		5,78%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			575.644.757,71				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			311.434,23				Artigo 6º
Total			575.956.191,94				

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

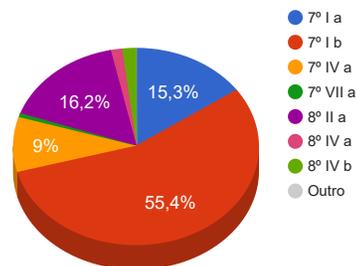
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	88.318.066,14	15,34%	0,00%	15,00%	100,00%	487.326.691,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	318.648.071,06	55,35%	0,00%	49,00%	100,00%	256.996.686,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	51.911.609,14	9,02%	0,00%	16,50%	40,00%	178.346.293,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.791.777,02	0,66%	0,00%	0,50%	2,00%	7.721.118,13
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	172.693.427,31
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	172.693.427,31
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	93.477.979,66	16,24%	0,00%	12,40%	20,00%	21.650.971,88
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	221.821,76	0,04%	0,00%	0,10%	3,00%	17.047.520,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.565.904,01	1,49%	0,00%	1,50%	3,00%	8.703.438,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.709.528,92	1,86%	0,00%	1,00%	3,00%	6.559.813,81
Total Carteira		575.644.757,71					

RENDA FIXA	462.980.957,59	80,43%
RENDA VARIÁVEL	112.975.234,35	19,63%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	88.318.066,14	15,33%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	318.648.071,06	55,33%	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 "	51.911.609,14	9,01%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.791.777,02	0,66%	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 "	93.477.979,66	16,23%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	221.821,76	0,04%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.565.904,01	1,49%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.709.528,92	1,86%	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	575.644.757,71	99,95%	5,00	449,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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	161.810.310,81	28,09%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	156.837.760,25	27,23%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	88.318.066,14	15,33%	-
ITAÚ UNIBANCO	75.577.237,03	13,12%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	46.033.412,84	7,99%	0,14%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	17.713.357,78	3,08%	0,03%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.275.542,15	1,26%	11,08%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.981.092,68	1,04%	2,53%
Queluz Gestão de Recursos	5.874.997,08	1,02%	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.380.000,00	0,59%	0,23%
Reditus Investimentos	2.044.456,38	0,35%	-
PETRA Capital	1.860.759,49	0,32%	0,03%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.289.720,88	0,22%	1,96%
Veritas Capital Management	1.261.044,81	0,22%	0,07%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	382.054,20	0,07%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BRASIL PLURAL	4.304,21	0,00%	0,00%%
VALORA INVESTIMENTOS	640,98	0,00%	0,00%%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,97%	22,64%	2,78%	6,61%	22,64%	38,29%	0,20%	2,774%	6,92%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,68%	11,88%	0,81%	3,01%	11,88%	-	0,00%	1,121%	4,06%
BRA1 FI RENDA FIXA	-29,85%	-61,60%	-29,46%	-60,50%	-61,60%	-56,86%	1,30%	26,028%	51,53%
IPCA + 7,00% ao ano	1,72%	11,64%	3,53%	5,66%	11,64%	23,86%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,43%	0,81%	-0,83%	-1,33%	0,81%	1.138,74%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,50%	8,62%	2,83%	4,18%	8,62%	17,28%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-9,13%	-0,53%	-7,00%	-9,13%	-15,37%	0,15%	0,037%	6,04%
IMA-B 5	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,37%	-24,35%	-0,57%	-7,05%	-24,35%	-14,66%	1,30%	7,529%	17,96%
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	11,19%	2,40%	4,92%	11,19%	21,53%	0,20%	0,738%	1,60%
IPCA	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,59%	16,43%	1,80%	4,97%	16,43%	25,53%	0,002	0,931%	3,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	11,91%	1,19%	3,28%	11,91%	21,11%	0,40%	0,008%	2,85%
