

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			86.812.144,25	15,82%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	53.612.142,46	9,77%	681	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.034.723,85	9,66%	937	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.049.576,04	9,48%	1.212	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	45.307.164,94	8,26%	552	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.146.535,61	10,41%	419	0,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	47.146.340,33	8,59%	643	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	1.377.819,52	0,25%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	45.305.311,79	8,25%		0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.801.695,85	0,69%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.261.936,94	0,23%	11	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	3.472,98	0,00%	2	5,38%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.870.616,16	0,34%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.942.935,94	0,35%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	3.690,01	0,00%	11	2,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	1.856,70	0,00%	5	2,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	17.063.685,43	3,11%	5.821	1,88%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	13.184.686,77	2,40%	1.824	4,88%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	20.195.936,21	3,68%	7.737	1,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	26.355.001,84	4,80%	55.951	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	227.804,88	0,04%	12	14,11%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.011,73	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2019)

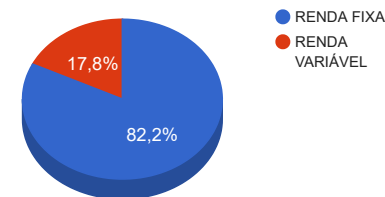
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ATICO FIC FIP FLORESTAL	Não se aplica	Não se aplica	1.158.908,72	0,21%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.282.105,95	1,33%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se aplica	Não se aplica	2.550.000,00	0,46%		4,94%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	294.736,80	0,05%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.990.147,36	0,36%		4,31%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.294.492,85	1,33%		10,47%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
Total para cálculo dos limites da Resolução			548.276.481,91				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			546.417,79				Artigo 6º
Total			548.822.899,70				

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

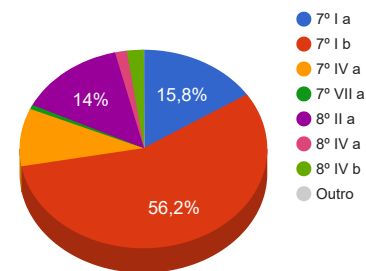
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	86.812.144,25	15,83%	0,00%	15,00%	100,00%	461.464.337,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	308.296.483,23	56,23%	0,00%	49,00%	100,00%	239.979.998,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	51.746.764,10	9,44%	0,00%	16,50%	40,00%	167.563.828,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.822.571,79	0,70%	0,00%	0,50%	2,00%	7.142.957,85
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	164.482.944,57
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	164.482.944,57
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	76.799.310,25	14,01%	0,00%	12,40%	20,00%	32.855.986,13
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	227.804,88	0,04%	0,00%	0,10%	3,00%	16.220.489,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.442.026,40	1,54%	0,00%	1,50%	3,00%	8.006.268,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	12.129.377,01	2,21%	0,00%	1,00%	3,00%	4.318.917,45
Total Carteira		548.276.481,91					

