

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2019



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			455.511,98	0,09%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			80.339.944,65	16,37%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.209.815,02	5,75%	538	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	70.250.824,91	14,32%	369	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	88.413.629,36	18,02%	1.249	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.737.325,08	10,13%	799	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	2.558.832,46	0,52%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	42.620.175,65	8,68%	387	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.535.694,68	0,72%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.661.117,41	0,34%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	42.079.377,79	8,57%	203	1,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.041.411,55	0,42%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	4.898,27	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.928.099,90	0,39%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	9.734,83	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	9.162,27	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	14.013.366,71	2,86%	6.452	1,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.601.522,32	2,36%	2.719	9,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.970.559,27	1,62%	1.145	2,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.505.112,23	2,34%	5.119	1,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	10.141.738,67	2,07%	162	11,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	225.870,04	0,05%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

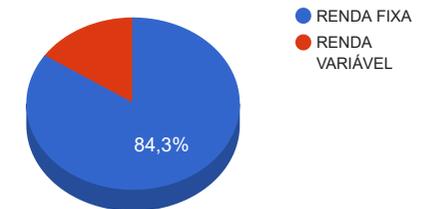
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.165,54	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.265.587,15	1,48%	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 "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	2.338.000,00	0,48%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	341.803,80	0,07%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.366.610,41	0,48%		5,81%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.174.244,94	1,46%		10,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>490.748.965,16</b>				

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

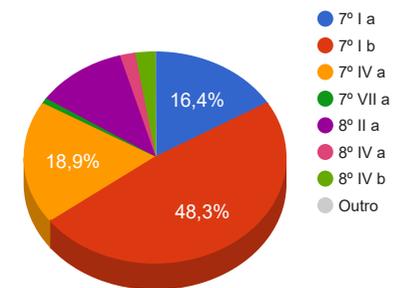
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	80.339.944,65	16,37%	17,00%	85,00%	90,00%	361.334.123,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	236.611.594,37	48,21%	0,00%	0,00%	50,00%	8.762.888,21
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	92.455.197,99	18,84%	0,00%	0,00%	20,00%	5.694.595,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.993.306,82	0,81%	0,00%	0,00%	2,00%	5.821.672,48
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	10,00%	49.074.896,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	55.232.299,20	11,25%	5,00%	8,00%	15,00%	18.380.045,57
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	225.870,04	0,05%	0,00%	0,00%	3,00%	14.496.598,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	9.214.580,96	1,88%	0,00%	0,00%	3,00%	5.507.887,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	12.220.659,15	2,49%	0,00%	0,00%	3,00%	2.501.809,80
Total Carteira		490.293.453,18					

RENDA FIXA	413.855.555,81	84,41%
RENDA VARIÁVEL	76.893.409,35	15,68%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	80.339.944,65	16,37%	17,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	236.611.594,37	48,21%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	92.455.197,99	18,84%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.993.306,82	0,81%	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 "	55.232.299,20	11,25%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	225.870,04	0,05%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	9.214.580,96	1,88%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	12.220.659,15	2,49%	0,00%	3,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>490.293.453,18</b>	<b>99,91%</b>	<b>22,00</b>	<b>206,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (fevereiro / 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	162.608.325,64	33,13%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	128.224.966,70	26,13%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	80.339.944,65	16,37%	-
ITAÚ UNIBANCO	42.079.377,79	8,57%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	25.518.478,94	5,20%	0,08%
Queluz Gestão de Recursos	19.874.816,07	4,05%	398,22%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	7.970.559,27	1,62%	0,02%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.289.382,52	1,49%	0,06%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.689.664,62	1,16%	0,88%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	2.366.610,41	0,48%	17,32%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.338.000,00	0,48%	0,14%
FINAXIS CORRETORA	2.041.411,55	0,42%	-
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.941.828,27	0,40%	-
ROMA ASSET	1.661.117,41	0,34%	0,49%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	341.803,80	0,07%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
VALORA INVESTIMENTOS	7.165,54	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	0,97%	1,89%	2,60%	5,04%	11,16%	22,23%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	0,88%	0,53%	2,90%	673,54%	-45,32%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,75%	1,43%	1,91%	3,65%	8,17%	15,74%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,17%	-0,31%	-0,46%	-1,25%	-4,90%	-10,89%	0,15%	0,030%	0,76%
120% do CDI	0,59%	1,25%	1,85%	3,70%	7,74%	19,41%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
IMA-B	0,55%	4,94%	6,67%	15,14%	14,11%	26,50%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,87%	6,57%	14,95%	13,78%	25,82%	0,20%	2,433%	5,52%
BRA1 FI RENDA FIXA	0,41%	1,08%	1,87%	4,34%	9,51%	11,97%	1,30%	0,313%	1,61%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,01%	3,21%	4,11%	9,14%	-19,72%	-16,92%	0,00%	1,382%	-
IMA-B 5	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,40%	-0,35%	3,50%	5,67%	11,52%	27,14%	1,30%	2,375%	5,71%
IDKA IPCA 2 Anos	0,53%	1,80%	3,07%	6,69%	10,19%	23,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	1,83%	3,01%	6,51%	9,63%	22,15%	0,20%	0,632%	2,36%
IRF-M 1	0,47%	1,05%	1,61%	3,73%	6,88%	17,40%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,02%	1,56%	3,65%	6,65%	16,91%	0,10%	0,083%	0,55%
IPCA	0,43%	0,75%	0,90%	1,63%	3,89%	6,85%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,50%	3,40%	4,77%	7,64%	9,66%	20,69%	0,002	2,407%	2,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,34%	2,72%	4,26%	6,02%	8,73%	19,83%	0,40%	1,411%	1,64%
IRF-M	0,29%	1,68%	3,24%	9,41%	9,94%	24,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,28%	1,63%	3,13%	9,45%	9,71%	23,73%	0,20%	0,983%	3,52%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

