

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			88.023.484,60	15,70%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	55.410.128,26	9,88%	689	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.653.575,88	9,75%	943	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	47.952.709,09	8,55%	668	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.267.569,06	9,32%	1.208	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	46.122.205,34	8,22%	564	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	58.114.596,40	10,36%	442	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	45.530.204,71	8,12%	287	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.853.048,49	0,69%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.269.598,79	0,23%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	1.390.056,14	0,25%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	3.086,69	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	1.553,13	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	2.905,14	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.867.578,60	0,33%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.938.489,98	0,35%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	26.983.096,00	4,81%	57.442	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	18.480.270,37	3,30%	7.115	2,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	14.550.392,73	2,59%	1.934	5,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	20.928.736,19	3,73%	7.601	1,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	225.710,61	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.279.483,25	1,30%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2019)

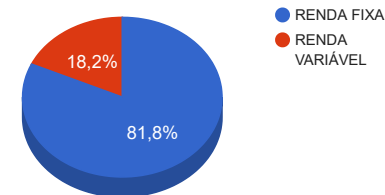
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	966,78	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.156.730,94	0,21%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.376.176,83	1,32%		26,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se aplica	Não se aplica	2.814.000,00	0,50%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	S/Info	Não se aplica	300.190,08	0,05%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.986.406,29	0,35%		5,19%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			560.482.950,37				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			314.617,30				Artigo 6º
Total			560.797.567,67				

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

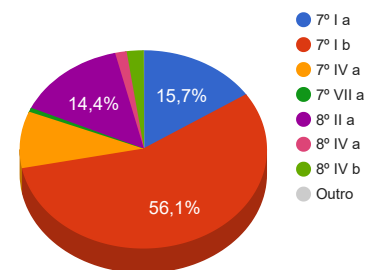
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	88.023.484,60	15,70%	0,00%	15,00%	100,00%	472.459.465,77
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	314.520.784,03	56,12%	0,00%	49,00%	100,00%	245.962.166,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	52.042.908,13	9,29%	0,00%	16,50%	40,00%	172.150.272,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.813.613,54	0,68%	0,00%	0,50%	2,00%	7.396.045,47
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	168.144.885,11
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	168.144.885,11
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	80.942.495,29	14,44%	0,00%	12,40%	20,00%	31.154.094,78
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	225.710,61	0,04%	0,00%	0,10%	3,00%	16.588.777,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.437.180,97	1,51%	0,00%	1,50%	3,00%	8.377.307,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	12.476.773,20	2,23%	0,00%	1,00%	3,00%	4.337.715,31
Total Carteira		560.482.950,37					

