

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			125.674.504,04	10,40%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	14.493.000,24	1,20%	27	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	61.122.054,39	5,06%	9.366	7,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	84.941.893,50	7,03%	438	2,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.652.318,50	0,30%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.688.640,90	0,55%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	29.082.430,36	2,41%	20	10,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	145.360.205,74	12,03%	799	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	10.139.191,61	0,84%	165	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	13.394.788,41	1,11%	73	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	26.476.652,66	2,19%	751	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	6.505.597,11	0,54%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	47.059.167,83	3,90%	241	2,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ou D+5 du	Não há	10.442.366,54	0,86%	4.334	6,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.991.015,08	0,41%	76	4,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	74.507.386,74	6,17%	14	12,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	107.408.824,91	8,89%	203	3,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	42.141.051,12	3,49%	423	1,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.115.989,20	0,75%	335	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	68.077,41	0,01%	702	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	148.206.101,57	12,27%	84	10,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	34.705.626,77	2,87%	387	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2019)

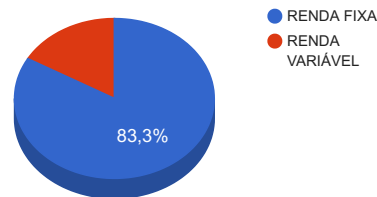
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	64.987,76	0,01%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	20.093.685,87	1,66%	55	2,19%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.811.964,51	0,56%	1.891	7,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	9.878.435,68	0,82%	97	4,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	42.030.709,69	3,48%	4.446	5,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	15.044.210,65	1,25%	6.452	1,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	23.037.083,44	1,91%	74	11,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.002.172,26	0,33%	4.233	1,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	D+2 a D+61	Não há	9.596.530,86	0,79%	4.989	2,26%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	802.896,42	0,07%	12	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	18.690.127,86	1,55%	46	4,52%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	29.050.339,00	2,40%	7.853	3,55%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.135.340,91	0,09%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.371.277,70	0,44%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	482.334,21	0,04%		0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.232.509,88	0,10%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	5.234.514,88	0,43%		2,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	8.190.389,02	0,68%		11,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	1.100.000,00	0,09%		0,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		Total	1.208.026.395,23				

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

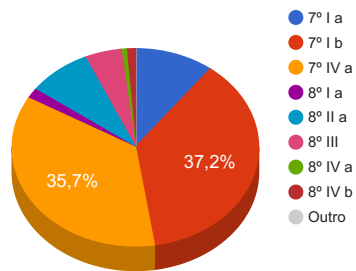
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	125.674.504,04	10,40%	7,00%	11,00%	15,00%	55.529.455,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	448.915.941,25	37,16%	25,00%	33,00%	60,00%	275.899.895,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	241.605.279,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	362.407.918,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	431.586.439,34	35,73%	5,00%	21,00%	40,00%	51.624.118,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	64.987,76	0,01%	1,00%	3,00%	5,00%	60.336.332,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	60.401.319,76
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	20.093.685,87	1,66%	2,00%	8,00%	10,00%	100.708.953,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	100.804.576,23	8,34%	0,00%	1,00%	10,00%	19.998.063,29
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	58.139.894,14	4,81%	2,00%	5,00%	10,00%	62.662.745,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.221.462,70	0,68%	1,00%	3,00%	5,00%	52.179.857,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	14.524.903,90	1,20%	1,00%	3,00%	5,00%	45.876.415,86
Total Carteira		1.208.026.395,23					

RENDA FIXA	1.006.241.872,39	83,30%
RENDA VARIÁVEL	201.784.522,84	16,70%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	125.674.504,04	10,40%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	448.915.941,25	37,16%	25,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	431.586.439,34	35,73%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	64.987,76	0,01%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	1,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	20.093.685,87	1,66%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	100.804.576,23	8,34%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	58.139.894,14	4,81%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.221.462,70	0,68%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	14.524.903,90	1,20%	1,00%	5,00%
Total	1.208.026.395,23	100,00%	50,00	220,00