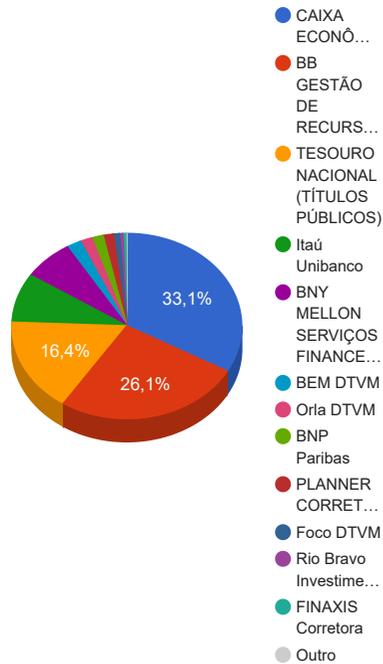
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 11,00% ao ano	1,27%	2,52%	3,53%	6,94%	15,32%	31,48%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	161,954%	96,05%
IFIX	1,03%	3,53%	5,83%	13,80%	5,33%	20,00%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	2,98%	1,83%	3,19%	16,03%	-2,23%	-1,59%	0,25%	0,000%	17,26%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,14%	0,000%	-
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	-1,76%	-2,58%	-0,09%	17,13%	-8,67%	-8,96%	0,35%	0,000%	14,37%
ÁQUILLA FII - AQLL11	-7,78%	6,41%	6,41%	18,07%	-2,35%	-17,84%	1,50%	0,000%	41,15%
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,69%	0,83%	2,40%	1,90%	-94,76%	-94,18%	0,00%	0,239%	95,10%
IPCA	0,43%	0,75%	0,90%	1,63%	3,89%	6,85%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,063%	0,96%
ICON	-4,30%	7,47%	7,31%	17,34%	-0,56%	24,12%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-4,26%	7,23%	6,94%	16,29%	-1,79%	20,81%	1,00%	8,897%	20,02%
Ibovespa	-1,86%	8,76%	6,79%	24,66%	11,99%	43,39%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,87%	13,68%	14,90%	29,89%	15,65%	25,97%	2,00%	5,981%	17,72%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,38%	4,87%	4,84%	23,19%	13,97%	50,08%	2,00%	10,076%	21,83%
SMLL	-1,82%	7,42%	9,67%	26,86%	11,74%	47,26%	-	-	-