RENDA FIXA	451.224.381,16	82,30%
RENDA VARIÁVEL	97.598.518,54	17,80%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	86.812.144,25	15,82%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	308.296.483,23	56,17%	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 "	51.746.764,10	9,43%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.822.571,79	0,70%	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 "	76.799.310,25	13,99%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	227.804,88	0,04%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.442.026,40	1,54%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	12.129.377,01	2,21%	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	548.276.481,91	99,90%	5,00	449,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (setembro / 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	157.327.599,79	28,67%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	150.968.883,44	27,51%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	86.812.144,25	15,82%	-
ITAÚ UNIBANCO	71.660.313,63	13,06%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	37.259.621,64	6,79%	0,10%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	13.184.686,77	2,40%	0,02%
Queluz Gestão de Recursos	9.831.221,09	1,79%	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.291.125,64	1,33%	0,05%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.972.436,67	1,09%	3,65%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.550.000,00	0,46%	0,12%
Reditus Investimentos	1.990.147,36	0,36%	-
PETRA Capital	1.870.616,16	0,34%	0,03%
Veritas Capital Management	1.261.936,94	0,23%	0,08%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	294.736,80	0,05%	0,00%
VALORA INVESTIMENTOS	1.011,73	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,86%	19,55%	3,77%	13,27%	31,37%	34,72%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,85%	19,32%	3,72%	13,15%	31,00%	34,05%	0,20%	1,966%	7,30%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1,63%	10,98%	2,18%	7,17%	18,01%	-	0,00%	1,145%	5,08%
BRA1 FI RENDA FIXA	0,99%	-45,57%	-44,00%	-46,30%	-44,00%	-34,87%	1,30%	3,220%	45,35%
IMA-B 5	1,74%	10,27%	2,78%	7,17%	15,40%	22,93%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,80%	-23,92%	-6,51%	-24,11%	-19,35%	-11,66%	1,30%	164,595%	100,25%
IDKA IPCA 2 Anos	1,60%	9,13%	2,72%	6,49%	12,85%	22,46%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	8,58%	2,46%	5,93%	12,28%	20,88%	0,20%	0,821%	1,92%
IMA Geral ex-C	1,46%	10,53%	2,59%	7,40%	16,57%	22,60%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	11,06%	2,62%	7,89%	17,17%	23,01%	0,30%	0,853%	3,32%
IRF-M	1,44%	9,99%	2,81%	7,53%	16,83%	23,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	9,69%	2,73%	7,34%	16,76%	22,99%	0,20%	0,817%	3,46%
IRF-M 1	0,64%	5,31%	1,92%	3,72%	7,44%	14,70%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	5,12%	1,85%	3,60%	7,22%	14,20%	0,10%	0,117%	0,47%
120% do CDI	0,56%	5,62%	1,85%	3,73%	7,57%	16,22%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-19,60%	-67,68%	-37,95%	-58,14%	-74,42%	-90,28%	0,00%	-	13,72%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-19,60%	-67,68%	-37,95%	-58,14%	-74,42%	-89,73%	0,00%	-	13,73%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-19,60%	-67,68%	-37,95%	-58,14%	-74,42%	-90,86%	0,00%	-	13,72%
IPCA + 7,00% ao ano	0,53%	7,83%	2,05%	4,50%	10,07%	23,00%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,92%	1,66%	-0,50%	0,76%	3,69%	-2,06%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,29%	5,64%	1,31%	3,05%	7,10%	16,50%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,15%	-8,65%	-6,51%	-8,22%	-9,30%	-14,10%	0,15%	0,050%	6,02%
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2,12%	14,38%	3,11%	10,02%	18,30%	25,15%	0,002	1,371%	3,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	10,59%	2,06%	7,25%	13,67%	20,84%	0,40%	0,303%	2,74%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,57%	19,18%	3,74%	9,78%	32,02%	40,99%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5,40%	28,91%	4,21%	13,85%	50,25%	31,95%	2,00%	3,938%	16,53%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3,42%	28,77%	8,98%	20,27%	46,74%	60,66%	1,90%	4,841%	14,23%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,94%	17,66%	6,99%	13,09%	34,07%	49,86%	2,00%	5,861%	13,81%

SMLL	2,08%	30,58%	9,49%	21,44%	57,29%	45,27%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,76%	25,14%	12,43%	23,11%	58,04%	59,79%	2,00%	8,055%	16,92%

IFIX	1,04%	14,15%	2,21%	8,11%	25,74%	20,86%	-	-	-
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	0,80%	-89,37%	-4,77%	-89,31%	-87,07%	-90,02%	0,35%	8,613%	15,00%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	20,51%	-2,08%	13,25%	17,50%	4,62%	1,50%	0,000%	23,90%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-3,81%	-12,19%	-5,92%	-5,90%	-6,37%	-4,77%	0,25%	4,160%	11,14%

IPCA + 11,00% ao ano	0,83%	10,84%	3,04%	6,47%	14,16%	32,29%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	0,021%	120,31%

CDI	0,46%	4,66%	1,54%	3,10%	6,27%	13,34%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,84%	1,69%	-2,50%	0,05%	5,55%	-94,51%	0,00%	0,066%	2,97%