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	327.282.811,27	27,09%	0,07%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	231.829.477,51	19,19%	0,02%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	125.674.504,04	10,40%	-
ITAÚ UNIBANCO	118.905.437,10	9,84%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	95.149.162,52	7,88%	0,01%
WESTERN ASSET	76.822.897,22	6,36%	0,17%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	61.122.054,39	5,06%	0,19%
Navi Capital	42.030.709,69	3,48%	2,31%
XP GESTÃO DE RECURSOS	30.853.034,17	2,55%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	23.037.083,44	1,91%	4,52%
ITAÚ DTVM	20.093.685,87	1,66%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	15.044.210,65	1,25%	0,05%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	9.878.435,68	0,82%	0,04%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.190.389,02	0,68%	1,86%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	6.688.640,90	0,55%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.371.277,70	0,44%	-%
MÉRITO INVESTIMENTOS	5.234.514,88	0,43%	-%
ROMA ASSET	1.232.509,88	0,10%	0,37%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.135.340,91	0,09%	0,00%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.100.000,00	0,09%	0,02%
CAPITÂNIA	802.896,42	0,07%	0,01%
BRASIL PLURAL	482.334,21	0,04%	0,00%
Gradual Investimentos	64.987,76	0,01%	-%

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
130% do CDI	0,64%	1,35%	2,00%	4,01%	8,41%	21,19%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-	-	-	-	-100,00%	-	2,50%	-	-

IMA-B 5+	0,55%	7,20%	9,21%	21,43%	17,23%	29,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	7,08%	9,01%	20,98%	16,72%	29,06%	0,20%	3,668%	7,98%

IMA-B	0,55%	4,94%	6,67%	15,14%	14,11%	26,50%	-	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0,54%	4,83%	6,26%	14,64%	14,59%	29,68%	0,40%	2,268%	5,29%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,52%	4,99%	6,81%	15,11%	13,78%	25,50%	0,50%	2,445%	5,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	1,87%	3,05%	6,95%	10,05%	22,09%	0,20%	0,631%	2,09%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,52%	5,01%	6,80%	15,56%	14,01%	26,36%	0,20%	2,481%	5,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,52%	4,93%	6,64%	15,10%	13,92%	26,03%	0,20%	2,409%	5,55%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	0,48%	4,98%	6,91%	15,86%	14,42%	28,92%	0,30%	2,599%	6,22%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,81%	3,10%	4,57%	14,06%	8,78%	13,73%	0,20%	5,125%	7,68%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,86%	0,51%	2,32%	8,46%	5,65%	12,02%	0,20%	4,456%	6,74%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,16%	-1,13%	-0,21%	2,85%	3,16%	9,51%	0,20%	4,650%	4,52%

IMA-B 5	0,55%	2,09%	3,49%	7,79%	10,10%	23,00%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,52%	2,05%	3,43%	7,67%	9,88%	22,57%	0,20%	0,795%	3,04%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,46%	2,41%	3,82%	8,20%	10,54%	23,04%	0,50%	1,012%	2,95%

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
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,37%	2,56%	4,74%	10,68%	11,78%	26,21%	0,40%	1,485%	4,76%
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%
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,72%	1,35%	1,74%	0,32%	0,71%	5,75%	0,20%	0,173%	4,05%
BRANCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,48%	1,01%	1,49%	2,99%	6,22%	15,68%	0,15%	0,000%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	1,00%	1,49%	3,00%	6,16%	15,55%	0,20%	0,011%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,86%	1,27%	2,53%	5,27%	13,53%	1,00%	0,002%	0,01%
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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,84%	-0,35%	1,17%	6,15%	4,64%	11,19%	0,15%	4,838%	5,54%

