

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º 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 (março / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			15.598,47	0,00%			Artigo 20
TÍTULOS PÚBLICOS			257.693.151,55	35,44%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	121.986,66	0,02%	11	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.343.806,06	1,01%	295	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.192.132,50	1,40%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.967.234,07	3,02%	1.248	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	10.190.880,00	1,40%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.274.253,74	1,96%	1.454	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.392.048,45	2,12%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.298.530,24	1,83%	547	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.723.190,00	0,92%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	12.988.539,06	1,79%	775	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	30.247.969,18	4,16%	213	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	51.908.966,85	7,14%	78	13,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.006.100,97	0,14%	33	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	56.120.450,54	7,72%	399	0,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	42.779.159,63	5,88%	416	0,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	13.383,95	0,00%		3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	2.581.951,78	0,36%	155	2,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	11.747.064,43	1,62%	74	5,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.898.977,54	1,09%	5.156	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	Não há	6.133.606,99	0,84%	55	4,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2019)

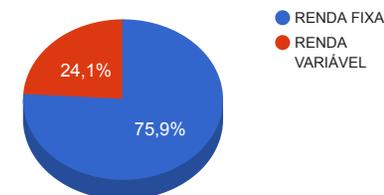
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	10.310.621,05	1,42%	149	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	17.987.606,27	2,47%	55	8,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.069.156,33	0,83%	592	11,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou D+18 (isento de taxa de	Não há	3.447.224,87	0,47%	971	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	(resgate) D+24 dia	Não há	5.844.275,02	0,80%	21.837	0,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.701.930,31	1,06%	6.629	0,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	4.360.857,84	0,60%	729	1,61%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.745.838,30	0,79%	76	4,02%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	22.898.021,80	3,15%	230	4,15%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.097.680,19	1,25%	3.732	1,27%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	11.707.381,06	1,61%	4.456	1,64%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	7.650.075,27	1,05%	5.858	2,53%	Artigo 8º, Inciso III
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	8.974.686,50	1,23%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	11.750.896,89	1,62%		16,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	8.457.141,80	1,16%		5,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.569.850,64	0,63%		0,19%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			727.212.226,80				

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

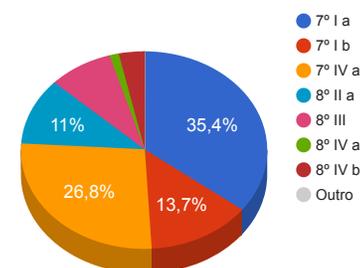
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	257.693.151,55	35,44%	0,00%	20,00%	50,00%	105.912.961,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	99.504.061,72	13,68%	15,00%	15,00%	70,00%	409.544.497,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	436.327.336,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	195.051.186,23	26,82%	10,00%	25,00%	40,00%	95.833.704,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	13.383,95	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	36.347.227,39
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	79.722.414,59	10,96%	7,00%	10,00%	20,00%	65.720.030,77
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	61.459.854,46	8,45%	7,00%	10,00%	10,00%	11.261.368,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.974.686,50	1,23%	2,00%	5,00%	5,00%	27.385.924,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	24.777.889,33	3,41%	2,00%	5,00%	5,00%	11.582.722,01
Total Carteira		727.196.628,33					

RENDA FIXA	552.277.381,92	75,95%
RENDA VARIÁVEL	174.934.844,88	24,06%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	257.693.151,55	35,44%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	99.504.061,72	13,68%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	195.051.186,23	26,82%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	13.383,95	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	79.722.414,59	10,96%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	61.459.854,46	8,45%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.974.686,50	1,23%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	24.777.889,33	3,41%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	727.196.628,33	100,00%	45,00	290,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (março / 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
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	257.693.151,55	35,44%	-
BRABESCO ASSET MANAGEMENT	115.495.210,11	15,88%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	109.325.534,96	15,03%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	104.531.979,89	14,37%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	40.558.590,23	5,58%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	23.250.983,12	3,20%	0,07%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	14.332.848,67	1,97%	3,25%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTO LTDA	11.747.064,43	1,62%	2,17%
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	8.974.686,50	1,23%	199,65%
ZION Invest	8.457.141,80	1,16%	1,72%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	6.751.939,27	0,93%	0,99%
VINCI PARTNERS	6.133.606,99	0,84%	0,03%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	6.069.156,33	0,83%	0,01%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.569.850,64	0,63%	0,28%
Occam Brasil	3.447.224,87	0,47%	0,03%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BRASIL PLURAL	13.383,95	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,19%	2,95%	2,95%	4,84%	10,80%	20,46%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	-0,31%	-0,31%	1,75%	4,25%	7,43%	0,20%	0,141%	4,06%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	-0,34%	-0,34%	1,72%	4,19%	7,30%	0,20%	0,141%	4,09%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,98%	-0,34%	-0,34%	1,70%	4,15%	7,23%	0,20%	0,141%	4,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	3,26%	3,26%	9,58%	9,27%	23,38%	0,15%	1,746%	4,52%