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

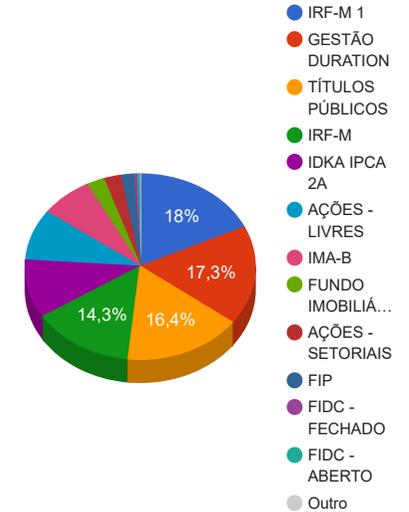
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,88%	3,39%	8,25%	29,80%	17,94%	57,77%	2,00%	8,814%	20,30%
IBX	-1,76%	8,76%	7,36%	25,63%	12,88%	44,58%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-0,99%	8,82%	9,81%	27,36%	15,33%	40,86%	2,00%	7,741%	18,92%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	162.608.325,64	33,13%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	128.224.966,70	26,13%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	80.339.944,65	16,37%
Itaú Unibanco	42.079.377,79	8,57%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	34.725.894,36	7,08%
BEM DTVM	10.148.904,21	2,07%
Orla DTVM	8.248.497,08	1,68%
BNP Paribas	7.970.559,27	1,62%
PLANNER CORRETORA	7.174.244,94	1,46%
Foco DTVM	4.027.727,82	0,82%
Rio Bravo Investimentos	2.338.000,00	0,48%
FINAXIS Corretora	2.041.411,55	0,42%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	455.511,98	0,09%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	341.803,80	0,07%
Brasil Plural	23.795,37	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	88.413.629,36	18,02%
GESTÃO DURATION	84.699.553,44	17,26%
TÍTULOS PÚBLICOS	80.339.944,65	16,37%
IRF-M	70.250.824,91	14,32%
IDKA IPCA 2A	49.737.325,08	10,13%
AÇÕES - LIVRES	43.630.776,88	8,89%
IMA-B	35.965.459,57	7,33%
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.220.659,15	2,49%
AÇÕES - SETORIAIS	11.601.522,32	2,36%
FIP	9.214.580,96	1,88%
FIDC - FECHADO	2.065.206,92	0,42%
FIDC - ABERTO	1.928.099,90	0,39%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	455.511,98	0,09%
MULTIMERCADO	225.870,04	0,05%



Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 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	3.469,827471	992.130,00	2.602.370,60	1.610.240,60
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.469,827471	998.799,60	2.637.068,88	1.638.269,28
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.469,827471	1.000.585,27	2.671.767,15	1.671.181,88
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.469,827471	1.124.114,15	2.949.353,35	1.825.239,20
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.469,827471	1.006.644,67	2.602.370,60	1.595.725,93
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.469,827471	999.750,00	2.602.370,60	1.602.620,60
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.469,827471	1.487.280,45	3.816.810,22	2.329.529,77
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.469,827471	859.423,87	2.185.991,31	1.326.567,44
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.469,827471	136.416,48	346.982,75	210.566,27
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.469,827471	997.614,60	2.532.974,05	1.535.359,45
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.469,827471	1.479.584,78	3.816.810,22	2.337.225,44
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.469,827471	1.098.188,08	3.053.448,17	1.955.260,09
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	3.945,441532	895.805,83	2.406.719,33	1.510.913,50
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	3.945,441532	1.483.219,48	3.984.895,95	2.501.676,47
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	3.945,441532	1.732.870,29	4.655.621,01	2.922.750,72
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	3.945,441532	1.249.170,73	3.614.024,44	2.364.853,71
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.237,036054	1.411.663,50	3.749.776,91	2.338.113,41
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.237,036054	1.171.463,51	3.143.880,75	1.972.417,24
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.237,036054	798.050,50	2.118.518,03	1.320.467,53
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.237,036054	1.046.269,96	2.804.917,87	1.758.647,91
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.237,036054	960.617,17	2.542.221,63	1.581.604,46
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.237,036054	1.479.336,56	3.974.339,82	2.495.003,26

