

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2019



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

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			85.104.026,37	15,83%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	44.638.073,46	8,30%	542	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	56.344.515,95	10,48%	417	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	52.127.750,00	9,70%	671	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	52.289.886,23	9,73%	940	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	46.168.346,93	8,59%	630	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.715.001,97	9,62%	1.214	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.291.511,23	0,24%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	1.364.249,71	0,25%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	44.953.446,51	8,36%	271	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.740.632,97	0,70%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	4.319,73	0,00%	2	5,38%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.873.474,31	0,35%	98	4,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	2.309,38	0,00%	5	2,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.961.033,81	0,36%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	4.589,67	0,00%	11	2,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	15.731.753,88	2,93%	5.273	1,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	11.540.388,80	2,15%	1.719	4,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	25.482.729,31	4,74%	46.226	0,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	20.044.345,52	3,73%	7.880	1,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	229.744,06	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.284.078,30	1,36%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

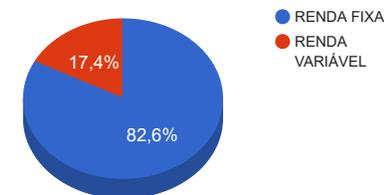
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.039,96	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.162.310,30	0,22%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.200.745,34	1,34%		10,45%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	2.529.800,00	0,47%		4,94%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	S/Info	Não se aplica	306.422,40	0,06%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.993.134,69	0,37%		4,32%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			537.089.660,79				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			395.737,05				Artigo 6º
Total			537.485.397,84				

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

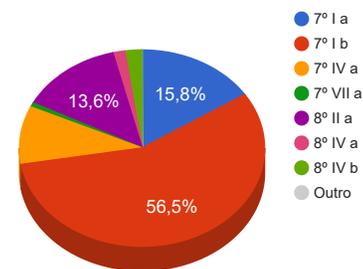
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	85.104.026,37	15,85%	0,00%	15,00%	100,00%	451.985.634,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	303.283.574,54	56,47%	0,00%	49,00%	100,00%	233.806.086,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	51.349.840,42	9,56%	0,00%	16,50%	40,00%	163.486.023,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.845.726,90	0,72%	0,00%	0,50%	2,00%	6.896.066,32
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	161.126.898,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	161.126.898,24
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	72.799.217,51	13,55%	0,00%	12,40%	20,00%	34.618.714,65
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	229.744,06	0,04%	0,00%	0,10%	3,00%	15.882.945,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.447.428,56	1,57%	0,00%	1,50%	3,00%	7.665.261,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	12.030.102,43	2,24%	0,00%	1,00%	3,00%	4.082.587,39
Total Carteira		537.089.660,79					