IPCA	0,75%	1,51%	1,51%	1,90%	4,58%	7,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,54%	3,96%	3,96%	7,52%	8,97%	19,63%	0,002	4,048%	3,33%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,49%	2,89%	2,89%	8,63%	8,96%	-	0,40%	1,751%	2,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,39%	3,12%	3,12%	5,99%	8,05%	18,72%	0,40%	1,888%	1,89%

CDI + 3,50% ao ano	0,73%	2,36%	2,36%	4,82%	10,03%	23,35%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-10,77%	-29,02%	-29,02%	-49,72%	-59,52%	-80,37%	0,20%	-	-

IMA-B	0,58%	5,54%	5,54%	15,99%	13,71%	25,92%	-	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,66%	2,01%	2,01%	0,19%	0,64%	5,50%	0,20%	0,136%	3,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	5,46%	5,46%	15,78%	13,40%	25,24%	0,20%	4,049%	5,94%

IRF-M 1	0,47%	1,53%	1,53%	3,59%	6,68%	16,65%	-	-	-
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	1,46%	1,46%	3,47%	6,42%	16,15%	0,20%	0,093%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	1,47%	1,47%	3,51%	6,50%	16,26%	0,20%	0,094%	0,54%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	1,46%	1,46%	3,49%	6,45%	16,15%	0,10%	0,106%	0,55%
Selic	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,35%	15,28%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,47%	1,49%	1,49%	3,03%	6,22%	15,57%	0,20%	0,008%	0,01%
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	1,48%	1,48%	3,00%	6,23%	15,23%	0,20%	0,005%	0,04%
IMA-B 5+	0,43%	7,66%	7,66%	23,23%	17,28%	29,29%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,49%	2,62%	2,62%	8,14%	7,73%	23,71%	0,50%	0,735%	3,55%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

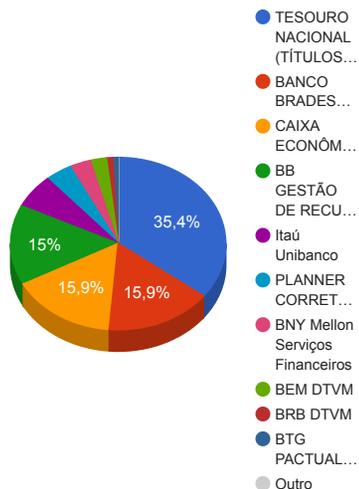
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,99%	5,58%	5,58%	16,31%	5,32%	22,14%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,14%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano	1,34%	3,42%	3,42%	5,80%	12,87%	24,98%	-	-	-
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,20%	-	-
CDI	0,47%	1,51%	1,51%	3,07%	6,34%	15,26%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,48%	4,17%	4,17%	8,95%	10,26%	23,06%	0,50%	3,156%	3,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,44%	1,86%	1,86%	3,68%	7,03%	19,01%	0,60%	0,266%	2,59%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,40%	1,60%	1,60%	3,19%	6,66%	16,74%	1,00%	0,142%	0,56%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,23%	3,29%	3,29%	7,52%	7,19%	21,82%	1,00%	3,609%	6,53%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,09%	0,49%	0,49%	3,37%	-	-	1,50%	1,978%	2,46%
SMLL	0,10%	7,53%	7,53%	29,53%	11,77%	49,58%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,68%	1,65%	1,65%	28,37%	12,57%	58,83%	2,00%	12,507%	21,21%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-1,77%	8,77%	8,77%	33,64%	14,64%	52,43%	1,72%	10,810%	19,17%
IDIV	-1,79%	8,23%	8,23%	30,23%	13,71%	37,90%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,36%	5,39%	5,39%	20,77%	4,97%	28,16%	2,50%	10,732%	19,37%
Ibovespa	-0,18%	8,56%	8,56%	20,26%	11,77%	46,83%	-	-	-