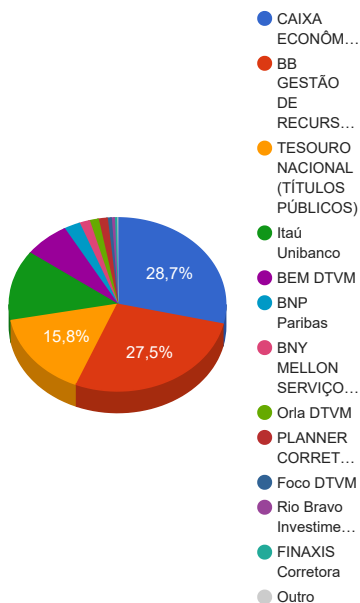
IPCA	-0,04%	2,49%	0,26%	0,97%	2,89%	7,55%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

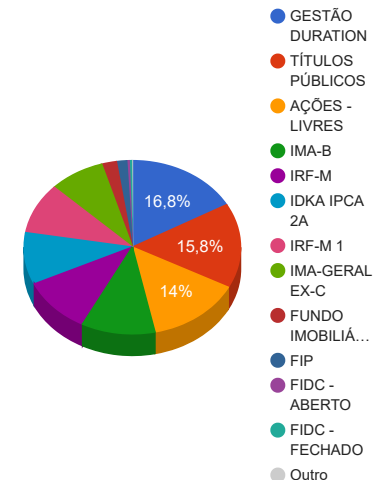
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ATICO FIC FIP FLORESTAL	-	-	-	-	-	-	0,10%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	157.327.599,79	28,67%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	150.968.883,44	27,51%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	86.812.144,25	15,82%
Itaú Unibanco	71.660.313,63	13,06%
BEM DTVM	37.260.633,37	6,79%
BNP Paribas	13.184.686,77	2,40%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	8.441.014,67	1,54%
Orla DTVM	7.350.256,19	1,34%
PLANNER CORRETORA	7.294.492,85	1,33%
Foco DTVM	3.252.084,30	0,59%
Rio Bravo Investimentos	2.550.000,00	0,46%
FINAXIS Corretora	1.870.616,16	0,34%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	546.417,79	0,10%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	294.736,80	0,05%
Brasil Plural	9.019,69	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	92.451.652,12	16,85%
TÍTULOS PÚBLICOS	86.812.144,25	15,82%
AÇÕES - LIVRES	76.799.310,25	13,99%
IMA-B	60.053.594,77	10,94%
IRF-M	57.146.535,61	10,41%
IDKA IPCA 2A	53.034.723,85	9,66%
IRF-M 1	52.049.576,04	9,48%
IMA-GERAL EX-C	45.307.164,94	8,26%
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.129.377,01	2,21%
FIP	8.442.026,40	1,54%
FIDC - ABERTO	1.942.935,94	0,35%
FIDC - FECHADO	1.879.635,85	0,34%
DISP. FINANCEIRA	546.417,79	0,10%
MULTIMERCADO	227.804,88	0,04%



Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 2019)