IMA Geral ex-C	0,91%	12,63%	1,90%	4,54%	12,63%	23,66%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	13,07%	1,81%	4,48%	13,07%	24,27%	0,30%	1,209%	3,22%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	0,62%	12,03%	1,86%	4,72%	12,03%	24,05%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,61%	11,68%	1,81%	4,59%	11,68%	23,64%	0,20%	0,932%	2,66%
120% do CDI	0,45%	7,19%	1,49%	3,37%	7,19%	15,51%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-22,11%	-84,57%	-52,28%	-70,39%	-84,57%	-94,80%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-22,11%	-84,57%	-52,28%	-70,39%	-84,57%	-95,11%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-22,11%	-84,57%	-52,28%	-70,39%	-84,57%	-94,51%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	6,49%	1,31%	3,18%	6,49%	13,69%	0,10%	0,069%	0,40%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

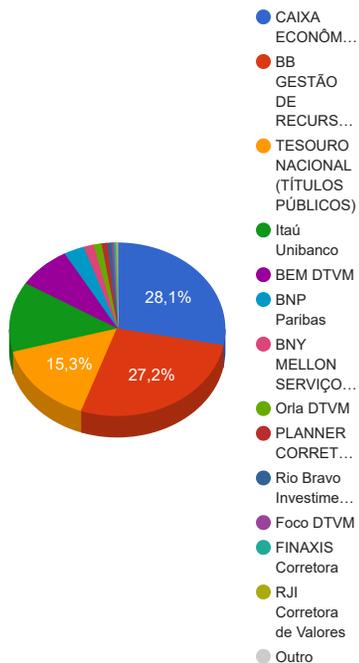
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	12,65%	58,20%	21,15%	32,65%	58,20%	71,06%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10,83%	49,67%	19,61%	34,48%	49,67%	89,25%	2,00%	6,377%	14,26%
IFIX	10,63%	35,98%	19,12%	21,76%	35,98%	43,62%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	18,30%	13,82%	29,63%	21,96%	13,82%	11,04%	0,25%	10,743%	22,13%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	16,60%	-85,92%	32,55%	26,22%	-85,92%	-86,50%	0,35%	9,370%	19,74%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-7,70%	-23,40%	-25,00%	-7,70%	-15,30%	1,50%	0,000%	31,24%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-19,41%	106,02%	106,02%	106,02%	106,02%	-	0,14%	-	-
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	1,90%	4,076%	12,62%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,53%	28,60%	9,30%	16,94%	28,60%	62,19%	2,00%	4,443%	10,55%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6,70%	41,91%	10,08%	14,72%	41,91%	44,59%	2,00%	4,141%	15,53%
IPCA + 11,00% ao ano	2,03%	15,83%	4,50%	7,68%	15,83%	33,27%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	48,558%	118,78%
IPCA	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,025%	0,99%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,87%	-0,98%	-2,63%	-5,06%	-0,98%	-94,81%	0,00%	0,033%	2,97%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,10%	0,256%	11,83%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	161.810.310,81	28,09%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	156.837.760,25	27,23%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	88.318.066,14	15,33%
Itaú Unibanco	75.577.237,03	13,12%
BEM DTVM	46.034.053,82	7,99%
BNP Paribas	17.713.357,78	3,08%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	8.565.263,03	1,49%
Orla DTVM	6.953.071,42	1,21%
PLANNER CORRETORA	4.903.018,34	0,85%
Rio Bravo Investimentos	3.380.000,00	0,59%
Foco DTVM	2.044.456,38	0,35%
FINAXIS Corretora	1.860.759,49	0,32%
RJI Corretora de Valores	1.261.044,81	0,22%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	382.054,20	0,07%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	311.434,23	0,05%
BRASIL PLURAL S.A. BANCO MÚLTIPLO	4.304,21	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	93.839.640,33	16,29%
AÇÕES - LIVRES	93.477.979,66	16,23%
TÍTULOS PÚBLICOS	88.318.066,14	15,33%
IMA-B	61.167.647,04	10,62%
IRF-M	58.182.748,23	10,10%
IDKA IPCA 2A	55.633.950,24	9,66%
IRF-M 1	55.608.050,96	9,65%
IMA-GERAL EX-C	46.127.643,40	8,01%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.709.528,92	1,86%
FIP	8.565.904,01	1,49%
FIDC - ABERTO	1.926.713,32	0,33%
FIDC - FECHADO	1.865.063,70	0,32%
DISP. FINANCEIRA	311.434,23	0,05%
MULTIMERCADO	221.821,76	0,04%



Carteira de Títulos Públicos - base (dezembro / 2019)

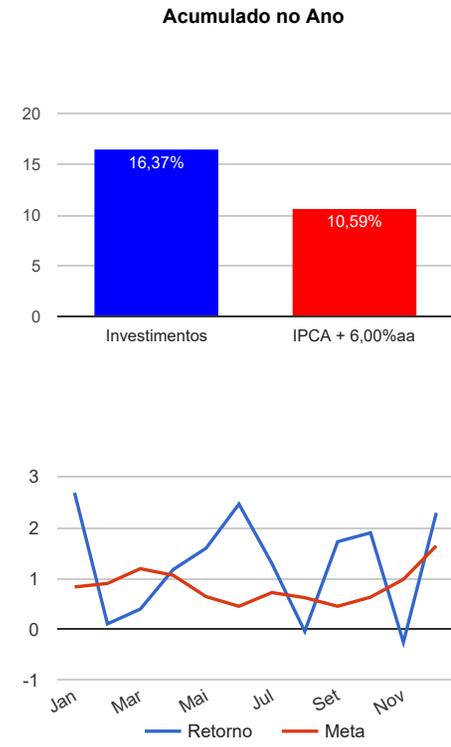
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.874,771927	1.479.584,78	4.262.249,12
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.874,771927	1.098.188,08	3.409.799,30
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.874,771927	992.130,00	2.906.078,95
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.874,771927	998.799,60	2.944.826,66
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.874,771927	1.000.585,27	2.983.574,38
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.874,771927	1.124.114,15	3.293.556,14
