

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			246.038,18	0,05%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			80.555.119,66	16,51%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.070.464,61	5,75%	525	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	69.160.189,40	14,17%	363	2,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	85.872.179,49	17,60%	1.263	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.461.666,87	10,14%	758	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	42.407.580,14	8,69%	362	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.535.491,10	0,72%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.654.534,86	0,34%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	41.936.946,03	8,59%	201	1,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	2.548.489,79	0,52%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	5.312,18	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	10.557,43	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	9.936,50	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.044.822,89	0,42%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.927.032,93	0,39%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	12.117.517,36	2,48%	2.670	9,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.040.800,31	1,65%	1.138	2,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	14.429.338,18	2,96%	6.087	1,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.785.073,28	2,42%	4.804	1,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	10.242.931,57	2,10%	172	11,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	224.322,30	0,05%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2019)

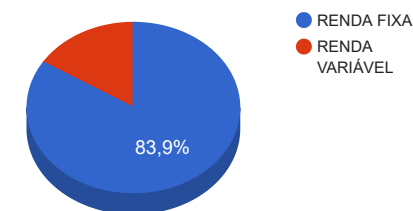
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.270.173,70	1,49%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.941.828,27	0,40%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	179.418,04	0,04%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.313.366,98	0,47%		5,54%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.259.259,42	1,49%		11,19%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	2.380.000,00	0,49%		0,46%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	S/Info	Não se aplica	331.903,50	0,07%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	487.962.294,97				

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

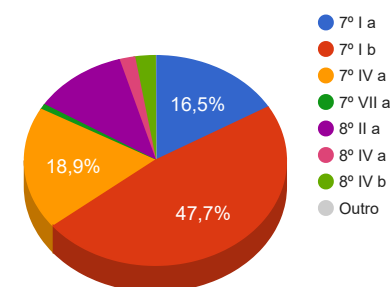
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	80.555.119,66	16,51%	17,00%	85,00%	90,00%	358.610.945,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	232.564.500,37	47,66%	0,00%	0,00%	50,00%	11.416.647,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	92.083.041,92	18,87%	0,00%	0,00%	20,00%	5.509.417,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.997.661,93	0,82%	0,00%	0,00%	2,00%	5.761.583,97
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	10,00%	48.796.229,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	56.615.660,70	11,60%	5,00%	8,00%	15,00%	16.578.683,55
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	224.322,30	0,05%	0,00%	0,00%	3,00%	14.414.546,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	9.391.420,01	1,92%	0,00%	0,00%	3,00%	5.247.448,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	12.284.529,90	2,52%	0,00%	0,00%	3,00%	2.354.338,95
Total Carteira		487.716.256,79					

RENDA FIXA	409.446.362,06	83,95%
RENDA VARIÁVEL	78.515.932,91	16,10%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	80.555.119,66	16,51%	17,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	232.564.500,37	47,66%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	92.083.041,92	18,87%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.997.661,93	0,82%	0,00%	2,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	56.615.660,70	11,60%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	224.322,30	0,05%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	9.391.420,01	1,92%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	12.284.529,90	2,52%	0,00%	3,00%
Total Renda Fixa	487.716.256,79	99,95%	22,00	206,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 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	161.029.436,41	33,00%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	126.060.161,46	25,83%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	80.555.119,66	16,51%	-
ITAÚ UNIBANCO	41.936.946,03	8,59%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	26.214.411,46	5,37%	0,08%
Queluz Gestão de Recursos	20.050.680,78	4,11%	409,61%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.040.800,31	1,65%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.295.979,81	1,50%	0,06%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.686.846,33	1,17%	0,88%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.380.000,00	0,49%	0,15%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	2.313.366,98	0,47%	15,21%
FINAXIS CORRETORA	2.044.822,89	0,42%	-
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.941.828,27	0,40%	5,82%
ROMA ASSET	1.654.534,86	0,34%	0,37%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	331.903,50	0,07%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
VALORA INVESTIMENTOS	179.418,04	0,04%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	4,37%	4,37%	7,05%	14,01%	14,11%	30,65%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,36%	4,36%	7,01%	13,86%	13,82%	30,01%	0,20%	1,735%	5,46%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3,20%	3,20%	4,61%	-18,80%	-	-28,98%	0,00%	1,339%	-
BRA1 FI RENDA FIXA	0,67%	0,67%	1,65%	4,36%	10,14%	12,56%	1,30%	0,483%	1,64%
IMA-B 5	1,54%	1,54%	3,07%	6,93%	10,09%	24,15%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,75%	-0,75%	3,44%	5,73%	11,63%	27,26%	1,30%	1,122%	7,62%
IRF-M	1,39%	1,39%	3,96%	8,08%	10,83%	26,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,35%	1,35%	3,87%	7,97%	10,69%	25,91%	0,20%	1,024%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	1,26%	1,26%	2,71%	6,23%	10,29%	24,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	1,27%	2,57%	5,93%	9,64%	23,04%	0,20%	0,592%	2,36%
IPCA + 7,00% ao ano	0,91%	0,91%	1,94%	4,58%	10,98%	22,04%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,85%	0,85%	2,87%	1.854,54%	1.263,34%	-54,29%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,67%	0,67%	1,25%	3,15%	8,01%	15,59%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,14%	-0,14%	-0,54%	-1,35%	-7,88%	-11,05%	0,15%	0,026%	2,78%
120% do CDI	0,65%	0,65%	1,85%	3,79%	7,70%	19,94%	-	-	-
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 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	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,58%	0,58%	1,69%	3,70%	6,96%	18,04%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	0,58%	1,64%	3,60%	6,75%	17,55%	0,10%	0,109%	0,55%
IPCA	0,32%	0,32%	0,26%	1,10%	3,78%	6,74%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,88%	2,88%	4,64%	7,26%	9,82%	21,96%	0,002	1,382%	2,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2,37%	2,37%	4,69%	6,05%	9,18%	22,45%	0,40%	1,127%	1,50%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

