

RECURSOS GARANTIDORES	1º SEMESTRE DE 2019								2º SEMESTRE DE 2019							
	FPFS		MultiFlex		BásicoPlus		PGA		FPFS		MultiFlex		BásicoPlus		PGA	
	R\$ mil	%	R\$ mil	%	R\$ mil	%	R\$ mil	%	R\$ mil	%	R\$ mil	%	R\$ mil	%	R\$ mil	%
TOTAL DOS INVESTIMENTOS	1.663.696	100,0	745.823	100,0	909.721	100,0	8.152	100,0	1.725.745	100,0	782.118	100,0	934.181	100,0	9.446	100,0
GESTÃO PRÓPRIA	730.676	43,9	62.491	8,4	668.184	73,4	-	-	731.282	42,4	63.515	8,1	667.767	71,5	-	-
Investimentos de Renda Fixa	687.828	41,3	51.792	6,9	636.035	69,9	-	-	701.886	41	53.272	6,8	648.615	69,4	-	-
Títulos Públicos	670.835	40,3	44.294	5,9	626.542	68,9	-	-	684.315	40	45.520	5,8	638.795	68,4	-	-
NTN-B 15/08/2050	167.340	10,1	-	-	167.340	18,4	-	-	169.773	9,8	-	-	169.773	18,2	-	-
NTN-B 15/08/2040	40.611	2,4	-	-	40.611	4,5	-	-	41.208	2,4	-	-	41.208	4,4	-	-
NTN-B 15/08/2022	7.526	0,5	-	-	7.526	0,8	-	-	7.624	0,4	-	-	7.624	0,8	-	-
NTN-B 15/08/2020	10.333	0,6	-	-	10.333	1,1	-	-	10.514	0,6	-	-	10.514	1,1	-	-
NTN-B 15/08/2030	17.685	1,1	-	-	17.685	1,9	-	-	17.947	1,0	-	-	17.947	1,9	-	-
NTN-B 15/08/2026	1.163	0,1	-	-	1.163	0,1	-	-	1.180	0,1	-	-	1.180	0,1	-	-
NTN-B 15/08/2024	69.711	4,2	-	-	69.711	7,7	-	-	71.066	4,1	-	-	71.066	7,6	-	-
NTN-B 15/05/2055	11.989	0,7	-	-	11.989	1,3	-	-	12.174	0,7	-	-	12.174	1,3	-	-
NTN-B 15/05/2035	96.327	5,8	-	-	96.327	10,6	-	-	97.899	5,7	-	-	97.899	10,5	-	-
NTN-B 15/05/2045	82.788	5,0	-	-	82.788	9,1	-	-	84.166	4,9	-	-	84.166	9,0	-	-
NTN-C 01/04/2021	127.630	7,7	32.676	4,4	94.954	10,4	-	-	132.210	7,7	33.687	4,3	98.523	10,5	-	-
NTN-C 01/01/2031	37.732	2,3	11.618	1,6	26.114	2,9	-	-	38.553	2,2	11.833	1,5	26.720	2,9	-	-
Títulos Privados	16.992	1,0	7.499	1,0	9.494	1,0	-	-	17.571	1,0	7.752	1,0	9.820	1,1	-	-
Letra Financeira Banco Safra	16.992	1,0	7.499	1,0	9.494	1,0	-	-	17.571	1,0	7.752	1,0	9.820	1,1	-	-
Imobiliário	30.839	1,9	-	-	30.839	3,4	-	-	17.754	1,0	-	-	17.754	1,9	-	-
Direitos em alienações de investimentos imobiliários	30.839	1,9	-	-	30.839	3,4	-	-	17.754	1,0	-	-	17.754	1,9	-	-
Operações com Participantes	12.009	0,7	10.699	1,4	1.310	0,1	-	-	11.642	0,7	10.243	1,3	1.399	0,1	-	-
GESTÃO TERCERIZADA	933.020	56,1	683.331	91,6	241.537	26,6	8.152	100,0	994.463	57,6	718.604	91,9	266.414	28,5	9.446	100,0
Investimentos de Renda Fixa	539.783	32,4	453.300	60,8	79.341	8,7	7.142	87,6	538.321	31,2	445.456	57,0	84.463	9,0	8.402	88,9
Santander Soberano DI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Mauá Manacá FIM	133.798	8,0	123.506	16,6	10.293	1,1	-	-	176.073	10,2	135.828	17,4	40.245	4,3	-	-
Vinci Carnaúba FIM	154.036	9,3	128.101	17,2	25.934	2,9	-	-	159.725	9,3	130.100	16,6	29.625	3,2	-	-
Western Urucum FIM	133.964	8,1	123.657	16,6	10.308	1,1	-	-	141.869	8,2	128.723	16,5	13.146	1,4	-	-
Bradesco FI Sucupira	33.085	2,0	33.085	4,4	-	-	-	-	35.246	2,0	35.246	4,5	-	-	-	-
BRZ MULTI REC FICM 2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Itaú Soberano Ref. DI FIC FI	74.479	4,5	34.530	4,6	32.806	3,6	7.142	87,6	14.666	0,8	4.817	0,6	1.448	0,2	8.402	88,9
Western Asset Prev Structured Credit II FI RF CP	10.421	0,6	10.421	1,4	-	-	-	-	10.741	0,6	10.741	1,4	-	-	-	-
Investimentos de Renda Variável	136.034	8,2	61.202	8,2	74.832	8,2	-	-	180.887	10,5	92.328	11,8	88.559	9,5	-	-
Bradesco FIA Promon	40.385	2,4	9.403	1,3	30.981	3,4	-	-	63.823	3,7	27.809	3,6	36.014	3,9	-	-