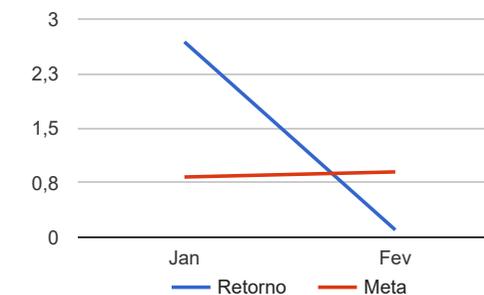
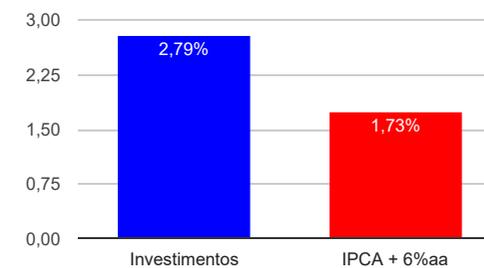
Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 2019)

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	4.237,036054	798.050,50	2.118.518,03	1.320.467,53
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.237,036054	1.002.194,60	2.923.554,88	1.921.360,28
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.237,036054	258.043,50	762.666,49	504.622,99
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.237,036054	909.797,78	2.673.569,75	1.763.771,97
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.237,036054	429.654,20	1.271.110,82	841.456,62
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.237,036054	2.083.308,72	5.508.146,87	3.424.838,15

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%
Acumulado no ano					13.119.971,18	2,79%	1,73%	160,94%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TÍTULOS PÚBLICOS	80.555.119,66	0,00	859.126,46	80.339.944,65	643.951,45	0,80%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	49.461.666,87	0,00	0,00	49.737.325,08	275.658,21	0,56%	0,63%	0,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	42.407.580,14	0,00	0,00	42.620.175,65	212.595,51	0,50%	2,41%	0,50%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.070.464,61	0,00	0,00	28.209.815,02	139.350,41	0,50%	2,43%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	85.872.179,49	5.010.671,48	2.860.000,00	88.413.629,36	390.778,39	0,43%	0,08%	0,44%
BRA1 FI RENDA FIXA	2.548.489,79	0,00	0,00	2.558.832,46	10.342,67	0,41%	0,31%	0,41%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.654.534,86	0,00	0,00	1.661.117,41	6.582,55	0,40%	2,37%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	41.936.946,03	0,00	0,00	42.079.377,79	142.431,76	0,34%	1,41%	0,34%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	69.160.189,40	900.000,00	0,00	70.250.824,91	190.635,51	0,27%	0,98%	0,28%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.927.032,93	0,00	0,00	1.928.099,90	1.066,97	0,06%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.535.491,10	0,00	0,00	3.535.694,68	203,58	0,01%	1,38%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.044.822,89	0,00	0,00	2.041.411,55	-3.411,34	-0,17%	0,03%	-0,17%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	10.557,43	0,00	0,00	9.734,83	-822,60	-7,79%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	5.312,18	0,00	0,00	4.898,27	-413,91	-7,79%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	9.936,50	0,00	0,00	9.162,27	-774,23	-7,79%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.008.174,93</b>	<b>0,49%</b>	<b>1,05%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	331.903,50	0,00	1.330,86	341.803,80	11.231,16	3,38%	0,00%	2,98%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.313.366,98	0,00	0,00	2.366.610,41	53.243,43	2,30%	0,00%	-7,78%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	224.322,30	0,00	0,00	225.870,04	1.547,74	0,69%	0,24%	0,69%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.259.259,42	0,00	128.189,18	7.174.244,94	43.174,70	0,59%	0,00%	0,00%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.941.828,27	0,00	0,00	1.941.828,27	0,00	0,00%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.270.173,70	0,00	0,00	7.265.587,15	-4.586,55	-0,06%	0,06%	-0,06%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.040.800,31	0,00	0,00	7.970.559,27	-70.241,04	-0,87%	5,98%	-0,87%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.242.931,57	0,00	0,00	10.141.738,67	-101.192,90	-0,99%	7,74%	-0,99%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - AGCX11	2.380.000,00	0,00	15.000,00	2.338.000,00	-27.000,00	-1,13%	0,00%	-1,76%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.785.073,28	0,00	0,00	11.505.112,23	-279.961,05	-2,38%	10,08%	-2,38%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	14.429.338,18	0,00	0,00	14.013.366,71	-415.971,47	-2,88%	8,81%	-2,88%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	12.117.517,36	0,00	0,00	11.601.522,32	-515.995,04	-4,26%	8,90%	-4,26%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	179.418,04	2.400,00	0,00	7.165,54	-174.652,50	-96,06%	161,95%	-96,02%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-1.480.403,52</b>	<b>-1,89%</b>	<b>6,28%</b>	