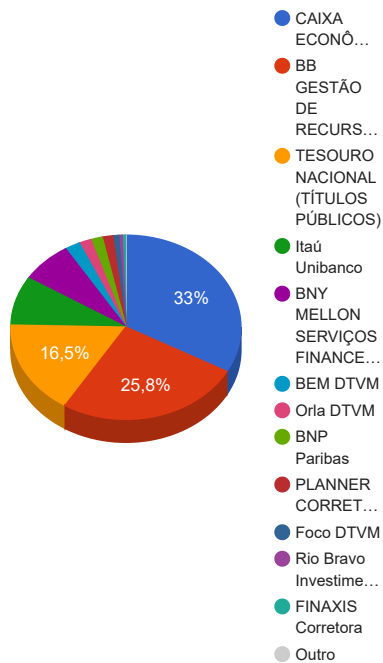
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ICON	12,31%	12,31%	16,71%	16,51%	0,19%	30,90%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	12,00%	12,00%	15,80%	15,39%	-1,10%	27,21%	1,00%	7,556%	20,00%
Ibovespa	10,82%	10,82%	11,40%	22,94%	14,70%	50,60%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,68%	14,68%	21,87%	19,12%	15,24%	30,23%	2,00%	6,992%	17,63%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,42%	7,42%	8,85%	20,48%	19,05%	57,04%	2,00%	8,132%	22,12%
IBX	10,71%	10,71%	12,20%	23,89%	15,39%	52,03%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	9,91%	9,91%	13,08%	22,30%	17,68%	46,34%	2,00%	6,741%	18,92%
SMLL	9,41%	9,41%	17,06%	23,72%	13,39%	58,58%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6,46%	6,46%	17,04%	27,41%	23,25%	71,41%	2,00%	7,445%	20,49%
IFIX	2,47%	2,47%	7,46%	11,85%	5,45%	24,55%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	15,38%	15,38%	12,50%	11,11%	5,88%	-10,91%	1,50%	24,694%	41,15%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	-0,83%	-0,83%	8,18%	16,67%	-6,52%	-8,46%	0,35%	2,687%	14,37%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-1,12%	-1,12%	2,25%	14,63%	-2,90%	6,29%	0,25%	5,215%	17,26%
IPCA + 11,00% ao ano	1,24%	1,24%	2,87%	6,52%	15,10%	31,24%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	0,000%	41,45%
CDI	0,54%	0,54%	1,54%	3,15%	6,38%	16,36%	-	-	-

