

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			107.312.348,60	8,15%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	37.594.904,12	2,86%	630	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	15.770.463,00	1,20%	27	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.120.173,62	3,73%	962	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	63.356.953,59	4,81%	351	2,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	80.109.557,91	6,09%	605	1,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	10.337.159,08	0,79%	165	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	143.693.495,48	10,92%	940	1,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.687.667,08	0,28%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	24.473.818,45	1,86%	31.062	1,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.927.273,13	0,53%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	41.247.784,36	3,13%	27	8,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	14.166.072,64	1,08%	73	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	43.595.019,08	3,31%	387	1,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	109.666.849,11	8,33%	271	2,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.391.314,59	0,71%	362	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	163.830.494,79	12,45%	107	9,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.936,57	0,00%	733	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ou D+5 du	Não há	11.099.423,26	0,84%	12.229	2,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	104.138.633,52	7,91%	19	11,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	32.668.074,41	2,48%	89	13,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	60.862,42	0,00%	127	2,50%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2019)

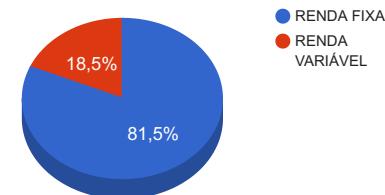
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	22.944.285,13	1,74%	7.880	1,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	31.244.327,90	2,37%	116	8,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	29.346.783,33	2,23%	69	11,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.681.611,82	0,36%	3.921	1,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	46.684.032,66	3,55%	4.750	3,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.935.653,52	0,60%	2.168	6,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	21.801.590,45	1,66%	51	2,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	D+2 a D+61	Não há	9.725.399,30	0,74%	4.379	2,81%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	19.095.671,39	1,45%	39	7,07%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	31.031.489,72	2,36%	6.716	4,18%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	688.673,87	0,05%	12	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	448.826,36	0,03%	34	0,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.783.363,01	0,14%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.228.995,48	0,09%	17	1,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	5.318.339,25	0,40%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	1.960.421,61	0,15%		1,58%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	8.220.642,88	0,62%		11,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		Total	1.316.397.386,49				

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

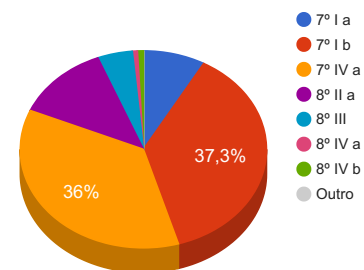
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	107.312.348,60	8,15%	7,00%	11,00%	15,00%	90.147.259,37
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	490.485.322,46	37,26%	25,00%	33,00%	60,00%	299.353.109,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	263.279.477,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	7,00%	30,00%	394.919.215,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	474.398.745,33	36,04%	5,00%	21,00%	40,00%	52.160.209,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	60.862,42	0,00%	1,00%	3,00%	5,00%	65.759.006,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	65.819.869,32
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	8,00%	10,00%	131.639.738,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	164.638.284,81	12,51%	0,00%	1,00%	10,00%	-32.998.546,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	60.541.234,28	4,60%	2,00%	5,00%	10,00%	71.098.504,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.779.524,10	0,67%	1,00%	3,00%	5,00%	57.040.345,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.181.064,49	0,77%	1,00%	3,00%	5,00%	55.638.804,83
Total Carteira		1.316.397.386,49					

RENDA FIXA	1.072.257.278,81	81,45%
RENDA VARIÁVEL	244.140.107,68	18,55%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	107.312.348,60	8,15%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	490.485.322,46	37,26%	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 "	474.398.745,33	36,04%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	60.862,42	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 "	164.638.284,81	12,51%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	60.541.234,28	4,60%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.779.524,10	0,67%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.181.064,49	0,77%	1,00%	5,00%
Total	1.316.397.386,49	100,00%	50,00	220,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (agosto / 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	370.984.748,61	28,18%	0,07%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	277.360.442,90	21,07%	0,03%
ITAÚ UNIBANCO	142.334.923,52	10,81%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	107.312.348,60	8,15%	-
WESTERN ASSET	91.374.945,47	6,94%	0,21%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	90.455.653,56	6,87%	0,01%
Navi Capital	46.684.032,66	3,55%	2,77%
XP GESTÃO DE RECURSOS	33.442.087,90	2,54%	0,00%
Vinci Gestão de Patrimônio Ltda	31.244.327,90	2,37%	0,13%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	29.346.783,33	2,23%	4,13%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	24.473.818,45	1,86%	0,07%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	22.944.285,13	1,74%	0,07%
ITAÚ DTVM	21.801.590,45	1,66%	0,00%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	8.220.642,88	0,62%	1,86%
BTG Pactual Asset Management S.A. DTVM	6.927.273,13	0,53%	0,01%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
A5 CAPITAL PARTNERS	5.318.339,25	0,40%	-%
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.960.421,61	0,15%	0,02%%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	1.783.363,01	0,14%	0,00%%
ROMA ASSET	1.228.995,48	0,09%	1,01%%
CAPITÂNIA	688.673,87	0,05%	0,01%%
BRASIL PLURAL	448.826,36	0,03%	0,00%%
Gradual Investimentos	60.862,42	0,00%	0,04%%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
130% do CDI	0,65%	5,47%	2,01%	4,06%	8,24%	17,95%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-2,19%	-	-14,71%	-	-	-39,31%	2,50%	-	-

CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,49%	4,15%	1,54%	3,11%	6,20%	13,25%	0,20%	0,020%	0,13%
BRASECO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,49%	4,06%	1,50%	3,02%	6,10%	13,17%	0,15%	0,003%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	3,43%	1,26%	2,55%	5,15%	11,14%	1,00%	0,005%	0,10%

IPCA	0,11%	2,54%	0,31%	1,77%	3,43%	7,77%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,32%	9,73%	3,85%	6,83%	13,26%	21,71%	0,40%	0,534%	2,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	12,00%	3,74%	8,33%	16,60%	23,55%	0,002	1,744%	3,51%

IDKA IPCA 2 Anos	0,08%	7,42%	2,35%	5,52%	12,59%	21,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,10%	7,06%	2,25%	5,13%	11,98%	20,25%	0,20%	0,743%	1,87%

IMA-B 5	0,05%	8,38%	2,76%	6,16%	14,43%	22,05%	-	-	-
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,07%	8,86%	2,93%	6,29%	15,00%	22,42%	0,50%	1,175%	2,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,03%	8,23%	2,72%	6,06%	14,19%	21,56%	0,20%	1,022%	2,79%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,23%	10,38%	3,36%	7,62%	19,11%	26,17%	0,40%	1,498%	4,10%

IMA-B 5+	-0,77%	22,00%	5,82%	13,81%	38,20%	41,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,79%	21,65%	5,75%	13,61%	37,44%	40,76%	0,20%	3,613%	11,78%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-0,40%	16,22%	4,65%	10,75%	27,53%	33,35%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	6,70%	2,03%	4,74%	12,02%	19,92%	0,20%	0,554%	2,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,04%	15,97%	4,31%	10,63%	26,82%	34,04%	0,40%	2,224%	7,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,42%	16,06%	4,57%	10,60%	27,30%	32,79%	0,20%	2,483%	7,74%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,43%	17,42%	5,32%	11,84%	28,74%	34,06%	0,50%	2,701%	7,97%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,44%	16,08%	4,53%	10,54%	27,74%	32,89%	0,20%	2,521%	7,99%
BRANCO H NILO FI RENDA FIXA	-0,54%	17,00%	5,07%	11,45%	29,13%	36,14%	0,30%	2,739%	8,41%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,04%	12,19%	2,48%	8,81%	24,12%	22,30%	0,20%	3,802%	11,02%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,42%	-0,17%	-1,10%	0,97%	3,84%	6,03%	0,20%	4,181%	4,44%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,69%	6,30%	1,16%	5,76%	14,70%	14,00%	0,20%	4,432%	8,01%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,71%	3,20%	0,20%	3,57%	9,94%	10,48%	0,15%	4,206%	5,85%

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

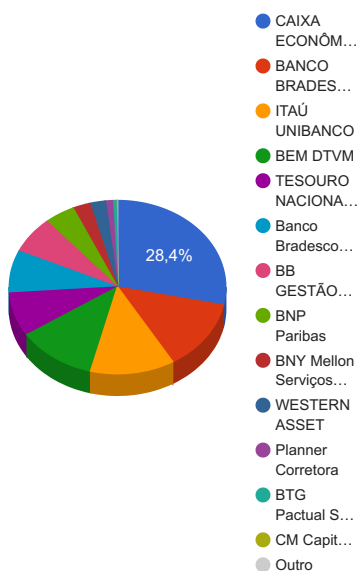
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	2,23%	24,66%	8,32%	13,12%	50,25%	50,69%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,07%	29,95%	9,68%	16,98%	64,70%	56,40%	3,00%	12,715%	18,50%
IPCA + 8,00% ao ano	0,78%	7,93%	2,29%	5,76%	11,60%	25,51%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
CDI	0,50%	4,18%	1,55%	3,11%	6,28%	13,54%	-	-	-
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	0,79%	3,24%	1,21%	1,34%	5,50%	13,44%	2,00%	3,758%	3,11%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,78%	3,17%	1,58%	2,17%	6,15%	14,54%	2,00%	1,026%	1,50%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,06%	-14,61%	-11,09%	-14,23%	-14,31%	-16,99%	0,55%	0,237%	10,86%
SMLL	0,48%	27,92%	14,76%	19,08%	51,06%	47,54%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,93%	24,20%	17,73%	20,13%	55,93%	67,83%	2,00%	12,993%	17,25%
S&P 500	-1,81%	16,74%	6,34%	5,10%	0,86%	18,40%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-1,41%	18,94%	7,14%	6,82%	4,43%	27,88%	1,00%	11,998%	18,14%
Ibovespa	-0,67%	15,07%	4,23%	5,81%	31,90%	42,77%	-	-	-
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,52%	22,84%	9,57%	11,07%	46,30%	79,36%	1,50%	10,630%	16,14%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,23%	17,31%	7,24%	8,50%	37,87%	44,60%	1,50%	11,387%	14,47%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	0,10%	17,28%	6,73%	8,22%	35,73%	49,06%	0,97%	10,591%	14,29%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,37%	15,89%	4,32%	5,82%	32,26%	45,70%	2,00%	11,121%	15,38%