RENDA FIXA	458.715.407,60	81,84%
RENDA VARIÁVEL	102.082.160,07	18,21%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	88.023.484,60	15,70%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	314.520.784,03	56,08%	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 "	52.042.908,13	9,28%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.813.613,54	0,68%	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 "	80.942.495,29	14,43%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	225.710,61	0,04%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.437.180,97	1,50%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	12.476.773,20	2,22%	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	560.482.950,37	99,94%	5,00	449,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	160.720.881,37	28,66%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	153.799.902,66	27,43%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	88.023.484,60	15,70%	-
ITAÚ UNIBANCO	72.513.300,71	12,93%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	39.409.006,56	7,03%	0,11%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	14.550.392,73	2,59%	0,03%
Queluz Gestão de Recursos	8.766.232,97	1,56%	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.287.028,21	1,30%	0,05%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	6.017.249,08	1,07%	2,79%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.814.000,00	0,50%	0,14%
Reditus Investimentos	1.986.406,29	0,35%	-
PETRA Capital	1.867.578,60	0,33%	0,03%
Veritas Capital Management	1.269.598,79	0,23%	0,07%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.156.730,94	0,21%	5,42%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	300.190,08	0,05%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
VALORA INVESTIMENTOS	966,78	0,00%	0,00%%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,36%	23,57%	5,89%	15,34%	26,74%	39,79%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,35%	23,33%	5,86%	15,22%	26,46%	39,10%	0,20%	1,930%	5,32%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1,35%	12,47%	2,84%	7,68%	14,01%	-	0,00%	0,761%	3,36%
BRA1 FI RENDA FIXA	0,89%	-45,09%	2,01%	-43,05%	-44,55%	-37,20%	1,30%	0,516%	44,97%
IRF-M	1,70%	11,85%	3,43%	8,70%	14,69%	25,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,69%	11,55%	3,34%	8,55%	14,32%	25,07%	0,20%	0,960%	2,15%
IMA Geral ex-C	1,69%	12,40%	3,35%	8,30%	14,62%	24,51%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	13,06%	3,41%	8,88%	15,25%	25,21%	0,30%	0,927%	2,43%
IMA-B 5	1,65%	12,09%	3,47%	7,74%	13,78%	24,36%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,10%	-23,84%	-5,86%	-23,14%	-20,62%	-12,55%	1,30%	6,396%	18,96%
IDKA IPCA 2 Anos	1,23%	10,48%	2,93%	6,70%	12,06%	22,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	9,97%	2,82%	6,15%	11,39%	21,52%	0,20%	0,763%	1,54%
IPCA + 7,00% ao ano	0,72%	8,61%	1,96%	4,07%	9,71%	22,68%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,23%	1,42%	-1,12%	0,08%	3,46%	-1,65%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,62%	5,96%	1,83%	3,85%	7,13%	14,70%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	5,75%	1,75%	3,71%	6,87%	14,19%	0,10%	0,149%	0,27%
120% do CDI	0,58%	6,23%	1,74%	3,69%	7,49%	15,99%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-16,35%	-72,96%	-38,37%	-	-77,01%	-92,07%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-16,35%	-72,96%	-38,36%	-	-77,01%	-91,09%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-16,35%	-72,96%	-38,37%	-	-77,01%	-91,57%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,47%	6,13%	1,22%	2,59%	6,74%	16,16%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-8,80%	-0,49%	-7,03%	-9,16%	-14,18%	0,15%	0,025%	6,04%
IPCA	0,10%	2,60%	0,17%	0,50%	2,54%	7,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,71%	16,33%	3,73%	10,67%	18,32%	26,77%	0,002	1,122%	3,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,50%	11,14%	1,60%	7,07%	13,66%	21,39%	0,40%	0,049%	2,74%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

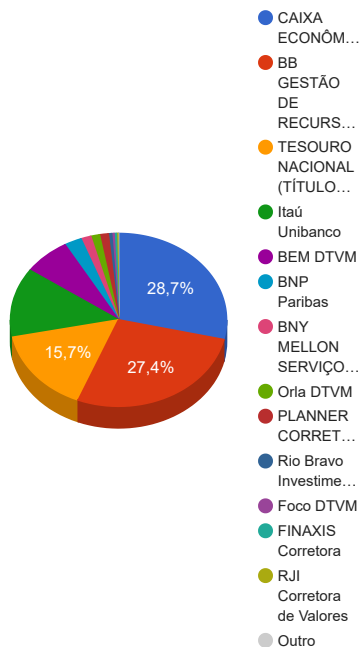
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	4,01%	18,73%	4,98%	11,30%	24,51%	25,41%	-	-	-
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	10,35%	-88,27%	-0,21%	-88,61%	-87,21%	-88,90%	0,35%	4,577%	14,24%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	1,85%	-10,57%	-4,79%	-0,34%	-7,52%	-8,44%	0,25%	4,406%	10,86%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-17,02%	-0,01%	-18,75%	-6,03%	-2,50%	-8,24%	1,50%	32,231%	30,31%
lbovespa	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2,62%	32,29%	6,32%	13,99%	40,58%	36,21%	2,00%	6,999%	15,12%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,38%	31,84%	7,55%	21,58%	35,76%	63,60%	1,90%	7,006%	11,76%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2,27%	20,34%	5,38%	13,67%	21,94%	52,87%	2,00%	7,847%	8,63%
SMLL	2,28%	33,56%	4,91%	22,18%	42,89%	50,82%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3,63%	29,68%	6,42%	24,41%	42,57%	65,28%	2,00%	7,161%	12,07%
IPCA + 11,00% ao ano	1,06%	12,01%	2,95%	6,06%	13,81%	31,98%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-4,44%	-99,46%	-9,61%	-86,41%	-99,47%	-99,69%	1,20%	2,164%	119,77%
CDI	0,48%	5,16%	1,45%	3,06%	6,20%	13,16%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,92%	0,76%	-2,60%	-1,80%	3,33%	-94,61%	0,00%	2,237%	3,16%
IPCA	0,10%	2,60%	0,17%	0,50%	2,54%	7,21%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	1,05%	0,29%	0,25%	0,98%	-20,46%	0,30%	0,005%	1,00%