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.874,771927	1.006.644,67	2.906.078,95
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.874,771927	999.750,00	2.906.078,95
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.874,771927	1.487.280,45	4.262.249,12
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.874,771927	859.423,87	2.441.106,31
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.874,771927	136.416,48	387.477,19
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.874,771927	997.614,60	2.828.583,51
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.665,552000	895.805,83	2.845.986,72
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	4.665,552000	1.483.219,48	4.712.207,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	4.665,552000	1.732.870,29	5.505.351,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.665,552000	1.249.170,73	4.273.645,63
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.471,394594	1.411.663,50	3.957.184,22
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.471,394594	1.171.463,51	3.317.774,79
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.471,394594	798.050,50	2.235.697,30
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.471,394594	1.046.269,96	2.960.063,22
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.471,394594	960.617,17	2.682.836,76
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.471,394594	1.479.336,56	4.194.168,13

Carteira de Títulos Públicos - base (dezembro / 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	4.471,394594	798.050,50	2.235.697,30
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.471,394594	1.002.194,60	3.085.262,27
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.471,394594	258.043,50	804.851,03
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.471,394594	909.797,78	2.821.449,99
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.471,394594	429.654,20	1.341.418,38
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.471,394594	2.083.308,72	5.812.812,97

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%
Julho	519.888.643,79	10.542.289,75	8.532.379,16	528.641.681,23	6.743.126,85	1,29%	0,72%	178,40%	1,81%
Agosto	528.641.681,23	8.270.000,00	6.746.432,08	529.938.850,80	-226.398,35	-0,04%	0,62%	-6,88%	2,92%
Setembro	529.938.850,80	4.805.573,90	3.039.330,86	540.859.751,47	9.154.657,63	1,72%	0,45%	385,56%	2,26%
Outubro	540.859.751,47	5.470.000,00	3.758.887,90	552.860.607,90	10.289.744,33	1,90%	0,63%	299,24%	2,13%
Novembro	552.860.607,90	5.780.000,00	7.025.820,60	550.185.207,83	-1.429.579,47	-0,26%	0,98%	-26,50%	1,96%
Dezembro	550.185.207,83	11.919.985,66	6.893.187,52	567.916.839,08	12.704.833,11	2,29%	1,64%	139,33%	1,82%
Acumulado no ano					78.457.704,05	16,37%	10,59%	154,55%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TÍTULOS PÚBLICOS	86.763.748,73	0,00	186.290,28	88.318.066,14	1.740.607,69	2,01%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.035.107,21	0,00	0,00	55.102.065,89	1.066.958,68	1,97%	2,77%	1,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	55.028.857,03	0,00	0,00	55.633.950,24	605.093,21	1,10%	0,74%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.689.571,14	0,00	0,00	46.127.643,40	438.072,26	0,96%	1,21%	0,96%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.806.533,30	0,00	0,00	3.832.557,60	26.024,30	0,68%	1,12%	0,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.829.631,33	0,00	0,00	58.182.748,23	353.116,90	0,61%	0,93%	0,61%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	47.710.500,99	0,00	0,00	47.993.612,34	283.111,35	0,59%	0,93%	0,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	51.890.866,38	10.119.985,66	6.620.000,00	55.608.050,96	217.198,92	0,35%	0,07%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	45.688.975,75	0,00	0,00	45.846.027,99	157.052,24	0,34%	0,01%	0,34%
BRA1 FI RENDA FIXA	1.385.658,50	0,00	417.080,08	971.978,74	3.400,32	0,25%	26,03%	-29,85%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.863.795,05	0,00	0,00	1.860.759,49	-3.035,56	-0,16%	0,04%	-0,16%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.265.683,98	0,00	0,00	1.261.044,81	-4.639,17	-0,37%	7,53%	-0,37%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.935.011,03	0,00	0,00	1.926.713,32	-8.297,71	-0,43%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	1.137,58	0,00	0,00	886,02	-251,56	-22,11%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	2.260,84	0,00	0,00	1.760,88	-499,96	-22,11%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	2.127,87	0,00	0,00	1.657,31	-470,56	-22,11%	-	-