RENDA FIXA	443.978.905,28	82,66%
RENDA VARIÁVEL	93.506.492,56	17,41%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	85.104.026,37	15,83%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	303.283.574,54	56,43%	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 "	51.349.840,42	9,55%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.845.726,90	0,72%	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 "	72.799.217,51	13,54%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	229.744,06	0,04%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.447.428,56	1,57%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	12.030.102,43	2,24%	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	537.089.660,79	99,93%	5,00	449,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 2019)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	154.802.749,11	28,80%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	148.480.825,43	27,63%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	85.104.026,37	15,83%	-
ITAÚ UNIBANCO	70.436.175,82	13,10%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	35.776.099,40	6,66%	0,10%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	11.540.388,80	2,15%	0,02%
Queluz Gestão de Recursos	8.564.995,05	1,59%	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.295.297,08	1,36%	0,04%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.931.410,84	1,10%	3,63%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.529.800,00	0,47%	0,25%
Reditus Investimentos	1.993.134,69	0,37%	-
PETRA Capital	1.873.474,31	0,35%	0,03%
Veritas Capital Management	1.291.511,23	0,24%	0,09%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.162.310,30	0,22%	5,42%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	306.422,40	0,06%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
VALORA INVESTIMENTOS	1.039,96	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	0,70%	7,27%	2,05%	5,27%	10,58%	23,22%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	2,60%	0,97%	1,71%	4,66%	1,32%	0,00%	-	-
120% do CDI	0,60%	5,04%	1,86%	3,74%	7,58%	16,46%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-8,35%	-59,79%	-33,24%	-52,85%	-69,98%	-85,96%	0,00%	-	10,53%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-8,36%	-59,79%	-33,24%	-52,85%	-69,98%	-86,71%	0,00%	-	10,53%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-8,36%	-59,79%	-33,24%	-52,85%	-69,98%	-87,50%	0,00%	-	10,53%
IRF-M 1	0,55%	4,63%	1,86%	3,55%	7,40%	14,81%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	4,47%	1,80%	3,42%	7,19%	14,31%	0,10%	0,181%	0,47%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,46%	5,33%	1,33%	3,84%	7,63%	16,72%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,18%	-8,51%	-6,50%	-8,23%	-9,37%	-14,41%	0,15%	0,055%	49,05%
IRF-M	0,26%	8,42%	3,54%	6,63%	16,67%	23,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,20%	8,15%	3,46%	6,42%	16,48%	23,01%	0,20%	1,066%	3,46%
IMA Geral ex-C	0,17%	8,94%	3,09%	6,43%	15,60%	22,43%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	9,42%	3,30%	6,85%	16,13%	22,79%	0,30%	1,176%	3,39%
IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	9,73%	3,85%	6,83%	13,26%	21,71%	0,40%	0,534%	2,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	12,00%	3,74%	8,33%	16,60%	23,55%	0,002	1,744%	3,51%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,10%	7,06%	2,25%	5,13%	11,98%	20,25%	0,20%	0,743%	1,87%
IMA-B 5	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,23%	-22,52%	-22,03%	-22,25%	-17,84%	-9,23%	1,30%	11,486%	19,27%
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
BRA1 FI RENDA FIXA	0,12%	-46,11%	-44,27%	-46,68%	-44,37%	-35,39%	1,30%	1,022%	45,03%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,16%	9,19%	2,33%	5,80%	15,46%	-	0,00%	1,185%	5,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,42%	16,02%	4,60%	10,63%	27,17%	32,66%	0,20%	2,459%	7,66%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

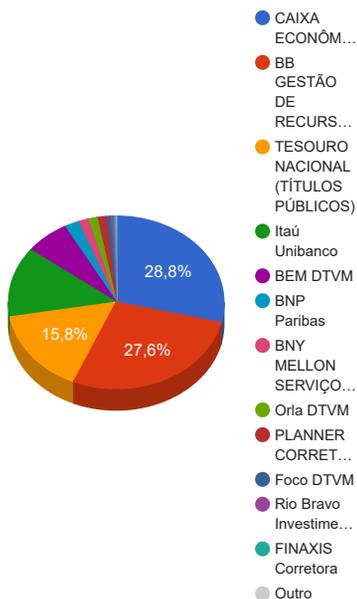
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 11,00% ao ano	1,03%	9,92%	3,00%	7,22%	14,66%	32,50%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	0,094%	120,65%
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,86%	2,56%	-1,25%	1,72%	3,65%	-94,42%	0,00%	0,043%	4,14%
SMLL	0,48%	27,92%	14,76%	19,08%	51,06%	47,54%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,93%	24,20%	17,73%	20,13%	55,93%	67,83%	2,00%	12,993%	17,25%
IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,609%	0,99%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,57%	24,51%	12,99%	14,33%	46,36%	62,65%	1,90%	11,003%	14,23%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,07%	15,42%	8,51%	10,06%	35,58%	56,42%	2,00%	12,906%	13,81%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-1,71%	22,31%	3,51%	7,59%	39,75%	28,68%	2,00%	9,419%	17,26%
IFIX	-0,11%	12,97%	4,07%	9,12%	24,18%	27,48%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-2,08%	20,51%	-2,08%	13,25%	33,72%	5,62%	1,50%	3,348%	26,74%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-2,81%	-8,71%	4,39%	-10,35%	4,02%	3,74%	0,25%	5,783%	11,81%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	-10,29%	-89,46%	-90,04%	-89,18%	-87,33%	-89,82%	0,35%	5,810%	15,41%