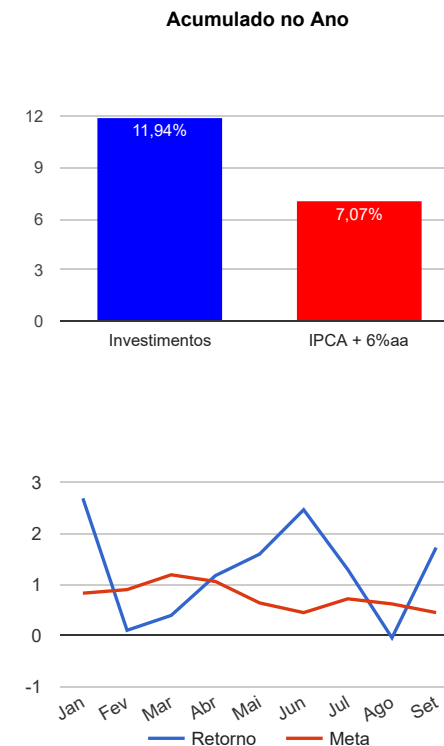
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	1.322,840000	992.130,00	992.130,00
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	1.314,210000	998.799,60	998.799,60
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	1.299,461390	1.000.585,27	1.000.585,27
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	1.322,487235	1.124.114,15	1.124.114,15
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	1.342,192893	1.006.644,67	1.006.644,67
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	1.333,000000	999.750,00	999.750,00
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	1.352,073136	1.487.280,45	1.487.280,45
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	1.364,164873	859.423,87	859.423,87
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	1.364,164800	136.416,48	136.416,48
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	1.366,595342	997.614,60	997.614,60
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	1.345,077073	1.479.584,78	1.479.584,78
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	1.247,941000	1.098.188,08	1.098.188,08
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	1.468,534148	895.805,83	895.805,83
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	1.468,534139	1.483.219,48	1.483.219,48
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	1.468,534144	1.732.870,29	1.732.870,29
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	1.363,723504	1.249.170,73	1.249.170,73
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	1.432,180667	429.654,20	429.654,20
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	1.602,545169	2.083.308,72	2.083.308,72
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	1.595,100000	1.411.663,50	1.411.663,50
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	1.578,791792	1.171.463,51	1.171.463,51
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	1.596,101000	798.050,50	798.050,50
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	1.580,468218	1.046.269,96	1.046.269,96

Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 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	20/03/2003	600	1.601,028617	1.601,028617	960.617,17	960.617,17
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	1.577,117868	1.479.336,56	1.479.336,56
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	1.596,101000	798.050,50	798.050,50
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	1.452,455942	1.002.194,60	1.002.194,60
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	1.433,575000	258.043,50	258.043,50
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	1.441,834834	909.797,78	909.797,78
TDA - Título da Dívida Agrária	01/12/2019	27/02/2004	1782	61,61359147	61,61359147	109.795,42	109.795,42

