

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			108.154.075,77	8,23%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	37.643.654,23	2,86%	600	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	16.098.690,56	1,22%	27	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.372.241,66	2,23%	956	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.886.250,37	4,10%	355	1,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	90.056.013,45	6,85%	597	2,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	10.601.594,58	0,81%	165	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	147.439.069,37	11,22%	937	1,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.779.100,83	0,29%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	46.327.704,99	3,52%	29.200	2,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	7.119.902,10	0,54%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	31.368.664,96	2,39%	24	8,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	14.558.113,75	1,11%	73	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	75.127.507,03	5,72%	403	3,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	109.320.451,94	8,32%	258	2,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.345.650,13	0,71%	332	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	164.558.896,13	12,52%	102	9,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	133.048,12	0,01%	720	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ou D+5 du	Não há	11.092.093,22	0,84%	10.970	2,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	104.699.179,32	7,96%	19	11,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.926.570,73	1,36%	81	8,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	62.225,40	0,00%	127	2,50%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2019)

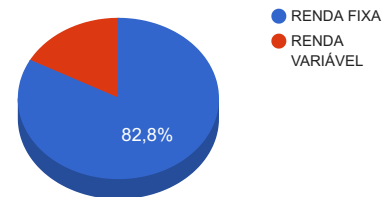
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	17.731.249,01	1,35%	7.384	1,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	21.395.484,38	1,63%	113	6,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	27.511.785,03	2,09%	69	10,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.498.393,79	0,34%	3.965	1,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	45.534.374,93	3,46%	4.849	3,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.630.425,67	0,58%	2.196	6,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	21.751.068,71	1,65%	52	2,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	D+2 a D+61	Não há	9.649.431,32	0,73%	4.526	2,73%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	18.948.283,28	1,44%	44	5,80%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	31.476.360,10	2,39%	7.119	3,98%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	689.082,71	0,05%	12	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	468.410,06	0,04%		0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.788.496,70	0,14%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.229.590,62	0,09%	17	1,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.327.542,30	0,41%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	1.981.438,47	0,15%		1,53%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	8.224.191,21	0,63%		11,94%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		Total	1.314.506.306,93				

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

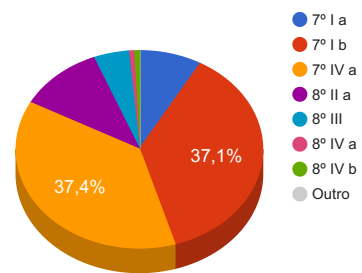
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	108.154.075,77	8,23%	7,00%	11,00%	15,00%	89.021.870,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	488.251.000,85	37,14%	25,00%	33,00%	60,00%	300.452.783,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	262.901.261,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	394.351.892,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	492.203.396,62	37,44%	5,00%	21,00%	40,00%	33.599.126,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	62.225,40	0,00%	1,00%	3,00%	5,00%	65.663.089,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	65.725.315,35
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	8,00%	10,00%	131.450.630,69
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	146.052.781,52	11,11%	0,00%	1,00%	10,00%	-14.602.150,83
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	60.763.157,41	4,62%	2,00%	5,00%	10,00%	70.687.473,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.814.039,68	0,67%	1,00%	3,00%	5,00%	56.911.275,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.205.629,68	0,78%	1,00%	3,00%	5,00%	55.519.685,67
Total Carteira		1.314.506.306,93					