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

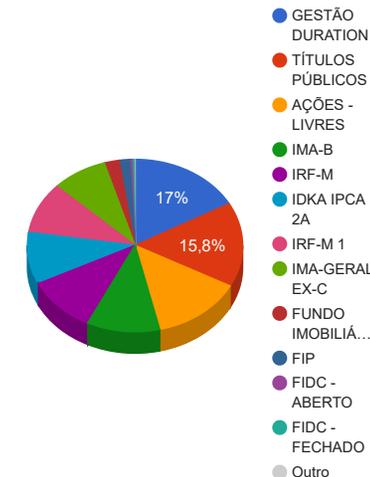
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	0,017%	0,10%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	154.802.749,11	28,80%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	148.480.825,43	27,63%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	85.104.026,37	15,83%
Itaú Unibanco	70.436.175,82	13,10%
BEM DTVM	35.777.139,36	6,66%
BNP Paribas	11.540.388,80	2,15%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	8.446.388,60	1,57%
Orla DTVM	7.295.660,55	1,36%
PLANNER CORRETORA	7.200.745,34	1,34%
Foco DTVM	3.284.645,92	0,61%
Rio Bravo Investimentos	2.529.800,00	0,47%
FINAXIS Corretora	1.873.474,31	0,35%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	395.737,05	0,07%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	306.422,40	0,06%
Brasil Plural	11.218,78	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	91.121.793,44	16,95%
TÍTULOS PÚBLICOS	85.104.026,37	15,83%
AÇÕES - LIVRES	72.799.217,51	13,54%
IMA-B	58.524.143,91	10,89%
IRF-M	56.344.515,95	10,48%
IDKA IPCA 2A	52.289.886,23	9,73%
IRF-M 1	51.715.001,97	9,62%
IMA-GERAL EX-C	44.638.073,46	8,30%
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.030.102,43	2,24%
FIP	8.447.428,56	1,57%
FIDC - ABERTO	1.961.033,81	0,36%
FIDC - FECHADO	1.884.693,09	0,35%
DISP. FINANCEIRA	395.737,05	0,07%
MULTIMERCADO	229.744,06	0,04%



Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 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	3.682,205365	992.130,00	2.761.654,02
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.682,205365	998.799,60	2.798.476,08
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.682,205365	1.000.585,27	2.835.298,13
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.682,205365	1.124.114,15	3.129.874,56
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.682,205365	1.006.644,67	2.761.654,02
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.682,205365	999.750,00	2.761.654,02
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.682,205365	1.487.280,45	4.050.425,90
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.682,205365	859.423,87	2.319.789,38
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.682,205365	136.416,48	368.220,54
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.682,205365	997.614,60	2.688.009,92
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.682,205365	1.479.584,78	4.050.425,90
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.682,205365	1.098.188,08	3.240.340,72
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.440,589288	895.805,83	2.708.759,47
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	4.440,589288	1.483.219,48	4.484.995,18
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	4.440,589288	1.732.870,29	5.239.895,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.440,589288	1.249.170,73	4.067.579,79
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.370,995103	1.411.663,50	3.868.330,67
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.370,995103	1.171.463,51	3.243.278,37
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.370,995103	798.050,50	2.185.497,55
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.370,995103	1.046.269,96	2.893.598,76
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.370,995103	960.617,17	2.622.597,06
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.370,995103	1.479.336,56	4.099.993,41

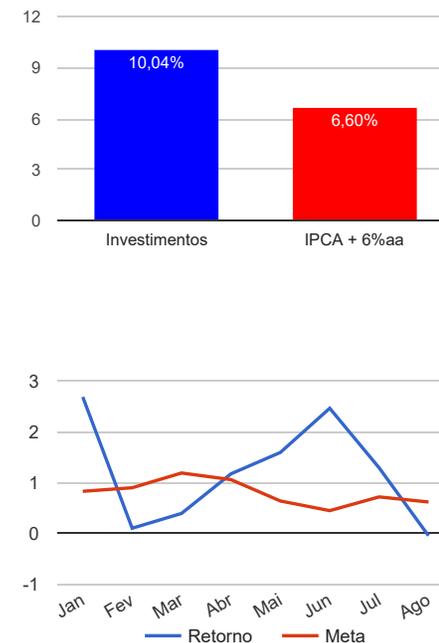
Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 2019)

