

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			12.797.266,65	2,50%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			82.893.906,37	16,16%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.570.986,72	10,45%	385	2,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	49.835.964,17	9,72%	588	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	51.139.405,44	9,97%	897	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	54.042.475,72	10,54%	1.253	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	43.213.385,56	8,43%	488	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.656.328,10	0,32%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	44.505.071,92	8,68%	513	0,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	43.288.163,67	8,44%	238	0,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.655.615,88	0,71%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	2.448.025,12	0,48%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.942.100,33	0,38%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	3.459,21	0,00%	2	2,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	6.874,83	0,00%	11	2,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	6.470,49	0,00%	5	3,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.003.685,12	0,39%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	10.343.515,45	2,02%	147	10,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	14.299.298,33	2,79%	6.624	1,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.669.972,04	2,28%	4.898	1,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.284.709,63	1,62%	1.363	3,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	232.663,07	0,05%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2019)

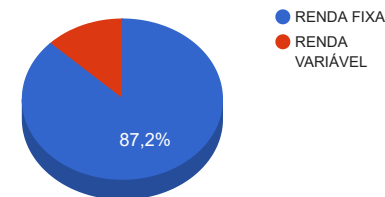
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	6.953,85	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.262.230,75	1,42%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.168.157,30	0,23%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.297.813,39	0,45%		4,87%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	293.763,00	0,06%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	2.540.000,00	0,50%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.423.932,37	1,45%		10,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	512.832.194,48				

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

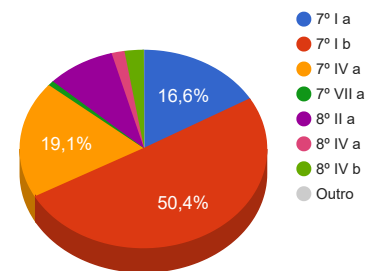
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	82.893.906,37	16,16%	0,00%	15,00%	100,00%	429.938.288,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	251.802.217,61	49,10%	0,00%	49,00%	100,00%	261.029.976,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	95.553.204,69	18,63%	0,00%	16,50%	40,00%	109.579.673,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.962.589,98	0,77%	0,00%	0,50%	2,00%	6.294.053,91
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	153.849.658,34
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	153.849.658,34
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	44.597.495,45	8,70%	0,00%	12,40%	20,00%	57.968.943,45
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	232.663,07	0,05%	0,00%	0,10%	3,00%	15.152.302,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.437.341,90	1,65%	0,00%	1,50%	3,00%	6.947.623,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	12.555.508,76	2,45%	0,00%	1,00%	3,00%	2.829.457,07
Total Carteira		500.034.927,83					

RENDA FIXA	447.009.185,30	89,40%
RENDA VARIÁVEL	65.823.009,18	13,16%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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 "	82.893.906,37	16,16%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	251.802.217,61	49,10%	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 "	95.553.204,69	18,63%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.962.589,98	0,77%	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 "	44.597.495,45	8,70%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	232.663,07	0,05%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.437.341,90	1,65%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	12.555.508,76	2,45%	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	500.034.927,83	97,50%	5,00	449,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (maio / 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	149.215.464,08	29,10%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	147.091.825,45	28,68%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	82.893.906,37	16,16%	-
ITAÚ UNIBANCO	43.288.163,67	8,44%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	25.969.270,37	5,06%	0,08%
Queluz Gestão de Recursos	20.215.472,94	3,94%	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.284.709,63	1,62%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.279.035,28	1,42%	0,06%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.830.379,28	1,14%	3,62%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.540.000,00	0,50%	0,19%
Reditus Investimentos	2.297.813,39	0,45%	23,18%
FINAXIS CORRETORA	2.003.685,12	0,39%	-
ROMA ASSET	1.656.328,10	0,32%	0,37%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.168.157,30	0,23%	5,42%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	293.763,00	0,06%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
VALORA INVESTIMENTOS	6.953,85	0,00%	0,00%