Total Renda Fixa					4.873.441,35	1,06%	1,05%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	322.944,54	0,00	1.817,16	382.054,20	60.926,82	18,87%	10,74%	18,30%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.898.800,00	0,00	18.000,00	3.380.000,00	499.200,00	17,22%	9,37%	16,60%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	21.795.674,06	0,00	0,00	24.155.652,52	2.359.978,46	10,83%	6,38%	10,83%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	27.495.828,38	0,00	0,00	29.731.209,04	2.235.380,66	8,13%	4,08%	8,13%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	19.370.346,25	1.000.000,00	0,00	21.877.760,32	1.507.414,07	7,40%	4,44%	7,53%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	15.629.235,45	1.000.000,00	0,00	17.713.357,78	1.084.122,33	6,52%	4,14%	6,70%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.983.342,65	0,00	0,00	2.044.456,38	61.113,73	3,08%	0,00%	0,00%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	4.839.936,41	0,00	0,00	4.903.018,34	63.081,93	1,30%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.277.548,95	0,00	0,00	7.275.542,15	-2.006,80	-0,03%	0,03%	-0,03%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.293.875,78	0,00	0,00	1.289.720,88	-4.154,90	-0,32%	0,26%	-0,32%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	223.759,47	0,00	0,00	221.821,76	-1.937,71	-0,87%	0,03%	-0,87%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	936,93	0,00	0,00	640,98	-295,95	-31,59%	48,56%	-31,59%
Total Renda Variável					7.862.822,64	7,48%	4,46%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	86.812.144,25	0,00	1.481.604,82	88.318.066,14	2.987.526,71	3,46%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	53.612.142,46	0,00	0,00	55.102.065,89	1.489.923,43	2,78%	2,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.034.723,85	1.300.000,00	0,00	55.633.950,24	1.299.226,39	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.146.535,61	0,00	0,00	58.182.748,23	1.036.212,62	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	47.146.340,33	0,00	0,00	47.993.612,34	847.272,01	1,80%	1,80%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.307.164,94	0,00	0,00	46.127.643,40	820.478,46	1,81%	1,81%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.049.576,04	16.839.985,66	13.980.000,00	55.608.050,96	698.489,26	1,22%	1,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	45.305.311,79	0,00	0,00	45.846.027,99	540.716,20	1,19%	1,19%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.801.695,85	0,00	0,00	3.832.557,60	30.861,75	0,81%	0,81%
BRA1 FI RENDA FIXA	1.377.819,52	0,00	417.080,08	971.978,74	11.239,30	0,82%	-29,46%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.261.936,94	0,00	0,00	1.261.044,81	-892,13	-0,07%	-0,57%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	1.856,70	0,00	0,00	886,02	-970,68	-52,28%	-52,28%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	3.472,98	0,00	0,00	1.657,31	-1.815,67	-52,28%	-52,28%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	3.690,01	0,00	0,00	1.760,88	-1.929,13	-52,28%	-52,28%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.870.616,16	0,00	0,00	1.860.759,49	-9.856,67	-0,53%	-0,53%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.942.935,94	0,00	0,00	1.926.713,32	-16.222,62	-0,83%	-0,83%
Total Renda Fixa					9.730.259,23	2,15%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	20.195.936,21	0,00	0,00	24.155.652,52	3.959.716,31	19,61%	19,61%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	26.355.001,84	0,00	0,00	29.731.209,04	3.376.207,20	12,81%	12,81%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	17.063.685,43	3.000.000,00	0,00	21.877.760,32	1.814.074,89	9,26%	9,30%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	13.184.686,77	3.000.000,00	0,00	17.713.357,78	1.528.671,01	9,82%	10,08%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.550.000,00	0,00	54.000,00	3.380.000,00	884.000,00	34,94%	32,55%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.158.908,72	0,00	0,00	1.289.720,88	130.812,16	11,29%	