RENDA FIXA	1.088.670.698,64	82,82%
RENDA VARIÁVEL	225.835.608,29	17,18%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	108.154.075,77	8,23%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	488.251.000,85	37,14%	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 "	492.203.396,62	37,44%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	62.225,40	0,00%	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 "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	146.052.781,52	11,11%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	60.763.157,41	4,62%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.814.039,68	0,67%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.205.629,68	0,78%	1,00%	5,00%
Total	1.314.506.306,93	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (julho / 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	377.904.627,80	28,75%	0,08%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	278.603.725,58	21,19%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	127.247.022,67	9,68%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	108.154.075,77	8,23%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	100.790.656,15	7,67%	0,01%
WESTERN ASSET	81.793.308,34	6,22%	0,18%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	46.327.704,99	3,52%	0,13%
Navi Capital	45.534.374,93	3,46%	2,69%
XP GESTÃO DE RECURSOS	32.870.344,00	2,50%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	27.511.785,03	2,09%	4,03%
ITAÚ DTVM	21.751.068,71	1,65%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	21.395.484,38	1,63%	0,09%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	17.731.249,01	1,35%	0,05%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.224.191,21	0,63%	1,86%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	7.119.902,10	0,54%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.327.542,30	0,41%	-%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.981.438,47	0,15%	0,02%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.788.496,70	0,14%	0,00%%
ROMA ASSET	1.229.590,62	0,09%	1,01%%
CAPITÂNIA	689.082,71	0,05%	0,01%%
BRASIL PLURAL	468.410,06	0,04%	0,00%%
Gradual Investimentos	62.225,40	0,00%	0,04%%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,51%	22,95%	12,19%	15,32%	38,55%	44,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,51%	22,61%	12,04%	15,10%	37,79%	43,76%	0,20%	1,891%	11,70%

IMA-B	1,29%	16,69%	8,92%	11,81%	27,47%	35,68%	-	-	-
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,45%	17,93%	10,00%	12,91%	28,62%	36,41%	0,50%	1,555%	8,00%
BRADERCO H NILO FI RENDA FIXA	1,42%	17,63%	9,96%	12,58%	29,16%	39,54%	0,30%	1,419%	8,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,27%	16,55%	8,83%	11,64%	27,24%	35,12%	0,20%	1,344%	7,75%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,23%	16,60%	8,86%	11,61%	27,49%	35,33%	0,20%	1,368%	8,06%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,08%	16,01%	8,22%	11,27%	27,14%	36,25%	0,40%	1,023%	7,14%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	9,24%	6,44%	6,66%	14,03%	16,07%	0,20%	1,222%	8,33%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	14,52%	8,99%	9,07%	23,30%	23,43%	0,20%	1,404%	11,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	6,52%	2,81%	5,11%	11,77%	20,90%	0,20%	0,503%	2,21%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,74%	2,30%	1,91%	1,24%	3,66%	6,90%	0,20%	0,383%	4,56%

IDKA IPCA 2 Anos	1,02%	7,33%	3,66%	5,99%	12,60%	22,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	6,95%	3,23%	5,61%	11,87%	21,28%	0,20%	0,578%	1,92%