Pátria Pipe Feeder I FIC FIA	22.839	1,4	22.839	3,1	-	-	-	-	28.281	1,6	28.281	3,6	-	-	-	-
VELT FICFIA	21.570	1,3	14.992	2,0	6.578	0,7	-	-	28.492	1,7	19.803	2,5	8.689	0,9	-	-
Vinci FIA Pau Brasil	51.241	3,1	13.968	1,9	37.273	4,1	-	-	60.291	3,5	16.435	2,1	43.856	4,7	-	-
ABSOLUTE PART	-	-	-	-	-	-	-	-	5.985	0,3	1.631	0,2	4.353	0,5	-	-
ALASKA BLACK INS FIA	1.935	0,1	527	0,1	1.407	0,2	-	-	2.419	0,1	659	0,1	1.760	0,2	-	-
SPX APACHE FICFIA	7.187	0,4	1.959	0,3	5.228	0,6	-	-	7.629	0,4	2.080	0,3	5.549	0,6	-	-
EQUITAS SELECTION IN	-	-	824	-	2.199	-	-	-	2.521	0,1	687	0,1	1.833	-	-	-
GTI HAIFA FIA	3.363	0,2	917	0,1	2.446	0,3	-	-	2.657	0,2	724	0,1	1.933	0,2	-	-
NAVI INST FIA	9.007	0,5	2.455	0,3	6.552	0,7	-	-	10.864	0,6	2.961	0,4	7.902	0,8	-	-
MOAT CAPITAL FIA	4.153	0,2	1.132	0,2	3.021	0,3	-	-	5.009	0,3	1.365	0,2	3.644	0,4	-	-
VINCI MOSAICO FIA	2.560	0,2	698	0,1	1.862	0,2	-	-	3.218	0,2	877	0,1	2.341	0,3	-	-
VIN FAT DINÂMICO FIA	4.802	0,3	1.309	0,2	3.493	0,4	-	-	5.814	0,3	1.585	0,2	4.229	0,5	-	-
OUTROS	15.233	0,9	4.152	0,6	11.080	1,2	-	-	14.381	0,8	3.920	0,5	10.461	1,1	-	-
Estruturado	198.856	12,0	131.306	17,6	66.540	7,3	1.010	12,4	213.355	12,4	141.516	18,1	70.795	7,6	1.044	11,1
Verde AM V FIC FIM	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Timberland I FIC FIP	8.892	0,5	5.928	0,8	2.964	0,3	-	-	10.595	0,6	7.064	0,9	3.532	0,4	-	-
Pátria Real Estate II FIP	16.453	1,0	3.279	0,4	13.175	1,4	-	-	16.572	1,0	3.303	0,4	13.269	1,4	-	-
Lacan Florestal FIP	9.842	0,6	-	-	9.842,3	1,1	-	-	9.810	0,6	-	-	9.810	1,1	-	-
Lacan Florestal II FIP	4.638	0,3	-	-	4.638,2	0,5	-	-	6.423	0,4	-	-	6.423	0,7	-	-
Pátria Real Estate III FIP	17.828	1,1	13.371	1,8	4.457	0,5	-	-	20.903	1,2	15.677	2,0	5.226	0,6	-	-
Stratus SCP Brasil FIP	12.694	0,8	12.694	1,7	-	-	-	-	14.540	0,8	14.540	1,9	-	-	-	-
KINEA PVT EQT IV FIP	3.466	0,2	3.466	0,5	-	-	-	-	5.212	0,3	5.212	0,7	-	-	-	-
Itaú Aroeira Multimercado FICFI	125.042	7,5	92.568	12,4	31.464	3,5	1.010	12,4	129.300	7,5	95.721	12,2	32.535	3,5	1.044	11,1
ADAM MACRO ST FICFIM	19.371	1,2	14.341	1,9	4.874	0,5	156	1,9	19.486	1,1	14.425	1,8	4.903	0,5	157	1,7
BAHIA AM MARAU FICFI	15.362	0,9	11.372	1,5	3.865	0,4	124	1,5	15.987	0,9	11.835	1,5	4.023	0,4	129	1,4
VERDE AM V FICFIM	19.254	1,2	14.254	1,9	4.845	0,5	155	1,9	20.135	1,2	14.906	1,9	5.067	0,5	163	1,7
TRUXT II LONG SHORT	17.806	1,1	13.182	1,8	4.480	0,5	144	1,8	18.456	1,1	13.663	1,7	4.644	0,5	149	1,6
VERDE AM V60 FICFIM	2.159	0,1	1.598	0,2	543	0,1	17	0,2	2.257	0,1	1.671	0,2	568	0,1	18	0,2
IT SOB RF REF DI FIC	2.486	0,1	1.840	0,2	625	0,1	20	0,2	2.405	0,1	1.780	0,2	605	0,1	19	0,2
KINEA ATLAS FIM	15.724	0,9	11.641	1,6	3.957	0,4	127	1,6	17.008	1,0	12.591	1,6	4.280	0,5	137	1,5
SPX NIM ESTRU FIC MM	18.619	1,1	13.784	1,8	4.685	0,5	150	1,8	19.075	1,1	14.121	1,8	4.800	0,5	154	1,6
GAVEA MACRO FIC FIM	14.308	0,9	10.592	1,4	3.600	0,4	116	1,4	14.492	0,8	10.728	1,4	3.647	0,4	117	1,2
Exterior	58.347	3,5	37.523	5,0	20.825	2,3	-	-	61.900	3,6	39.304	5,0	22.596	2,4	-	-
M Square Seringueira FIM IE	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	39.304	-	22.596	-	-	-
M Square Global Equity FIC FIM IE	19.575	1,2	8.883	1,2	10.693	1,2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB MM BlackRock IE FI	12.735	0,8	5.835	0,8	6.901	0,8	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BB MM Nordea IE FI	14.233	0,9	11.002	1												