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

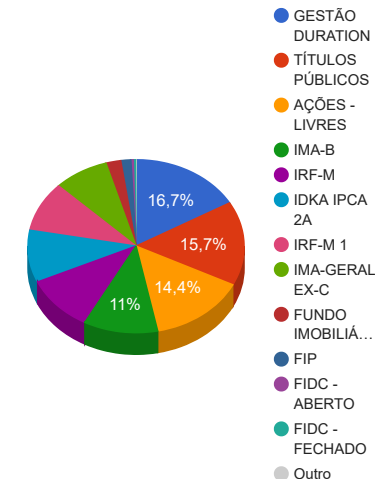
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-0,65%	-1,23%	-	-41,13%	0,10%	0,025%	0,15%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	160.720.881,37	28,66%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	153.799.902,66	27,43%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	88.023.484,60	15,70%
Itaú Unibanco	72.513.300,71	12,93%
BEM DTVM	39.409.973,34	7,03%
BNP Paribas	14.550.392,73	2,59%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	8.436.214,19	1,50%
Orla DTVM	7.407.305,22	1,32%
PLANNER CORRETORA	7.376.176,83	1,32%
Rio Bravo Investimentos	2.814.000,00	0,50%
Foco DTVM	1.986.406,29	0,35%
FINAXIS Corretora	1.867.578,60	0,33%
RJI Corretora de Valores	1.269.598,79	0,23%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	314.617,30	0,06%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	300.190,08	0,05%
Brasil Plural	7.544,96	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	93.482.913,80	16,67%
TÍTULOS PÚBLICOS	88.023.484,60	15,70%
AÇÕES - LIVRES	80.942.495,29	14,43%
IMA-B	61.922.831,68	11,04%
IRF-M	58.114.596,40	10,36%
IDKA IPCA 2A	54.653.575,88	9,75%
IRF-M 1	52.267.569,06	9,32%
IMA-GERAL EX-C	46.122.205,34	8,22%
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.476.773,20	2,22%
FIP	8.437.180,97	1,50%
FIDC - ABERTO	1.938.489,98	0,35%
FIDC - FECHADO	1.875.123,56	0,33%
DISP. FINANCEIRA	314.617,30	0,06%
MULTIMERCADO	225.710,61	0,04%



Carteira de Títulos Públicos - base (outubro / 2019)

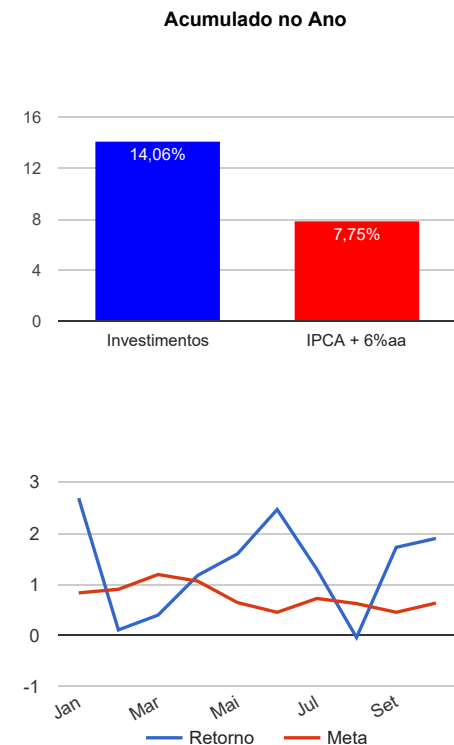
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.854,548814	1.000.585,27	2.968.002,59
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.854,548814	1.124.114,15	3.276.366,49
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.854,548814	1.006.644,67	2.890.911,61
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.854,548814	999.750,00	2.890.911,61
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.854,548814	1.487.280,45	4.240.003,70
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.854,548814	859.423,87	2.428.365,75
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.854,548814	136.416,48	385.454,88
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.854,548814	997.614,60	2.813.820,63
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.854,548814	1.479.584,78	4.240.003,70
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.854,548814	1.098.188,08	3.392.002,96
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.854,548814	992.130,00	2.890.911,61
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.854,548814	998.799,60	2.929.457,10
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.829,479369	895.805,83	2.945.982,42
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	4.829,479369	1.483.219,48	4.877.774,16
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	4.829,479369	1.732.870,29	5.698.785,66
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.829,479369	1.249.170,73	4.423.803,10
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.357,389606	1.411.663,50	3.856.289,80
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.357,389606	1.171.463,51	3.233.183,09
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.357,389606	798.050,50	2.178.694,80
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.357,389606	1.046.269,96	2.884.591,92
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.357,389606	960.617,17	2.614.433,76
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.357,389606	1.479.336,56	4.087.231,45