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	3,66%	11,06%	5,83%	12,89%	23,73%	34,52%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,63%	10,92%	5,76%	12,71%	23,36%	33,78%	0,20%	2,156%	5,82%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	2,16%	6,71%	3,39%	7,64%	-	-14,75%	0,00%	1,236%	-
BRA1 FI RENDA FIXA	0,29%	-3,30%	-4,33%	-2,54%	2,43%	22,87%	1,30%	0,821%	5,65%
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%
IRF-M	1,77%	4,72%	2,99%	6,33%	13,33%	25,08%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,73%	4,54%	2,86%	6,08%	13,17%	24,52%	0,20%	1,018%	3,47%
IMA-B 5	1,39%	5,47%	3,31%	6,91%	13,22%	24,34%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,28%	-0,64%	-0,29%	3,20%	7,40%	25,56%	1,30%	7,929%	7,70%
IDKA IPCA 2 Anos	1,37%	4,95%	3,10%	6,27%	12,05%	24,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	4,70%	2,82%	5,91%	11,05%	22,36%	0,20%	0,634%	2,29%
IPCA + 7,00% ao ano	0,72%	5,11%	3,16%	5,84%	11,95%	23,11%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,26%	1,61%	0,73%	1,26%	1.354,88%	-47,48%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,68%	2,72%	1,66%	3,30%	7,19%	15,95%	-	-	-
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%
120% do CDI	0,65%	3,12%	1,85%	3,73%	7,69%	17,67%	-	-	-

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
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-	-39,78%	-29,38%	-44,50%	-60,90%	-84,09%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-	-39,78%	-29,38%	-44,50%	-60,90%	-85,04%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-	-39,78%	-29,38%	-44,50%	-60,90%	-83,19%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,48%	3,94%	2,48%	4,43%	8,96%	16,60%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,26%	-2,15%	-1,85%	-2,30%	-4,87%	-11,09%	0,15%	0,277%	1,42%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,80%	5,67%	2,87%	7,27%	10,74%	22,76%	0,40%	0,985%	1,93%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

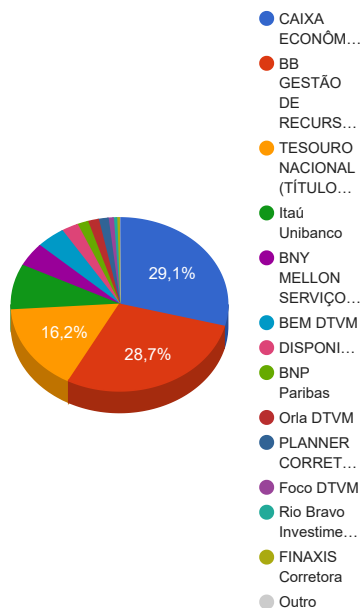
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	1,97%	11,47%	3,77%	13,81%	27,61%	51,54%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,21%	5,50%	2,04%	10,46%	25,40%	69,93%	2,00%	8,020%	20,99%
IFIX	1,76%	8,55%	4,85%	10,96%	15,29%	24,11%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	15,66%	23,07%	15,66%	23,07%	-9,43%	-4,97%	1,50%	25,166%	37,16%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	2,79%	5,83%	8,64%	8,55%	9,86%	-3,86%	0,35%	7,948%	12,35%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,14%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	-2,55%	-12,55%	-14,12%	-11,38%	-0,48%	-11,78%	0,25%	5,330%	16,32%
IBX	1,14%	11,04%	2,09%	9,61%	28,21%	55,53%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2,77%	10,99%	1,99%	12,00%	25,26%	48,06%	2,00%	9,669%	19,64%
IPCA + 11,00% ao ano	1,05%	6,72%	4,09%	7,77%	16,12%	32,41%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	3,581%	96,25%
Ibovespa	0,70%	10,40%	1,51%	8,41%	26,42%	54,73%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1,81%	18,16%	3,94%	19,43%	29,52%	31,80%	2,00%	8,432%	18,25%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,48%	6,37%	1,43%	6,34%	22,54%	66,38%	2,00%	9,143%	22,50%
CDI	0,54%	2,59%	1,54%	3,10%	6,37%	14,52%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,23%	3,86%	3,01%	5,48%	-94,72%	-94,18%	0,00%	0,116%	95,29%
IPCA	0,13%	2,22%	1,46%	2,37%	4,66%	7,65%	-	-	-