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

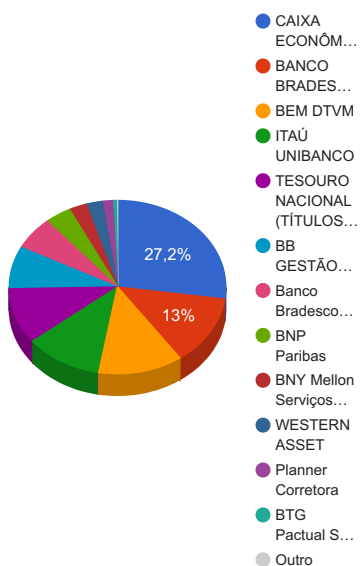
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	2,97%	11,08%	0,84%	-4,03%	2,60%	17,62%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,40%	11,35%	2,37%	-2,24%	6,60%	31,56%	1,00%	4,188%	14,67%
IPCA + 8,00% ao ano	1,05%	2,05%	2,83%	5,52%	12,20%	24,51%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IFIX	1,03%	3,53%	5,83%	13,80%	5,33%	20,00%	-	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	3,77%	-5,50%	-0,90%	0,22%	-6,78%	5,77%	0,95%	0,000%	57,58%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,14%	0,000%	-
CDI	0,49%	1,04%	1,54%	3,07%	6,41%	15,93%	-	-	-
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	1,24%	1,88%	1,86%	4,10%	8,49%	13,67%	2,00%	2,173%	5,11%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,88%	0,97%	1,80%	3,89%	6,96%	15,55%	2,00%	0,897%	1,62%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,22%	-0,44%	-0,67%	-0,09%	-2,79%	-0,45%	0,55%	0,385%	6,27%
IDIV	-2,03%	10,20%	10,92%	32,82%	17,00%	37,80%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,73%	11,09%	15,03%	40,80%	24,24%	41,52%	3,00%	8,556%	20,73%
Ibovespa	-1,86%	8,76%	6,79%	24,66%	11,99%	43,39%	-	-	-
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,58%	10,60%	10,52%	31,72%	28,11%	64,50%	1,50%	6,967%	18,90%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-1,60%	8,12%	8,18%	27,07%	13,09%	43,27%	1,50%	8,226%	19,77%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-1,83%	9,52%	7,46%	24,98%	16,68%	47,16%	2,00%	9,791%	22,31%

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

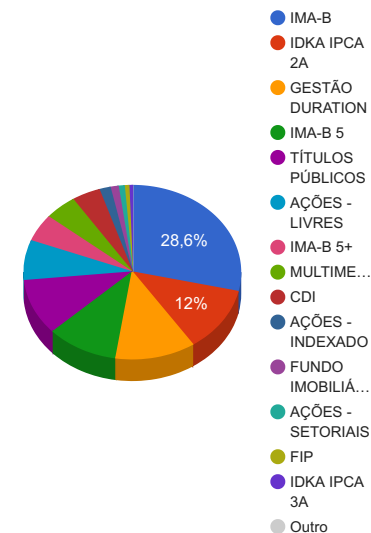
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-1,88%	8,37%	8,15%	25,42%	18,00%	51,51%	0,97%	7,517%	17,45%
SMLL	-1,82%	7,42%	9,67%	26,86%	11,74%	47,26%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,88%	3,39%	8,25%	29,80%	17,94%	57,77%	2,00%	8,814%	20,30%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	8,88%	17,06%	10,54%	-8,50%	-10,02%	2,43%	0,15%	0,000%	35,63%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	-1,68%	10,87%	14,68%	39,77%	23,52%	-	3,00%	8,350%	20,30%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	-	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	0,000%	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	328.900.486,39	27,23%
BANCO BRADESCO	157.322.090,77	13,02%
BEM DTVM	151.112.493,85	12,51%
ITAÚ UNIBANCO	138.999.122,97	11,51%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	125.674.504,04	10,40%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	95.149.162,52	7,88%
Banco Bradesco S.A.	74.507.386,74	6,17%
BNP Paribas	47.772.558,22	3,95%
BNY Mellon Serviços Financeiros	31.655.930,59	2,62%
WESTERN ASSET	29.050.339,00	2,40%
Planner Corretora	18.796.181,60	1,56%
BTG Pactual Serviços Financeiros	6.688.640,90	0,55%
Orla DTVM	1.232.509,88	0,10%
CM Capital Markets DTVM	1.100.000,00	0,09%
Genial Investimentos	64.987,76	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	345.525.831,36	28,60%
IDKA IPCA 2A	145.360.205,74	12,03%
GESTÃO DURATION	142.114.451,68	11,76%
IMA-B 5	128.119.008,90	10,61%
TÍTULOS PÚBLICOS	125.674.504,04	10,40%
AÇÕES - LIVRES	89.990.439,46	7,45%
IMA-B 5+	61.552.168,07	5,10%
MULTIMERCADO	58.139.894,14	4,81%
CDI	51.325.117,73	4,25%
AÇÕES - INDEXADO	20.093.685,87	1,66%
FUNDO IMOBILIÁRIO	14.524.903,90	1,20%
AÇÕES - SETORIAIS	10.814.136,77	0,90%
FIP	8.221.462,70	0,68%
IDKA IPCA 3A	6.505.597,11	0,54%
FIDC - FECHADO	64.987,76	0,01%