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.294.492,85	0,00	2.499.985,66	4.903.018,34	108.511,15	1,93%	106,02%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	294.736,80	0,00	5.225,46	382.054,20	92.542,86	31,67%	29,63%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.990.147,36	0,00	0,00	2.044.456,38	54.309,02	2,73%	-23,40%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	1.011,73	0,00	0,00	640,98	-370,75	-36,65%	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	227.804,88	0,00	0,00	221.821,76	-5.983,12	-2,63%	-2,63%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.282.105,95	0,00	0,00	7.275.542,15	-6.563,80	-0,09%	-
Total Renda Variável					11.935.926,93	11,88%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	78.260.604,70	0,00	4.493.986,85	88.318.066,14	14.551.448,29	19,02%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.898.744,55	20.000.000,00	0,00	55.102.065,89	8.203.321,34	20,88%	22,64%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.238.573,38	3.130.000,00	20.000.000,00	58.182.748,23	6.814.174,85	11,63%	11,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	41.220.067,43	0,00	0,00	47.993.612,34	6.773.544,91	16,43%	16,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.843.314,34	1.300.000,00	0,00	55.633.950,24	5.490.635,90	11,19%	11,19%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	42.000.000,00	0,00	46.127.643,40	4.127.643,40	9,83%	13,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	83.376.988,22	59.786.415,47	91.410.000,00	55.608.050,96	3.854.647,27	6,08%	6,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	42.881.373,41	0,00	45.846.027,99	2.964.654,58	6,91%	11,91%
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%	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.425.702,04	0,00	0,00	3.832.557,60	406.855,56	11,88%	11,88%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.911.302,44	0,00	0,00	1.926.713,32	15.410,88	0,81%	0,81%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	5.743,75	0,00	0,00	886,02	-4.857,73	-84,57%	-84,57%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	10.743,75	0,00	0,00	1.657,31	-9.086,44	-84,57%	-84,57%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	11.415,13	0,00	0,00	1.760,88	-9.654,25	-84,57%	-84,57%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.047.707,67	0,00	0,00	1.860.759,49	-186.948,18	-9,13%	-9,13%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.666.994,26	0,00	70.698,37	1.261.044,81	-335.251,08	-20,41%	-24,35%
BRA1 FI RENDA FIXA	2.531.471,30	0,00	557.079,58	971.978,74	-1.002.412,98	-41,98%	-61,60%
				Total Renda Fixa	53.534.404,22	13,13%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.554.329,24	3.000.000,00	0,00	24.155.652,52	7.601.323,28	49,37%	49,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	22.941.265,70	0,00	29.731.209,04	6.789.943,34	29,60%	45,27%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.970.940,68	7.000.000,00	0,00	21.877.760,32	3.906.819,64	28,28%	28,60%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.011.303,99	7.000.000,00	0,00	17.713.357,78	3.702.053,79	41,30%	41,91%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	10.818.902,99	0,00	12.443.590,67	0,00	1.624.687,68	15,02%	53,27%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.399.980,00	0,00	217.800,00	3.380.000,00	1.197.820,00	52,88%	-85,92%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	9.319.705,47	0,00	10.497.675,03	0,00	1.177.969,56	12,64%	35,97%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.127.731,81	0,00	2.759.488,06	4.903.018,34	534.774,59	8,02%	106,02%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	335.668,86	0,00	53.355,95	382.054,20	99.741,29	34,09%	13,82%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.203.666,95	0,00	0,00	7.275.542,15	71.875,20	1,00%	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	224.008,44	0,00	0,00	221.821,76	-2.186,68	-0,98%	-0,98%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	179.642,81	2.400,00	5.832,78	640,98	-175.569,05	-97,78%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.317.542,08	0,00	0,00	2.044.456,38	-273.085,70	-11,78%	-7,70%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.941.828,27	0,00	0,00	1.289.720,88	-652.107,39	-33,58%	-
Total Renda Variável					25.604.059,55	32,04%	