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	4.370,995103	798.050,50	2.185.497,55
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.370,995103	1.002.194,60	3.015.986,62
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.370,995103	258.043,50	786.779,12
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.370,995103	909.797,78	2.758.097,91
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.370,995103	429.654,20	1.311.298,53
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.370,995103	2.083.308,72	5.682.293,63
TDA - Título da Dívida Agrária	01/12/2019	27/02/2004	1782	61,61359147	103,10	109.795,42	183.724,20

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%
Acumulado no ano					47.738.048,45	10,04%	6,60%	152,22%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.744.526,58	4.710.000,00	6.010.000,00	51.715.001,97	270.475,39	0,47%	0,18%	0,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	44.811.455,14	0,00	0,00	44.953.446,51	141.991,37	0,32%	0,53%	0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	55.316.296,02	920.000,00	0,00	56.344.515,95	108.219,93	0,19%	1,07%	0,20%
BRA1 FI RENDA FIXA	1.362.638,73	0,00	0,00	1.364.249,71	1.610,98	0,12%	1,02%	0,12%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.237.632,81	0,00	0,00	52.289.886,23	52.253,42	0,10%	0,74%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.600.280,06	0,00	0,00	44.638.073,46	37.793,40	0,08%	1,18%	0,08%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.960.469,05	0,00	0,00	1.961.033,81	564,76	0,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	46.228.214,42	0,00	0,00	46.168.346,93	-59.867,49	-0,13%	1,74%	-0,13%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.746.643,55	0,00	0,00	3.740.632,97	-6.010,58	-0,16%	1,18%	-0,18%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.876.857,00	0,00	0,00	1.873.474,31	-3.382,69	-0,18%	0,06%	-0,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.345.161,13	0,00	0,00	52.127.750,00	-217.411,13	-0,42%	2,46%	-0,42%
TÍTULOS PÚBLICOS	86.384.417,63	0,00	877.133,68	85.104.026,37	-403.257,58	-0,47%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.348.571,24	0,00	0,00	1.291.511,23	-57.060,01	-4,23%	11,49%	-4,23%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	4.713,30	0,00	0,00	4.319,73	-393,57	-8,35%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	2.519,79	0,00	0,00	2.309,38	-210,41	-8,35%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	5.007,84	0,00	0,00	4.589,67	-418,17	-8,35%	-	-
				Total Renda Fixa	-135.102,38	-0,03%	1,16%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	18.709.674,35	1.000.000,00	0,00	20.044.345,52	334.671,17	1,70%	12,99%	1,93%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	25.089.955,92	0,00	0,00	25.482.729,31	392.773,39	1,57%	11,00%	1,57%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.606.932,54	1.000.000,00	0,00	15.731.753,88	124.821,34	0,80%	12,91%	1,07%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.258.166,20	0,00	0,00	7.284.078,30	25.912,10	0,36%	0,61%	0,36%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.164.245,51	0,00	0,00	1.162.310,30	-1.935,21	-0,17%	0,02%	-0,17%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	231.731,00	0,00	0,00	229.744,06	-1.986,94	-0,86%	0,04%	-0,86%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	10.757.348,76	1.000.000,00	0,00	11.540.388,80	-216.959,96	-1,85%	9,42%	-1,71%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	314.797,08	0,00	1.298,40	306.422,40	-7.076,28	-2,25%	5,78%	-2,81%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.044.570,44	0,00	0,00	1.993.134,69	-51.435,75	-2,52%	3,35%	-2,08%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	1.069,52	0,00	0,00	1.039,96	-29,56	-2,76%	0,09%	-2,77%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.581.908,26	0,00	0,00	7.200.745,34	-381.162,92	-5,03%	-	0,00%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	2.820.000,00	0,00	18.000,00	2.529.800,00	-272.200,00	-9,65%	5,81%	-10,29%
Total Renda Variável					-54.608,62	-0,06%	10,20%	