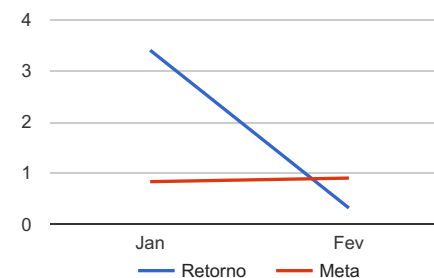
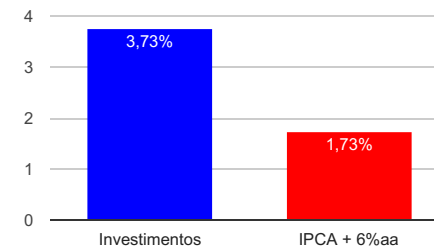
Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	25/08/2015	7659	2.636,195170	2.636,195170	20.190.618,81	20.190.618,81
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	2.964,257204	14.080.221,72	14.080.221,72
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	2.515,509771	16.929.380,76	16.929.380,76
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	2.315,991673	14.324.408,50	14.324.408,50
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	2.838,144079	6.243.916,97	6.243.916,97
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	2.412,107871	20.044.616,41	20.044.616,41

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.141.917.993,47	95.215.761,54	78.335.150,43	1.198.207.490,61	39.408.886,03	3,40%	0,83%	408,94%	2,04%
Fevereiro	1.198.207.490,61	82.922.503,27	85.993.182,74	1.198.910.406,03	3.773.594,89	0,31%	0,90%	35,17%	2,54%
Acumulado no ano					43.182.480,92	3,73%	1,73%	214,83%	