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

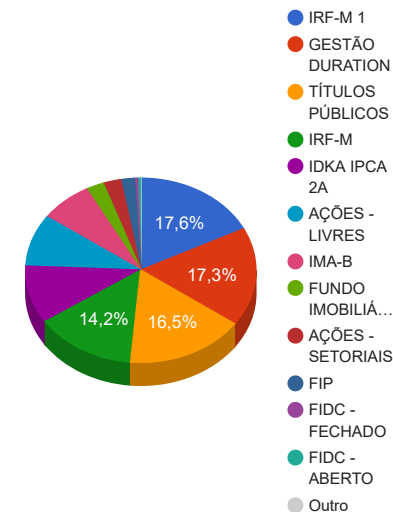
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,14%	0,14%	2,69%	-94,91%	-94,75%	-94,17%	0,00%	0,206%	95,48%
IPCA	0,32%	0,32%	0,26%	1,10%	3,78%	6,74%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	1,535%	0,96%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	161.029.436,41	33,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	126.060.161,46	25,83%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	80.555.119,66	16,51%
Itaú Unibanco	41.936.946,03	8,59%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	35.426.413,43	7,26%
BEM DTVM	10.422.349,61	2,14%
Orla DTVM	8.235.336,12	1,69%
BNP Paribas	8.040.800,31	1,65%
PLANNER CORRETORA	7.259.259,42	1,49%
Foco DTVM	3.967.901,84	0,81%
Rio Bravo Investimentos	2.380.000,00	0,49%
FINAXIS Corretora	2.044.822,89	0,42%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	331.903,50	0,07%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	246.038,18	0,05%
Brasil Plural	25.806,11	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	85.872.179,49	17,60%
GESTÃO DURATION	84.344.526,17	17,29%
TÍTULOS PÚBLICOS	80.555.119,66	16,51%
IRF-M	69.160.189,40	14,17%
IDKA IPCA 2A	49.461.666,87	10,14%
AÇÕES - LIVRES	44.498.143,34	9,12%
IMA-B	35.808.980,36	7,34%
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.284.529,90	2,52%
AÇÕES - SETORIAIS	12.117.517,36	2,48%
FIP	9.391.420,01	1,92%
FIDC - FECHADO	2.070.629,00	0,42%
FIDC - ABERTO	1.927.032,93	0,39%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	246.038,18	0,05%
MULTIMERCADO	224.322,30	0,05%



Carteira de Títulos Públicos - base (janeiro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.550,339063	992.130,00	2.662.754,30	1.670.624,30
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.550,339063	998.799,60	2.698.257,69	1.699.458,09
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.550,339063	1.000.585,27	2.733.761,08	1.733.175,81
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.550,339063	1.124.114,15	3.017.788,20	1.893.674,05
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.550,339063	1.006.644,67	2.662.754,30	1.656.109,63
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.550,339063	999.750,00	2.662.754,30	1.663.004,30
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.550,339063	1.487.280,45	3.905.372,97	2.418.092,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.550,339063	859.423,87	2.236.713,61	1.377.289,74
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.550,339063	136.416,48	355.033,91	218.617,43
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.550,339063	997.614,60	2.591.747,52	1.594.132,92
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.550,339063	1.479.584,78	3.905.372,97	2.425.788,19
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.550,339063	1.098.188,08	3.124.298,38	2.026.110,30
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	3.925,930904	895.805,83	2.394.817,85	1.499.012,02
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	3.925,930904	1.483.219,48	3.965.190,21	2.481.970,73
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	3.925,930904	1.732.870,29	4.632.598,47	2.899.728,18
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	3.925,930904	1.249.170,73	3.596.152,71	2.346.981,98
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.180,348359	1.411.663,50	3.699.608,30	2.287.944,80
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.180,348359	1.171.463,51	3.101.818,48	1.930.354,97
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.180,348359	798.050,50	2.090.174,18	1.292.123,68
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.180,348359	1.046.269,96	2.767.390,61	1.721.120,65
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.180,348359	960.617,17	2.508.209,02	1.547.591,85
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.180,348359	1.479.336,56	3.921.166,76	2.441.830,20