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

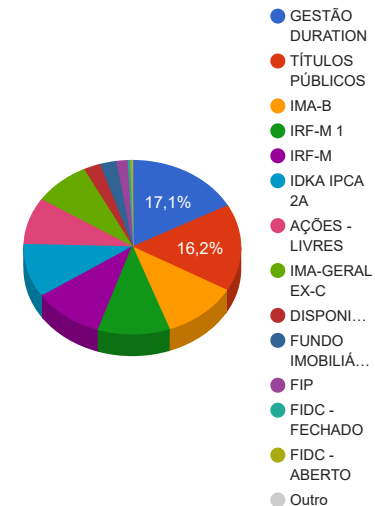
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,060%	0,96%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	0,131%	38,75%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	149.215.464,08	29,10%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	147.091.825,45	28,68%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	82.893.906,37	16,16%
Itaú Unibanco	43.288.163,67	8,44%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	22.729.686,38	4,43%
BEM DTVM	22.020.441,34	4,29%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	12.797.266,65	2,50%
BNP Paribas	8.284.709,63	1,62%
Orla DTVM	8.278.404,40	1,61%
PLANNER CORRETORA	7.423.932,37	1,45%
Foco DTVM	3.954.141,49	0,77%
Rio Bravo Investimentos	2.540.000,00	0,50%
FINAXIS Corretora	2.003.685,12	0,39%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	293.763,00	0,06%
Brasil Plural	16.804,53	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	87.793.235,59	17,12%
TÍTULOS PÚBLICOS	82.893.906,37	16,16%
IMA-B	57.595.933,27	11,23%
IRF-M 1	54.042.475,72	10,54%
IRF-M	53.570.986,72	10,45%
IDKA IPCA 2A	51.139.405,44	9,97%
AÇÕES - LIVRES	44.597.495,45	8,70%
IMA-GERAL EX-C	43.213.385,56	8,43%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	12.797.266,65	2,50%
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.555.508,76	2,45%
FIP	8.437.341,90	1,65%
FIDC - FECHADO	2.017.030,44	0,39%
FIDC - ABERTO	1.942.100,33	0,38%
MULTIMERCADO	232.663,07	0,05%



Carteira de Títulos Públicos - base (maio / 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	3.630,012478	992.130,00	2.722.509,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.630,012478	998.799,60	2.758.809,48
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.630,012478	1.000.585,27	2.795.109,61
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.630,012478	1.124.114,15	3.085.510,61
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.630,012478	1.006.644,67	2.722.509,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.630,012478	999.750,00	2.722.509,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.630,012478	1.487.280,45	3.993.013,73
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.630,012478	859.423,87	2.286.907,86
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.630,012478	136.416,48	363.001,25
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.630,012478	997.614,60	2.649.909,11
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.630,012478	1.479.584,78	3.993.013,73
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.630,012478	1.098.188,08	3.194.410,98
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.175,252968	895.805,83	2.546.904,31
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	4.175,252968	1.483.219,48	4.217.005,50
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	4.175,252968	1.732.870,29	4.926.798,50
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.175,252968	1.249.170,73	3.824.531,72
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.265,644274	1.411.663,50	3.775.095,18
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.265,644274	1.171.463,51	3.165.108,05
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.265,644274	798.050,50	2.132.822,14
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.265,644274	1.046.269,96	2.823.856,51
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.265,644274	960.617,17	2.559.386,56
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.265,644274	1.479.336,56	4.001.174,33

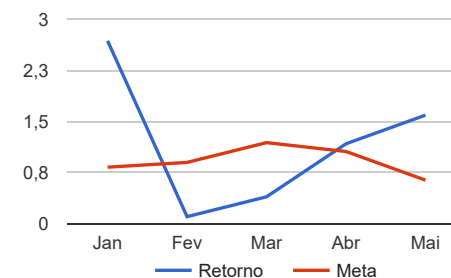
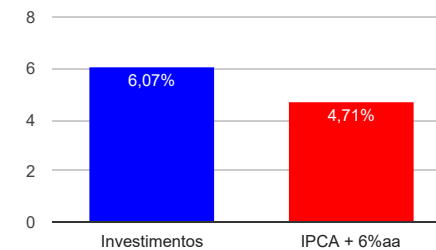
Carteira de Títulos Públicos - base (maio / 2019)