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

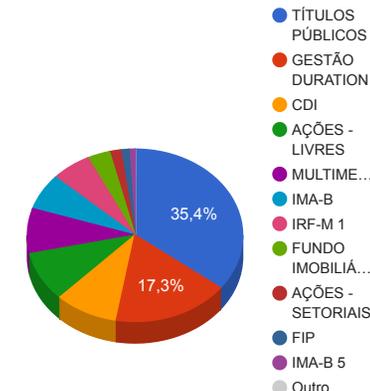
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,39%	8,00%	8,00%	17,00%	13,35%	42,13%	1,00%	12,474%	21,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,32%	1,16%	1,16%	4,49%	5,58%	-	1,60%	0,274%	2,30%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,21%	9,28%	9,28%	20,81%	15,71%	49,63%	2,00%	12,621%	23,15%
OCCAM FIC AÇÕES	-0,32%	7,34%	7,34%	20,07%	13,54%	55,46%	3,00%	11,696%	21,15%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-0,79%	4,04%	4,04%	18,55%	11,64%	55,00%	2,00%	13,655%	22,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,92%	5,69%	5,69%	28,79%	19,15%	57,15%	2,50%	13,650%	20,53%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,68%	7,07%	7,07%	22,01%	15,82%	53,79%	1,90%	11,919%	20,82%
IBX	-0,11%	8,64%	8,64%	21,56%	12,67%	47,89%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-0,90%	7,84%	7,84%	24,58%	11,33%	41,84%	2,00%	11,142%	19,80%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-12,94%	-13,95%	-13,95%	-21,69%	-37,02%	-1,33%	1,60%	20,975%	80,99%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	257.693.151,55	35,44%
BANCO BRADESCO	115.495.210,11	15,88%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	115.459.141,95	15,88%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	109.101.830,53	15,00%
Itaú Unibanco	46.402.865,25	6,38%
PLANNER CORRETORA	29.182.725,19	4,01%
BNY Mellon Serviços Financeiros	23.250.983,12	3,20%
BEM DTVM	17.776.241,08	2,44%
BRB DTVM	6.751.939,27	0,93%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	6.069.156,33	0,83%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.598,47	0,00%
Geração Futuro	13.383,95	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	257.693.151,55	35,44%
GESTÃO DURATION	125.942.196,63	17,32%
CDI	69.108.989,60	9,50%
AÇÕES - LIVRES	67.519.651,27	9,28%
MULTIMERCADO	61.459.854,46	8,45%
IMA-B	49.195.577,85	6,76%
IRF-M 1	43.585.293,87	5,99%
FUNDO IMOBILIÁRIO	24.777.889,33	3,41%
AÇÕES - SETORIAIS	12.202.763,32	1,68%
FIP	8.974.686,50	1,23%
IMA-B 5	6.723.190,00	0,92%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.598,47	0,00%
FIDC - FECHADO	13.383,95	0,00%



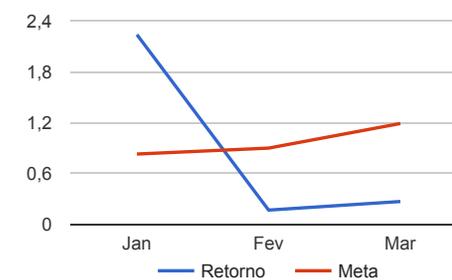
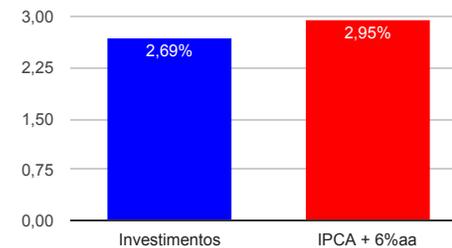
Carteira de Títulos Públicos - base (março / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7000	3.029,485123	3.447,540659	21.206.395,86	24.132.784,61
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	3.447,540659	29.679.727,38	34.475.406,59
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	3.447,540659	29.808.866,31	34.475.406,59
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	3.447,540659	29.710.101,11	34.475.406,59
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.442,702306	44.449.546,19	51.640.534,59
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.442,702306	38.734.566,65	44.755.129,98
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.442,702306	28.528.215,62	33.738.482,60