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

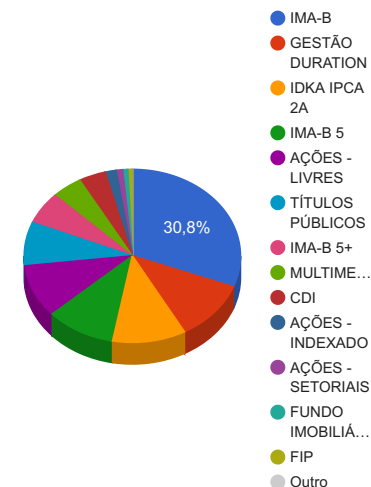
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	-0,11%	12,97%	4,07%	9,12%	24,18%	27,48%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	-4,63%	-11,51%	10,75%	-6,36%	-6,16%	14,19%	0,95%	22,792%	31,10%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	4,00%	29,16%	9,49%	16,50%	62,83%	53,42%	3,00%	12,609%	18,12%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	0,011%	0,02%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	6,719%	4,46%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	373.216.937,98	28,35%
BANCO BRADESCO	173.221.809,38	13,16%
ITAÚ UNIBANCO	164.136.513,97	12,47%
BEM DTVM	154.693.247,47	11,75%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	107.312.348,60	8,15%
Banco Bradesco S.A.	104.138.633,52	7,91%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	90.455.653,56	6,87%
BNP Paribas	60.343.455,75	4,58%
BNY Mellon Serviços Financeiros	34.130.761,77	2,59%
WESTERN ASSET	31.031.489,72	2,36%
Planner Corretora	13.538.982,13	1,03%
BTG Pactual Serviços Financeiros	6.927.273,13	0,53%
CM Capital Markets DTVM	1.960.421,61	0,15%
Orla DTVM	1.228.995,48	0,09%
Genial Investimentos	60.862,42	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	405.661.699,64	30,82%
GESTÃO DURATION	147.261.753,23	11,19%
IDKA IPCA 2A	143.693.495,48	10,92%
IMA-B 5	136.144.432,61	10,34%
AÇÕES - LIVRES	130.219.429,02	9,89%
TÍTULOS PÚBLICOS	107.312.348,60	8,15%
IMA-B 5+	79.127.416,59	6,01%
MULTIMERCADO	60.541.234,28	4,60%
CDI	52.995.270,24	4,03%
AÇÕES - INDEXADO	21.801.590,45	1,66%
AÇÕES - SETORIAIS	12.617.265,34	0,96%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.181.064,49	0,77%
FIP	8.779.524,10	0,67%
FIDC - FECHADO	60.862,42	0,00%



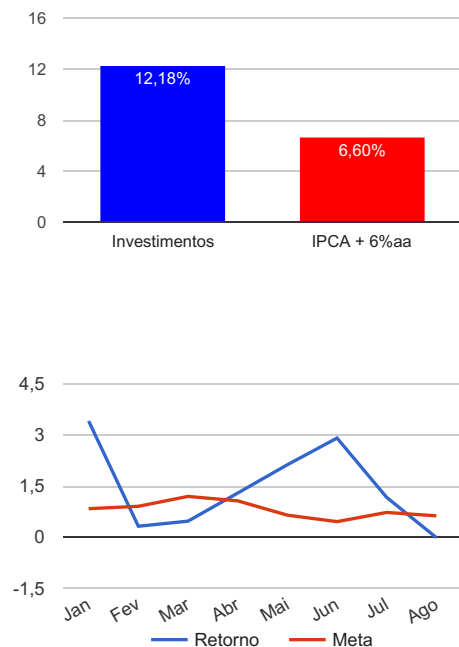
Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 2019)