IMA-B 5	0,97%	8,33%	4,13%	6,69%	14,08%	23,52%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,11%	10,63%	5,86%	8,26%	18,53%	28,01%	0,40%	0,963%	4,34%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	8,20%	4,09%	6,58%	13,86%	23,03%	0,20%	0,759%	2,93%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,87%	8,79%	4,33%	6,71%	14,72%	23,78%	0,50%	0,758%	3,08%
130% do CDI	0,74%	4,78%	2,07%	4,05%	8,33%	18,40%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-3,48%	-	-6,22%	-	-	-38,65%	2,50%	-	-
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,56%	3,64%	1,62%	3,09%	6,23%	13,60%	0,20%	0,014%	0,13%
BRANCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,55%	3,55%	1,54%	3,01%	6,17%	13,51%	0,15%	0,000%	0,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	3,01%	1,31%	2,55%	5,21%	11,47%	1,00%	0,005%	0,11%
IPCA	0,19%	2,42%	0,33%	2,10%	3,22%	7,85%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	12,15%	6,69%	9,01%	16,92%	25,04%	0,002	1,027%	3,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	9,39%	5,38%	6,85%	13,32%	22,76%	0,40%	0,570%	2,79%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,23%	6,07%	4,58%	4,49%	9,41%	12,26%	0,15%	0,762%	6,17%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	6,75%	27,31%	16,46%	16,36%	43,96%	59,44%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9,48%	21,85%	16,90%	14,46%	45,84%	78,61%	2,00%	6,692%	19,21%
IDIV	2,76%	21,95%	9,29%	8,41%	41,54%	57,67%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,74%	24,86%	9,14%	10,45%	48,31%	54,66%	3,00%	5,300%	21,36%
S&P 500	1,31%	18,89%	1,17%	10,22%	5,83%	20,65%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,45%	20,65%	1,69%	12,04%	9,85%	31,11%	1,00%	4,113%	18,28%
IFIX	1,27%	13,10%	6,02%	10,37%	23,45%	28,72%	-	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	19,21%	-7,22%	12,03%	1,89%	30,12%	31,71%	0,95%	33,000%	44,36%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano	0,90%	7,09%	2,31%	6,04%	11,41%	25,64%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
Ibovespa	0,84%	15,84%	5,67%	4,54%	28,52%	54,45%	-	-	-
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,26%	19,82%	8,61%	6,63%	35,77%	86,76%	1,50%	6,583%	18,10%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2,21%	17,04%	8,07%	6,52%	31,73%	53,91%	1,50%	6,042%	15,95%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	2,19%	17,17%	8,08%	6,09%	31,45%	58,26%	0,97%	5,735%	15,22%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	0,73%	16,32%	6,26%	4,27%	28,80%	56,40%	2,00%	5,915%	16,10%
CDI	0,57%	3,66%	1,59%	3,10%	6,35%	13,88%	-	-	-

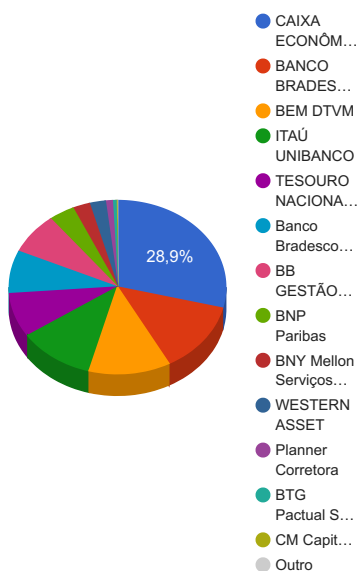
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,09%	2,37%	0,79%	2,27%	4,87%	14,41%	2,00%	0,815%	1,73%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,31%	-14,56%	-13,84%	-14,37%	-13,83%	-17,20%	0,55%	0,414%	10,94%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	-1,04%	2,44%	0,57%	1,80%	2,54%	13,64%	2,00%	1,895%	3,95%

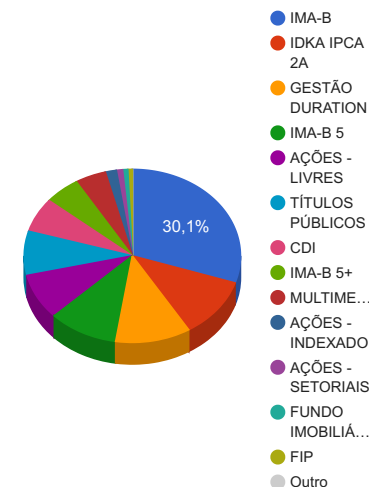
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	0,72%	24,19%	9,01%	10,14%	46,90%	50,93%	3,00%	5,246%	20,92%
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	0,020%	0,02%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	0,000%	2,18%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	380.161.534,56	28,92%
BANCO BRADESCO	173.904.546,26	13,23%
BEM DTVM	158.500.598,34	12,06%
ITAÚ UNIBANCO	148.998.091,38	11,33%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	108.154.075,77	8,23%
Banco Bradesco S.A.	104.699.179,32	7,96%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	100.790.656,15	7,67%
BNP Paribas	50.316.948,24	3,83%
BNY Mellon Serviços Financeiros	33.559.426,71	2,55%
WESTERN ASSET	31.476.360,10	2,39%
Planner Corretora	13.551.733,51	1,03%
BTG Pactual Serviços Financeiros	7.119.902,10	0,54%
CM Capital Markets DTVM	1.981.438,47	0,15%
Orla DTVM	1.229.590,62	0,09%
Genial Investimentos	62.225,40	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	395.164.203,26	30,06%
IDKA IPCA 2A	147.439.069,37	11,22%
GESTÃO DURATION	146.964.106,17	11,18%
IMA-B 5	136.295.872,46	10,37%
AÇÕES - LIVRES	112.172.893,35	8,53%
TÍTULOS PÚBLICOS	108.154.075,77	8,23%
CDI	84.606.205,28	6,44%
IMA-B 5+	69.984.940,93	5,32%
MULTIMERCADO	60.763.157,41	4,62%
AÇÕES - INDEXADO	21.751.068,71	1,65%
AÇÕES - SETORIAIS	12.128.819,46	0,92%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.205.629,68	0,78%
FIP	8.814.039,68	0,67%
FIDC - FECHADO	62.225,40	0,00%