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	4.265,644274	798.050,50	2.132.822,14
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.265,644274	1.002.194,60	2.943.294,55
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.265,644274	258.043,50	767.815,97
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.265,644274	909.797,78	2.691.621,54
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.265,644274	429.654,20	1.279.693,28
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.265,644274	2.083.308,72	5.545.337,56
TDA - Título da Dívida Agrária	01/07/2019	27/02/2004	893	67,21931691	104,020000	60.026,85	92.889,86
TDA - Título da Dívida Agrária	01/12/2019	27/02/2004	1782	61,61359147	101,310000	109.795,42	180.534,42

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%
Acumulado no ano					28.727.475,26	6,07%	4,71%	129,03%	

Acumulado no Ano



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(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	43.327.734,31	0,00	0,00	44.505.071,92	1.177.337,61	2,72%	1,51%	2,72%
TÍTULOS PÚBLICOS	81.346.620,61	0,00	354.274,53	82.893.906,37	1.901.560,29	2,34%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.578.394,82	0,00	0,00	3.655.615,88	77.221,06	2,16%	1,24%	2,16%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.791.720,46	20.000.000,00	0,00	49.835.964,17	1.044.243,71	2,14%	2,16%	3,63%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.358.717,99	0,00	0,00	43.213.385,56	854.667,57	2,02%	1,10%	2,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	71.967.749,42	380.000,00	20.000.000,00	53.570.986,72	1.223.237,30	1,69%	1,02%	1,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	50.601.134,05	0,00	0,00	51.139.405,44	538.271,39	1,06%	0,63%	1,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	42.881.373,41	0,00	43.288.163,67	406.790,26	0,95%	0,98%	1,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	42.523.877,40	0,00	42.845.063,22	0,00	321.185,82	0,76%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.211.576,93	4.530.000,00	3.050.000,00	54.042.475,72	350.898,79	0,62%	0,10%	0,65%
BRA1 FI RENDA FIXA	2.441.016,15	0,00	0,00	2.448.025,12	7.008,97	0,29%	0,82%	0,29%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.651.730,43	0,00	0,00	1.656.328,10	4.597,67	0,28%	7,93%	0,28%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.936.992,34	0,00	0,00	1.942.100,33	5.107,99	0,26%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.008.808,51	0,00	0,00	2.003.685,12	-5.123,39	-0,26%	0,28%	-0,26%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	7.385,73	0,00	0,00	6.470,49	-915,24	-12,39%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	3.948,51	0,00	0,00	3.459,21	-489,30	-12,39%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	7.847,27	0,00	0,00	6.874,83	-972,44	-12,39%	-	-
Total Renda Fixa					7.904.628,06	1,85%	1,08%	

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(%)
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.064.552,26	0,00	0,00	10.343.515,45	278.963,19	2,77%	9,67%	2,77%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	2.488.120,00	0,00	17.000,00	2.540.000,00	68.880,00	2,77%	7,95%	2,79%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.291.891,25	0,00	0,00	7.423.932,37	132.041,12	1,81%	-	0,00%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.137.473,76	0,00	0,00	8.284.709,63	147.235,87	1,81%	8,43%	1,81%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	229.840,57	0,00	0,00	232.663,07	2.822,50	1,23%	0,12%	1,23%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	14.128.177,66	0,00	0,00	14.299.298,33	171.120,67	1,21%	8,02%	1,21%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.614.633,68	0,00	0,00	11.669.972,04	55.338,36	0,48%	9,14%	0,48%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.261.611,25	0,00	0,00	7.262.230,75	619,50	0,01%	0,06%	0,01%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.301.795,47	0,00	0,00	2.297.813,39	-3.982,08	-0,17%	25,17%	15,66%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	12.466.435,86	0,00	12.443.590,67	0,00	-22.845,19	-0,18%	7,93%	0,95%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	301.228,80	0,00	3.335,69	293.763,00	-4.130,11	-1,37%	5,33%	-2,55%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	7.114,92	0,00	0,00	6.953,85	-161,07	-2,26%	3,58%	-2,26%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.941.828,27	0,00	0,00	1.168.157,30	-773.670,97	-39,84%	0,13%	-0,25%
				Total Renda Variável	52.231,79	0,07%	8,07%	