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%
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%
Acumulado no ano					56.892.706,08	11,94%	7,07%	168,76%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	52.127.750,00	0,00	0,00	53.612.142,46	1.484.392,46	2,85%	1,97%	2,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	46.168.346,93	0,00	0,00	47.146.340,33	977.993,40	2,12%	1,37%	2,12%
TÍTULOS PÚBLICOS	85.104.026,37	0,00	0,00	86.812.144,25	1.708.117,88	2,01%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.740.632,97	0,00	0,00	3.801.695,85	61.062,88	1,63%	1,15%	1,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.638.073,46	0,00	0,00	45.307.164,94	669.091,48	1,50%	0,85%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.289.886,23	0,00	0,00	53.034.723,85	744.837,62	1,42%	0,82%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.344.515,95	0,00	0,00	57.146.535,61	802.019,66	1,42%	0,82%	1,42%
BRA1 FI RENDA FIXA	1.364.249,71	0,00	0,00	1.377.819,52	13.569,81	0,99%	3,22%	2,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	44.953.446,51	0,00	0,00	45.305.311,79	351.865,28	0,78%	0,30%	0,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	51.715.001,97	3.205.573,90	3.200.000,00	52.049.576,04	329.000,17	0,60%	0,12%	0,62%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.873.474,31	0,00	0,00	1.870.616,16	-2.858,15	-0,15%	0,05%	-0,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.961.033,81	0,00	0,00	1.942.935,94	-18.097,87	-0,92%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.291.511,23	0,00	0,00	1.261.936,94	-29.574,29	-2,29%	164,59%	-1,78%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	2.309,38	0,00	0,00	1.856,70	-452,68	-19,60%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	4.589,67	0,00	0,00	3.690,01	-899,66	-19,60%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	4.319,73	0,00	0,00	3.472,98	-846,75	-19,60%	-	-
				Total Renda Fixa	7.089.221,24	1,60%	1,48%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	11.540.388,80	1.000.000,00	0,00	13.184.686,77	644.297,97	5,14%	3,94%	5,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	25.482.729,31	0,00	0,00	26.355.001,84	872.272,53	3,42%	4,84%	3,42%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	15.731.753,88	1.000.000,00	0,00	17.063.685,43	331.931,55	1,98%	5,86%	1,94%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.529.800,00	0,00	18.000,00	2.550.000,00	38.200,00	1,51%	8,61%	0,80%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.200.745,34	0,00	0,00	7.294.492,85	93.747,51	1,30%	-	0,00%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	20.044.345,52	0,00	0,00	20.195.936,21	151.590,69	0,76%	8,05%	0,76%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.284.078,30	0,00	0,00	7.282.105,95	-1.972,35	-0,03%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.993.134,69	0,00	0,00	1.990.147,36	-2.987,33	-0,15%	0,00%	0,00%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.162.310,30	0,00	0,00	1.158.908,72	-3.401,58	-0,29%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	229.744,06	0,00	0,00	227.804,88	-1.939,18	-0,84%	0,07%	-0,80%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	1.039,96	0,00	0,00	1.011,73	-28,23	-2,71%	0,02%	-2,71%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	306.422,40	0,00	1.330,86	294.736,80	-10.354,74	-3,38%	4,16%	-3,81%
Total Renda Variável					2.111.356,84	2,21%	5,69%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	85.323.705,84	0,00	877.133,68	86.812.144,25	2.365.572,09	2,79%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	51.686.819,04	0,00	0,00	53.612.142,46	1.925.323,42	3,72%	3,72%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.720.956,25	920.000,00	0,00	57.146.535,61	1.505.579,36	2,72%	2,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	45.722.197,23	0,00	0,00	47.146.340,33	1.424.143,10	3,11%	3,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.762.750,81	0,00	0,00	53.034.723,85	1.271.973,04	2,46%	2,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.151.202,93	0,00	0,00	45.307.164,94	1.155.962,01	2,62%	2,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	56.024.246,40	12.837.863,65	17.780.000,00	52.049.576,04	967.465,99	1,68%	1,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	44.390.927,75	0,00	0,00	45.305.311,79	914.384,04	2,06%	2,06%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.720.571,91	0,00	0,00	3.801.695,85	81.123,94	2,18%	2,18%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	2.992,10	0,00	0,00	1.856,70	-1.135,40	-37,95%	-37,95%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	5.596,76	0,00	0,00	3.472,98	-2.123,78	-37,95%	-37,95%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	5.946,51	0,00	0,00	3.690,01	-2.256,50	-37,95%	-37,95%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.952.615,08	0,00	0,00	1.942.935,94	-9.679,14	-0,50%	-0,50%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.356.667,29	0,00	0,00	1.261.936,94	-94.730,35	-6,98%	-6,51%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.000.788,15	0,00	0,00	1.870.616,16	-130.171,99	-6,51%	-6,51%
BRA1 FI RENDA FIXA	2.460.499,33	0,00	0,00	1.377.819,52	-1.082.679,81	-44,00%	-44,00%
Total Renda Fixa					10.288.750,02	2,33%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	24.182.875,17	0,00	0,00	26.355.001,84	2.172.126,67	8,98%	8,98%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.086.152,21	3.000.000,00	0,00	20.195.936,21	2.109.784,00	12,20%	12,43%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.065.186,28	4.000.000,00	0,00	17.063.685,43	998.499,15	6,76%	6,99%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.672.969,12	4.000.000,00	0,00	13.184.686,77	511.717,65	4,01%	4,21%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	7.260.459,45	0,00	0,00	7.282.105,95	21.646,50	0,30%	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	1.098,98	0,00	0,00	1.011,73	-87,25	-7,94%	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	233.643,39	0,00	0,00	227.804,88	-5.838,51	-2,50%	-2,50%
ATICO FIC FIP FLORESTAL	1.166.386,56	0,00	0,00	1.158.908,72	-7.477,84	-0,64%	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	309.668,40	0,00	3.895,20	294.736,80	-11.036,40	-3,60%	-5,92%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.047.976,76	0,00	0,00	1.990.147,36	-57.829,40	-2,82%	-2,08%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.677.800,00	0,00	65.800,00	2.550.000,00	-62.000,00	-2,40%	-4,77%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.581.908,26	0,00	131.313,22	7.294.492,85	-156.102,19	-2,12%	0,00%
Total Renda Variável					5.513.402,38	6,20%	