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	692.893.064,78	8.215.774,98	1.996.691,35	714.759.218,64	15.647.070,23	2,24%	0,83%	269,13%	2,10%
Fevereiro	714.759.218,64	82.854.012,08	78.787.984,12	720.039.386,61	1.214.140,01	0,17%	0,90%	18,86%	2,51%
Março	720.039.386,61	56.371.812,10	51.173.520,00	727.196.628,33	1.958.949,62	0,27%	1,19%	22,63%	3,76%
Acumulado no ano					18.820.159,86	2,69%	2,95%	91,13%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.657.365,00	0,00	0,00	6.723.190,00	65.825,00	0,99%	0,14%	0,99%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.092.465,00	0,00	0,00	10.192.132,50	99.667,50	0,99%	0,14%	0,99%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.091.715,00	0,00	0,00	10.190.880,00	99.165,00	0,98%	0,14%	0,98%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	6.122.816,00	0,00	6.173.520,00	0,00	50.704,00	0,83%	2,57%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.270.515,63	0,00	0,00	15.392.048,45	121.532,82	0,80%	1,75%	0,80%
TÍTULOS PÚBLICOS	255.771.646,75	0,00	0,00	257.693.151,55	1.921.504,80	0,75%	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	121.182,03	0,00	0,00	121.986,66	804,63	0,66%	0,14%	0,66%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.224.668,19	0,00	0,00	13.298.530,24	73.862,05	0,56%	4,05%	0,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	42.547.455,05	0,00	0,00	42.779.159,63	231.704,58	0,54%	4,05%	0,54%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.001.192,22	0,00	0,00	1.006.100,97	4.908,75	0,49%	0,73%	0,49%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	55.859.325,31	0,00	0,00	56.120.450,54	261.125,23	0,47%	0,01%	0,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	12.928.945,58	0,00	0,00	12.988.539,06	59.593,48	0,46%	0,00%	0,46%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	36.293.978,62	15.377.735,90	0,00	51.908.966,85	237.252,33	0,46%	1,75%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.871.346,63	0,00	0,00	21.967.234,07	95.887,44	0,44%	0,11%	0,44%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.940.974,00	371.381,25	0,00	7.343.806,06	31.450,81	0,43%	0,09%	0,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	15.145.684,30	15.000.000,00	0,00	30.247.969,18	102.284,88	0,34%	1,89%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	52.698.629,68	6.481.122,95	45.000.000,00	14.274.253,74	94.501,11	0,16%	0,09%	0,44%
MASTER III FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	14.999,93	0,00	0,00	13.383,95	-1.615,98	-10,77%	-	-
Total Renda Fixa					3.550.158,43	0,63%	1,40%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	11.665.002,96	0,00	0,00	11.750.896,89	85.893,93	0,74%	-	1,39%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.546.559,98	0,00	0,00	4.569.850,64	23.290,66	0,51%	-	0,00%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	5.722.838,09	0,00	0,00	5.745.838,30	23.000,21	0,40%	0,14%	0,40%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	17.917.998,55	0,00	0,00	17.987.606,27	69.607,72	0,39%	12,47%	0,39%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	12.782.312,56	10.028.500,00	0,00	22.898.021,80	87.209,24	0,38%	0,27%	0,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	4.346.777,01	0,00	0,00	4.360.857,84	14.080,83	0,32%	0,27%	0,32%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	11.680.700,64	0,00	0,00	11.707.381,06	26.680,42	0,23%	3,61%	0,23%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	7.642.967,34	0,00	0,00	7.650.075,27	7.107,93	0,09%	1,98%	0,09%
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	8.985.782,82	0,00	0,00	8.974.686,50	-11.096,32	-0,12%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	9.113.072,00	0,00	9.097.680,19	-15.391,81	-0,17%	3,16%	0,48%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	11.772.164,05	0,00	0,00	11.747.064,43	-25.099,62	-0,21%	12,62%	-0,21%
OCCAM FIC AÇÕES	3.458.200,94	0,00	0,00	3.447.224,87	-10.976,07	-0,32%	11,70%	-0,32%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7.961.783,48	0,00	0,00	7.898.977,54	-62.805,94	-0,79%	13,65%	-0,79%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.605.472,15	0,00	0,00	2.581.951,78	-23.520,37	-0,90%	11,14%	-0,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.406.412,42	0,00	0,00	10.310.621,05	-95.791,37	-0,92%	13,65%	-0,92%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.153.132,12	0,00	0,00	6.069.156,33	-83.975,79	-1,36%	10,73%	-1,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.944.352,83	0,00	0,00	5.844.275,02	-100.077,81	-1,68%	11,92%	-1,68%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.833.867,77	0,00	0,00	7.701.930,31	-131.937,46	-1,68%	12,51%	-1,68%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	6.243.871,48	0,00	0,00	6.133.606,99	-110.264,49	-1,77%	10,81%	-1,77%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	9.714.284,50	0,00	0,00	8.457.141,80	-1.257.142,70	-12,94%	20,98%	-12,94%