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%
Agosto	1.305.160.656,80	95.535.878,78	93.444.789,46	1.307.006.071,90	-245.674,22	-0,02%	0,62%	-3,03%	3,43%
Acumulado no ano					141.623.667,09	12,18%	6,60%	184,63%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	9.345.650,13	0,00	0,00	9.391.314,59	45.664,46	0,49%	0,00%	0,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	109.320.451,94	0,00	0,00	109.666.849,11	346.397,17	0,32%	0,53%	0,32%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	46.327.704,99	0,00	22.000.000,00	24.473.818,45	146.113,46	0,32%	2,22%	-0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	75.127.507,03	23.370.643,17	55.140.590,58	43.595.019,08	237.459,46	0,24%	0,02%	0,49%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.779.100,83	0,00	100.284,17	3.687.667,08	8.850,42	0,23%	4,18%	-2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.601.594,58	0,00	282.704,36	10.337.159,08	18.268,86	0,17%	0,55%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	133.048,12	165.235,61	289.822,37	8.936,57	475,21	0,16%	0,00%	0,41%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.098.690,56	0,00	353.335,44	15.770.463,00	25.107,88	0,16%	3,80%	-2,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	147.439.069,37	0,00	3.900.000,00	143.693.495,48	154.426,11	0,10%	0,74%	0,10%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	11.092.093,22	0,00	0,00	11.099.423,26	7.330,04	0,07%	1,17%	0,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	90.056.013,45	0,00	10.000.000,00	80.109.557,91	53.544,46	0,06%	1,02%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.558.113,75	0,00	398.770,87	14.166.072,64	6.729,76	0,05%	4,43%	-2,69%
TÍTULOS PÚBLICOS	108.154.075,77	0,00	802.046,44	107.312.348,60	-39.680,73	-0,04%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	37.643.654,23	0,00	0,00	37.594.904,12	-48.750,11	-0,13%	1,74%	-0,13%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.119.902,10	0,00	177.235,23	6.927.273,13	-15.393,74	-0,22%	4,21%	-2,71%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	31.368.664,96	10.000.000,00	0,00	41.247.784,36	-120.880,60	-0,29%	1,50%	-0,23%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	164.558.896,13	0,00	0,00	163.830.494,79	-728.401,34	-0,44%	2,52%	-0,44%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.372.241,66	20.000.000,00	0,00	49.120.173,62	-252.068,04	-0,51%	2,48%	-0,42%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	104.699.179,32	0,00	0,00	104.138.633,52	-560.545,80	-0,54%	2,74%	-0,54%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	17.926.570,73	15.000.000,00	0,00	32.668.074,41	-258.496,32	-0,79%	2,70%	-0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.886.250,37	10.000.000,00	0,00	63.356.953,59	-529.296,78	-0,83%	3,61%	-0,79%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	62.225,40	0,00	0,00	60.862,42	-1.362,98	-2,19%	-	-
Total Renda Fixa					-1.504.509,15	-0,14%	1,82%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.498.393,79	0,00	0,00	4.681.611,82	183.218,03	4,07%	12,72%	4,07%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	7.630.425,67	0,00	0,00	7.935.653,52	305.227,85	4,00%	12,61%	4,00%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	45.534.374,93	0,00	0,00	46.684.032,66	1.149.657,73	2,52%	10,63%	2,52%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	17.731.249,01	5.000.000,00	0,00	22.944.285,13	213.036,12	0,94%	12,99%	1,93%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.649.431,32	0,00	0,00	9.725.399,30	75.967,98	0,79%	3,76%	0,79%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	18.948.283,28	0,00	0,00	19.095.671,39	147.388,11	0,78%	1,03%	0,78%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	21.751.068,71	0,00	0,00	21.801.590,45	50.521,74	0,23%	11,39%	0,23%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	8.224.191,21	0,00	0,00	8.220.642,88	-3.548,33	-0,04%	-	1,15%
LSH FIP	1.229.590,62	0,00	0,00	1.228.995,48	-595,14	-0,05%	0,01%	-0,05%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	689.082,71	0,00	0,00	688.673,87	-408,84	-0,06%	0,24%	-0,06%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	5.327.542,30	0,00	0,00	5.318.339,25	-9.203,05	-0,17%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.788.496,70	0,00	0,00	1.783.363,01	-5.133,69	-0,29%	-	-
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	21.395.484,38	10.000.000,00	0,00	31.244.327,90	-151.156,48	-0,48%	10,59%	0,10%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	27.511.785,03	2.000.000,00	0,00	29.346.783,33	-165.001,70	-0,56%	11,12%	-0,37%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.981.438,47	0,00	0,00	1.960.421,61	-21.016,86	-1,06%	22,79%	-4,63%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	31.476.360,10	0,00	0,00	31.031.489,72	-444.870,38	-1,41%	12,00%	-1,41%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	468.410,06	0,00	0,00	448.826,36	-19.583,70	-4,18%	6,72%	-4,18%
Total Renda Variável					1.304.499,39	0,54%	10,21%	