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(%)
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.813.794,53	0,00	180.238,98	6.688.640,90	55.085,35	0,81%	4,84%	-1,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.459.099,79	0,00	0,00	6.505.597,11	46.497,32	0,72%	0,17%	0,72%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.760.221,54	0,00	363.218,78	14.493.000,24	95.997,48	0,65%	5,12%	-1,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	154.523.300,27	0,00	10.000.000,00	145.360.205,74	836.905,47	0,54%	0,63%	0,56%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	60.793.889,16	0,00	0,00	61.122.054,39	328.165,23	0,54%	2,27%	0,54%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.732.766,80	0,00	100.289,95	3.652.318,50	19.841,65	0,53%	4,65%	-2,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	147.438.599,30	0,00	0,00	148.206.101,57	767.502,27	0,52%	2,48%	0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.340.330,81	0,00	0,00	26.476.652,66	136.321,85	0,52%	2,41%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.367.893,68	0,00	282.146,61	10.139.191,61	53.444,54	0,52%	0,63%	0,52%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	64.657,08	0,00	0,00	64.987,76	330,68	0,51%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	34.532.510,16	0,00	0,00	34.705.626,77	173.116,61	0,50%	2,41%	0,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	88.591.371,54	5.883.565,69	10.000.010,15	84.941.893,50	466.966,42	0,49%	0,80%	0,52%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	9.072.510,74	0,00	0,00	9.115.989,20	43.478,46	0,48%	0,00%	0,48%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	74.152.725,09	0,00	0,00	74.507.386,74	354.661,65	0,48%	2,60%	0,48%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	10.395.020,81	0,00	0,00	10.442.366,54	47.345,73	0,46%	1,01%	0,46%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	28.974.926,32	0,00	0,00	29.082.430,36	107.504,04	0,37%	1,49%	0,37%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.649.319,01	0,00	303.081,24	13.394.788,41	48.550,64	0,36%	4,46%	-1,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	107.045.263,69	0,00	0,00	107.408.824,91	363.561,22	0,34%	1,41%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	881.049,83	0,00	883.545,39	0,00	2.495,56	0,28%	0,00%	0,47%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	63.690.907,36	41.581.324,52	63.424.651,64	42.141.051,12	293.470,88	0,28%	0,01%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.944.741,40	20.000.000,00	0,00	47.059.167,83	114.426,43	0,24%	3,67%	0,52%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	66.122,18	457.613,06	456.000,00	68.077,41	342,17	0,07%	0,00%	0,41%

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	125.687.925,10	0,00	0,00	125.674.504,04	-13.421,06	-0,01%	-	-
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.991.015,08	-8.984,92	-0,18%	2,44%	0,52%
Total Renda Fixa					4.333.605,67	0,43%	1,80%	

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(%)	
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	4.807.600,00	0,00	0,00	5.234.514,88	426.914,88	8,88%	0,00%	8,88%	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.060.113,09	0,00	0,00	1.135.340,91	75.227,82	7,10%	-	-	
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.060.000,00	0,00	0,00	1.100.000,00	40.000,00	3,77%	0,00%	3,77%	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	28.095.109,87	0,00	0,00	29.050.339,00	955.229,13	3,40%	4,19%	3,40%	
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.479.154,00	0,00	0,00	9.596.530,86	117.376,86	1,24%	2,17%	1,24%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	18.527.610,98	0,00	0,00	18.690.127,86	162.516,88	0,88%	0,90%	0,88%	
LSH FIP	1.233.100,68	0,00	0,00	1.232.509,88	-590,80	-0,05%	-	-	
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	482.731,21	0,00	0,00	482.334,21	-397,00	-0,08%	0,00%	0,00%	
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	5.379.726,73	0,00	0,00	5.371.277,70	-8.449,03	-0,16%	-	-	
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	804.697,18	0,00	0,00	802.896,42	-1.800,76	-0,22%	0,39%	-0,22%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	8.287.444,76	0,00	0,00	8.190.389,02	-97.055,74	-1,17%	0,00%	0,00%	
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	9.878.435,68	-121.564,32	-1,22%	7,52%	-1,88%	
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	42.704.416,75	0,00	0,00	42.030.709,69	-673.707,06	-1,58%	6,97%	-1,58%	
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	20.420.310,58	0,00	0,00	20.093.685,87	-326.624,71	-1,60%	8,23%	-1,60%	
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	6.928.037,68	0,00	0,00	6.811.964,51	-116.073,17	-1,68%	8,35%	-1,68%	
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.072.647,68	0,00	0,00	4.002.172,26	-70.475,42	-1,73%	8,56%	-1,73%	
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	23.467.572,36	0,00	0,00	23.037.083,44	-430.488,92	-1,83%	9,79%	-1,83%	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.490.781,61	0,00	0,00	15.044.210,65	-446.570,96	-2,88%	8,81%	-2,88%	
Total Renda Variável						-516.532,32	-0,26%	5,88%	