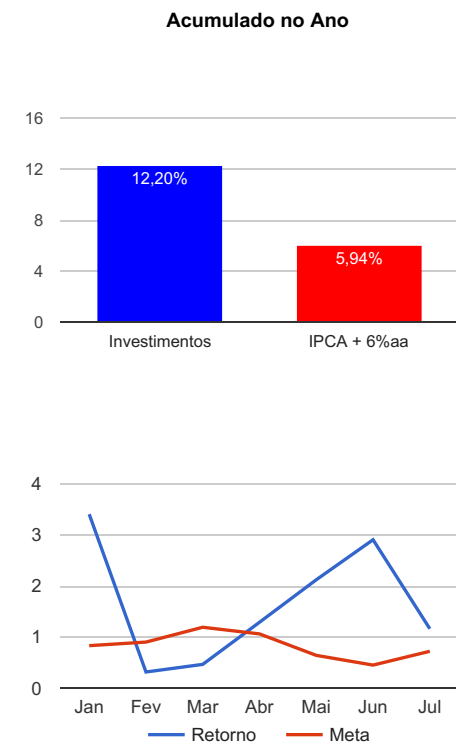


Carteira de Títulos Públicos - base (julho / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
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%
Março	1.198.910.406,03	24.125.861,96	21.274.753,47	1.207.336.133,89	5.574.619,37	0,46%	1,19%	38,86%	3,85%
Abril	1.207.336.133,89	21.419.310,76	17.281.213,69	1.227.075.509,54	15.601.278,58	1,29%	1,06%	121,54%	1,92%
Mai	1.227.075.509,54	193.552.763,06	190.070.280,01	1.256.633.223,52	26.075.230,93	2,12%	0,64%	330,75%	2,46%
Junho	1.256.633.223,52	61.792.710,06	67.598.792,68	1.287.288.076,29	36.460.935,39	2,90%	0,45%	644,29%	2,35%
Julho	1.287.288.076,29	35.248.135,94	32.350.351,55	1.305.160.656,80	14.974.796,12	1,16%	0,72%	160,26%	1,73%
Acumulado no ano					141.869.341,31	12,20%	5,94%	205,42%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.082.991,39	0,00	0,00	53.886.250,37	803.258,98	1,51%	1,89%	1,51%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	17.670.242,61	0,00	0,00	17.926.570,73	256.328,12	1,45%	1,55%	1,45%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	89.318.122,50	13.950.670,27	0,00	104.699.179,32	1.430.386,55	1,39%	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.002.839,35	0,00	0,00	29.372.241,66	369.402,31	1,27%	1,34%	1,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	162.559.042,51	0,00	0,00	164.558.896,13	1.999.853,62	1,23%	1,37%	1,23%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.033.435,95	0,00	0,00	7.119.902,10	86.466,15	1,23%	0,76%	1,23%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	31.023.395,26	0,00	0,00	31.368.664,96	345.269,70	1,11%	0,96%	1,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	37.231.604,23	0,00	0,00	37.643.654,23	412.050,00	1,11%	1,03%	1,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	45.833.642,89	0,00	0,00	46.327.704,99	494.062,10	1,08%	1,02%	1,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	89.194.562,54	0,00	0,00	90.056.013,45	861.450,91	0,97%	0,76%	0,97%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.420.476,81	0,00	0,00	14.558.113,75	137.636,94	0,95%	1,22%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	108.294.548,08	0,00	0,00	109.320.451,94	1.025.903,86	0,95%	0,57%	0,95%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.951.517,98	0,00	0,00	16.098.690,56	147.172,58	0,92%	1,40%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	146.098.729,88	0,00	0,00	147.439.069,37	1.340.339,49	0,92%	0,58%	0,92%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	10.996.167,71	0,00	0,00	11.092.093,22	95.925,51	0,87%	0,76%	0,87%