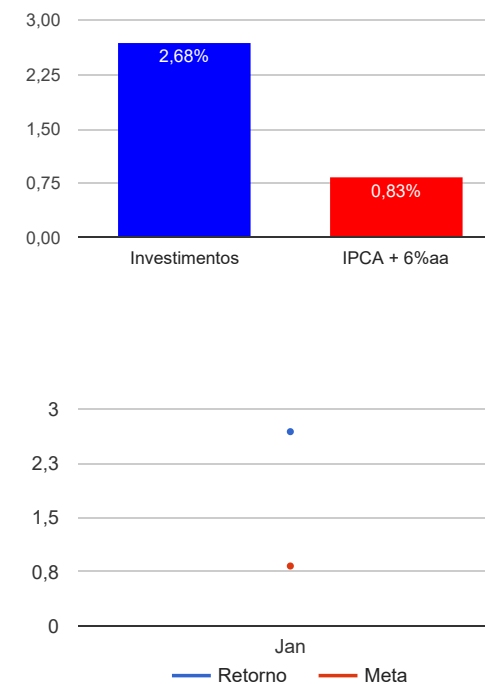
Carteira de Títulos Públicos - base (janeiro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.180,348359	798.050,50	2.090.174,18	1.292.123,68
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.180,348359	1.002.194,60	2.884.440,37	1.882.245,77
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.180,348359	258.043,50	752.462,70	494.419,20
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.180,348359	909.797,78	2.637.799,81	1.728.002,03
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.180,348359	429.654,20	1.254.104,51	824.450,31
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.180,348359	2.083.308,72	5.434.452,87	3.351.144,15
TDA - Título da Dívida Agrária	01/07/2019	27/02/2004	893	67,21931691	101,960000	60.026,85	91.050,28	31.023,43
TDA - Título da Dívida Agrária	01/12/2019	27/02/2004	1782	61,61359147	99,270000	109.795,42	176.899,14	67.103,72

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%
Acumulado no ano					12.614.747,35	2,68%	0,83%	322,82%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 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	26.898.744,55	0,00	0,00	28.070.464,61	1.171.720,06	4,36%	1,73%	4,36%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.425.702,04	0,00	0,00	3.535.491,10	109.789,06	3,20%	1,34%	3,20%
TÍTULOS PÚBLICOS	78.260.604,70	0,00	0,00	80.555.119,66	2.294.514,96	2,93%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	41.220.067,43	0,00	0,00	42.407.580,14	1.187.512,71	2,88%	1,38%	2,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	40.964.785,32	0,00	0,00	41.936.946,03	972.160,71	2,37%	1,13%	2,37%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	68.238.573,38	0,00	0,00	69.160.189,40	921.616,02	1,35%	1,02%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.843.314,34	0,00	0,00	49.461.666,87	618.352,53	1,27%	0,59%	1,27%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.911.302,44	0,00	0,00	1.927.032,93	15.730,49	0,82%	-	-
BRA1 FI RENDA FIXA	2.531.471,30	0,00	0,00	2.548.489,79	17.018,49	0,67%	0,48%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	83.376.988,22	4.900.000,00	2.900.000,00	85.872.179,49	495.191,27	0,56%	0,11%	0,58%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.047.707,67	0,00	0,00	2.044.822,89	-2.884,78	-0,14%	0,03%	-0,14%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.666.994,26	0,00	0,00	1.654.534,86	-12.459,40	-0,75%	1,12%	-0,75%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	10.743,75	0,00	0,00	9.936,50	-807,25	-7,51%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	11.415,13	0,00	0,00	10.557,43	-857,70	-7,51%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	5.743,75	0,00	0,00	5.312,18	-431,57	-7,51%	-	-
Total Renda Fixa					7.786.165,60	1,94%	0,83%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.011.303,99	0,00	0,00	8.040.800,31	1.029.496,32	14,68%	6,99%	14,68%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	10.818.902,99	0,00	0,00	12.117.517,36	1.298.614,37	12,00%	7,56%	12,00%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	9.319.705,47	0,00	0,00	10.242.931,57	923.226,10	9,91%	6,74%	9,91%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.970.940,68	0,00	0,00	11.785.073,28	814.132,60	7,42%	8,13%	7,42%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.554.329,24	0,00	0,00	14.429.338,18	875.008,94	6,46%	7,45%	6,46%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.127.731,81	0,00	0,00	7.259.259,42	131.527,61	1,85%	-	0,78%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.203.666,95	0,00	0,00	7.270.173,70	66.506,75	0,92%	1,54%	0,92%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	224.008,44	0,00	0,00	224.322,30	313,86	0,14%	0,21%	0,14%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.941.828,27	0,00	0,00	1.941.828,27	0,00	0,00%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	179.642,81	0,00	0,00	179.418,04	-224,77	-0,13%	0,00%	-0,13%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.317.542,08	0,00	0,00	2.313.366,98	-4.175,10	-0,18%	24,69%	-0,00%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	2.399.980,00	0,00	14.000,00	2.380.000,00	-5.980,00	-0,25%	2,69%	1,67%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	335.668,86	0,00	1.136,10	331.903,50	-2.629,26	-0,78%	5,21%	-0,66%
Total Renda Variável					5.125.817,42	6,98%	7,16%	