Total Renda Variável					-1.591.208,81	-0,90%	8,42%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	253.703.227,23	0,00	3.541.437,62	257.693.151,55	7.531.361,94	2,98%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	41.149.735,78	0,00	0,00	42.779.159,63	1.629.423,85	3,96%	3,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.954.480,00	0,00	15.000.000,00	13.298.530,24	1.344.050,24	5,30%	5,46%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	55.295.168,16	0,00	0,00	56.120.450,54	825.282,38	1,49%	1,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	38.278.177,52	38.490.743,58	63.055.292,81	14.274.253,74	560.625,45	1,02%	1,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	14.744.507,60	15.000.000,00	0,00	30.247.969,18	503.461,58	3,07%	3,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.301.853,98	0,00	404.379,17	15.392.048,45	494.573,64	3,25%	3,26%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.528.601,93	371.381,25	35.000.000,00	7.343.806,06	443.822,88	1,43%	1,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.651.225,11	0,00	0,00	21.967.234,07	316.008,96	1,46%	1,46%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.226.602,50	0,00	296.205,20	10.192.132,50	261.735,20	2,59%	-0,34%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.225.200,00	0,00	294.414,34	10.190.880,00	260.094,34	2,57%	-0,34%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	700.806,12	50.956.023,16	0,00	51.908.966,85	252.137,57	1,75%	2,89%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.984.256,00	0,00	6.173.520,00	0,00	189.264,00	3,16%	3,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	12.320.566,11	481.879,17	0,00	12.988.539,06	186.093,78	1,47%	1,48%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.744.125,00	0,00	193.807,36	6.723.190,00	172.872,36	2,59%	-0,31%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.006.100,97	6.100,97	0,61%	2,62%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	119.579,92	0,00	0,00	121.986,66	2.406,74	2,01%	2,01%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	18.856,81	0,00	0,00	13.383,95	-5.472,86	-29,02%	-29,02%
Total Renda Fixa					14.973.843,02	2,68%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	9.853.852,33	1.000.000,00	0,00	11.747.064,43	893.212,10	9,27%	9,28%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	9.789.906,61	7.500.000,00	0,00	17.987.606,27	697.699,66	7,87%	8,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	5.431.224,34	0,00	5.999.138,97	0,00	567.914,63	10,46%	8,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	9.755.436,79	0,00	0,00	10.310.621,05	555.184,26	5,69%	5,69%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	5.639.165,93	0,00	0,00	6.133.606,99	494.441,06	8,77%	8,77%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	11.334.353,83	0,00	0,00	11.707.381,06	373.027,23	3,29%	3,29%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.758.886,06	0,00	0,00	6.069.156,33	310.270,27	5,39%	5,39%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7.592.125,37	0,00	0,00	7.898.977,54	306.852,17	4,04%	4,04%
OCCAM FIC AÇÕES	3.211.562,55	0,00	0,00	3.447.224,87	235.662,32	7,34%	7,34%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.394.286,99	0,00	0,00	2.581.951,78	187.664,79	7,84%	7,84%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.205.889,55	17.528.500,00	0,00	22.898.021,80	163.632,25	1,47%	1,86%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	11.589.374,69	0,00	0,00	11.750.896,89	161.522,20	1,39%	0,00%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.417.907,91	0,00	0,00	4.569.850,64	151.942,73	3,44%	0,00%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.577.252,87	0,00	0,00	7.701.930,31	124.677,44	1,65%	1,65%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.632.125,84	0,00	2.000.000,00	5.745.838,30	113.712,46	1,60%	1,60%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	4.310.709,61	0,00	0,00	4.360.857,84	50.148,23	1,16%	1,16%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	7.612.905,53	0,00	0,00	7.650.075,27	37.169,74	0,49%	0,49%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	9.113.072,00	0,00	9.097.680,19	-15.391,81	-0,17%	4,17%
LA SHOPPING CENTERS MULTIELABRATÉGIA FIP	9.010.558,01	0,00	0,00	8.974.686,50	-35.871,51	-0,40%	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	6.000.000,00	0,00	5.844.275,02	-155.724,98	-2,60%	7,07%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	9.828.570,20	0,00	0,00	8.457.141,80	-1.371.428,40	-13,95%	-13,95%
Total Renda Variável					3.846.316,84	3,12%	