TÍTULOS PÚBLICOS	107.218.916,17	0,00	0,00	108.154.075,77	935.159,60	0,87%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.514.612,61	0,00	0,00	10.601.594,58	86.981,97	0,83%	0,50%	0,83%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.751.504,95	0,00	0,00	3.779.100,83	27.595,88	0,74%	0,38%	0,74%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	9.294.382,75	0,00	0,00	9.345.650,13	51.267,38	0,55%	0,00%	0,55%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	85.837.868,07	21.146.226,18	32.290.664,08	75.127.507,03	434.076,86	0,41%	0,01%	0,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.880,05	151.239,49	59.687,47	133.048,12	616,05	0,32%	0,00%	0,47%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	64.470,91	0,00	0,00	62.225,40	-2.245,51	-3,48%	-	-
Total Renda Fixa					11.338.959,05	1,05%	0,96%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	16.195.911,84	0,00	0,00	17.731.249,01	1.535.337,17	9,48%	6,69%	9,48%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	44.529.460,07	0,00	0,00	45.534.374,93	1.004.914,86	2,26%	6,58%	2,26%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	21.281.388,44	0,00	0,00	21.751.068,71	469.680,27	2,21%	6,04%	2,21%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	20.936.301,14	0,00	0,00	21.395.484,38	459.183,24	2,19%	5,74%	2,19%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	31.025.246,55	0,00	0,00	31.476.360,10	451.113,55	1,45%	4,11%	1,45%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.465.233,28	0,00	0,00	4.498.393,79	33.160,51	0,74%	5,30%	0,74%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	27.311.938,65	0,00	0,00	27.511.785,03	199.846,38	0,73%	5,92%	0,73%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	7.575.909,76	0,00	0,00	7.630.425,67	54.515,91	0,72%	5,25%	0,72%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.778.331,65	0,00	0,00	1.788.496,70	10.165,05	0,57%	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	18.931.633,60	0,00	0,00	18.948.283,28	16.649,68	0,09%	0,81%	0,09%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.981.257,76	0,00	0,00	1.981.438,47	180,71	0,01%	33,00%	19,21%
LSH FIP	1.230.328,95	0,00	0,00	1.229.590,62	-738,33	-0,06%	0,02%	-0,06%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	5.337.183,05	0,00	0,00	5.327.542,30	-9.640,75	-0,18%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	691.254,03	0,00	0,00	689.082,71	-2.171,32	-0,31%	0,41%	-0,31%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	470.150,28	0,00	0,00	468.410,06	-1.740,22	-0,37%	0,00%	0,00%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.751.181,93	0,00	0,00	9.649.431,32	-101.750,61	-1,04%	1,89%	-1,04%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	8.655.792,86	0,00	0,00	8.224.191,21	-431.601,65	-4,99%	-	-6,11%
Total Renda Variável					3.687.104,45	1,66%	5,36%	