Carteira de Títulos Públicos - base (outubro / 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	4.357,389606	798.050,50	2.178.694,80
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.357,389606	1.002.194,60	3.006.598,83
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.357,389606	258.043,50	784.330,13
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.357,389606	909.797,78	2.749.512,84
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.357,389606	429.654,20	1.307.216,88
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.357,389606	2.083.308,72	5.664.606,49
TDA - Título da Dívida Agrária	01/12/2019	27/02/2004	1782	61,61359147	104,120000	109.795,42	185.541,84

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%
Acumulado no ano					67.182.450,41	14,06%	7,75%	181,37%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 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	53.612.142,46	0,00	0,00	55.410.128,26	1.797.985,80	3,35%	1,93%	3,35%
TÍTULOS PÚBLICOS	86.812.144,25	0,00	939.264,90	88.023.484,60	2.150.605,25	2,48%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.307.164,94	0,00	0,00	46.122.205,34	815.040,40	1,80%	0,93%	1,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	47.146.340,33	0,00	0,00	47.952.709,09	806.368,76	1,71%	1,12%	1,71%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.146.535,61	0,00	0,00	58.114.596,40	968.060,79	1,69%	0,96%	1,69%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.801.695,85	0,00	0,00	3.853.048,49	51.352,64	1,35%	0,76%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.034.723,85	930.000,00	0,00	54.653.575,88	688.852,03	1,28%	0,76%	1,28%
BRA1 FI RENDA FIXA	1.377.819,52	0,00	0,00	1.390.056,14	12.236,62	0,89%	0,52%	0,89%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.261.936,94	0,00	0,00	1.269.598,79	7.661,85	0,61%	6,40%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.049.576,04	2.910.000,00	3.010.000,00	52.267.569,06	317.993,02	0,58%	0,15%	0,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	45.305.311,79	0,00	0,00	45.530.204,71	224.892,92	0,50%	0,05%	0,50%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.870.616,16	0,00	0,00	1.867.578,60	-3.037,56	-0,16%	0,02%	-0,16%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.942.935,94	0,00	0,00	1.938.489,98	-4.445,96	-0,23%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	1.856,70	0,00	0,00	1.553,13	-303,57	-16,35%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	3.690,01	0,00	0,00	3.086,69	-603,32	-16,35%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	3.472,98	0,00	0,00	2.905,14	-567,84	-16,35%	-	-
				Total Renda Fixa	7.832.091,83	1,74%	0,88%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.550.000,00	0,00	18.000,00	2.814.000,00	282.000,00	11,06%	4,58%	10,35%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	20.195.936,21	0,00	0,00	20.928.736,19	732.799,98	3,63%	7,16%	3,63%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	13.184.686,77	1.000.000,00	0,00	14.550.392,73	365.705,96	2,58%	7,00%	2,62%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	294.736,80	0,00	1.623,00	300.190,08	7.076,28	2,40%	4,41%	1,85%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	26.355.001,84	0,00	0,00	26.983.096,00	628.094,16	2,38%	7,01%	2,38%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	17.063.685,43	1.000.000,00	0,00	18.480.270,37	416.584,94	2,31%	7,85%	2,27%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.294.492,85	0,00	0,00	7.376.176,83	81.683,98	1,12%	-	-60,45%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.282.105,95	0,00	0,00	7.279.483,25	-2.622,70	-0,04%	0,01%	-0,04%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.158.908,72	0,00	0,00	1.156.730,94	-2.177,78	-0,19%	0,03%	-0,19%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.990.147,36	0,00	0,00	1.986.406,29	-3.741,07	-0,19%	32,23%	-17,02%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	227.804,88	0,00	0,00	225.710,61	-2.094,27	-0,92%	2,24%	-0,92%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	1.011,73	0,00	0,00	966,78	-44,95	-4,44%	2,16%	-4,44%
Total Renda Variável					2.503.264,53	2,51%	7,02%	