COMPARATIVO DE ALOCAÇÃO DOS INVESTIMENTOS (*)

Valores em milhares de R\$

	1º SEMESTRE DE 2019			2º SEMESTRE DE 2019		
	BásicoPlus	MultiFlex	PGA	BásicoPlus	MultiFlex	PGA
Renda Fixa	78,6%	67,7%	87,6%	78,5%	63,8%	89,0%
Títulos públicos	68,9%	5,9%		68,4%	5,8%	
Títulos privados	1,0%	1,0%		1,1%	1,0%	
Fundos exclusivos	5,1%	54,8%		8,9%	55,0%	
Fundos abertos	3,6%	6,0%	87,6%	0,2%	2,0%	89,0%
Renda Variável	8,2%	8,2%	-	9,5%	11,8%	-
Fundos exclusivos	7,5%	3,1%		8,6%	5,7%	
Fundos abertos	0,7%	5,1%		0,9%	6,1%	
Estruturado	7,3%	17,6%	12,4%	7,6%	18,1%	11,1%
Fundos exclusivos	3,5%	12,4%	12,4%	3,5%	12,2%	11,1%
Fundos abertos	3,9%	5,2%		4,1%	5,9%	
Exterior	2,3%	5,0%	-	2,4%	5,0%	-
Fundos exclusivos				2,4%	5,0%	
Fundos abertos	2,3%	5,0%				
Imobiliário	3,4%	0,0%	-	1,9%	0,0%	-
Empréstimos a participantes	0,1%	1,4%	-	0,2%	1,3%	-
Disponível						
TOTAL	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%	100,0%

(*) Alocação do 1º nível dos investimentos

RENTABILIDADE POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO

	1º SEMESTRE DE 2019			2º SEMESTRE DE 2019		
	BásicoPlus	MultiFlex	PGA	BásicoPlus	MultiFlex	PGA
Renda Fixa	5,7%	5,1%	3,0%	10,8%	9,9%	5,8%
Renda Variável	15,3%	19,8%		36,5%	46,3%	-
Estruturado	7,0%	3,9%	4,88%	7,2%	9,1%	8,5%
Exterior	14,8%	14,9%		22,4%	21,1%	
Imobiliário	5,6%	-		11,4%	0,0%	-
Empréstimos a participantes	5,6%	5,6%		9,6%	9,6%	-
Retorno geral	6,6%	6,4%	3,2%	12,73%	13,2%	6,2%

BENCHMARKS

Índices	1º sem.	2º sem.
CDI	3,1%	6,0%
Ibovespa	14,9%	31,6%
IBr-X	15,6%	33,4%
INPC	2,5%	4,5%
INPC + 5,35% a.a.*	5,2%	10,1%

* Meta atuarial para o Plano BásicoPlus

DESPESAS BRUTAS INCORRIDAS COM A ADMINISTRAÇÃO DOS RECURSOS DA FUNDAÇÃO PROMON DE PREVIDÊNCIA SOCIAL (EM R\$)

Valores em milhares de R\$

	1º SEMESTRE DE 2019			2º SEMESTRE DE 2019		
	BásicoPlus	MultiFlex	Total	BásicoPlus	MultiFlex	Total
Salário e encargos	744	1.686	2.430	1.253	2.956	4.209
Sistemas administrativos terceirizados	192	399	591	355	743	1.098
Custódia de investimentos	134	86	219	238	130	367
Impostos, taxas e tarifas	133	161	295	250	327	578
Consultoria jurídica	35	73	108	68	104	172
Consultoria atuarial	24	-	24	118	49	167
Sistemas e Comunicação	24	50	74	46	96	142
Auditoria contábil	23	49	71	25	62	86
Consultoria de investimentos	-	-	-	57	121	178
Outras despesas	174	306	480	287	486	773
Total	1.483	2.810	4.291	2.697	5.073	7.769