DI - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BDMG - 1º SEMESTRE DE 2019

INFORMAÇÕES SOBRE A ENTIDADE

Nome da Entidade:	DESBAN Fundação BDMG de Seguridade Social	**Sigla da Entidade:**	DESBAN
Estado da Entidade:	MG	**Nome do Plano:**	Plano BDMG BD
Tipo do Plano:	BD	**Telefone** (31) 3249-8500	**E-mail**: investimentos@desban.org.br
Administrador Responsável :	Mauro Camilo Clemente de Souza	**CPF:**	489.370.296-34
Auditoria de Gestão:	Teixeira & Associados Auditores Independentes	**CNPJ do Auditor de Gestão:**	38.726.261/0001-66

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

		%
PROGRAMA DE INVESTIMENTOS	**966.989.659,58**	100,00%
SEGMENTO DE RENDA FIXA	**548.133.893,69**	**56,68%**
TÍTULOS PÚBLICOS	**321.900.114,36**	**33,29%**
NTN-B	321.900.114,36	33,29%
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	**214.312.613,46**	**19,57%**
AF INVEST FIRF CRDPR	115.661.265,74	11,96%
ITAU SOB RF SIMP LP	122,71	0,00%
MOD GAIA IR FIRF CP	1.775.681,79	0,18%
AZ QU LUCE FICFIRF L	88.417.806,79	9,14%
BTG CAPMARK FIRF CP	4.494.970,48	0,46%
FI INSTITUCIONAL	3.962.765,95	0,41%
Debêntures	**2.038.870,13**	**0,21%**
VALE	2.038.870,13	0,21%
FIDC'S	**9.882.295,74**	**1,02%**
ZEMA I FIDC - ZEMA I	5.481.281,86	0,57%
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	4.401.013,88	0,46%

Valores em reais	28/06/2019	
SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL	**197.717.251,43**	**20,45%**
FUNDO DE INVESTIMENTO- AÇÕES	**197.717.251,43**	**20,45%**
ISHARES IBOVESPA FUN	38.708.046,00	4,00%
IT NOW IBOVESPA ÍNDI	92.804.371,00	9,60%
OCEANA SELEC FIA	28.347.596,86	2,93%
SUL AMER EXPERTI FIA	60.539,37	0,01%
FRANK TEMPLEN VL FIA	23.428.520,38	2,42%
OCEANA SEL 30 FICFIA	14.368.177,82	1,49%
SEGMENTO DE INV. ESTRUTURADOS	**160.754.358,89**	**16,62%**
BAH AM MARAU ES FICM	21.346.829,27	2,21%
BTG INFRA II FIC FIP	5.368.053,72	0,56%
EXPLORITAS ALP FIM	11.531.061,00	1,19%
FIP MALBEC E1 S1	18.125.765,16	1,87%
MINAS GERAIS FIP	32.221.703,44	3,33%
KINEA PRI EQ IV FIP	3.431.652,94	0,35%
FIP LACAN FLORESTAL	9.861.041,48	1,02%
NEO MEZANINO III FIP	2.316.205,93	0,24%
PA BR INF III FICFIP	12.031.103,07	1,24%
PAT EST III P FICFIP	4.428.111,64	0,46%
PATRIA REAL ESTII FP	3.228.378,77	0,33%
AZ QUEST MULTI FICFM	16.573.154,82	1,71%
SPX NIM ESTR FIC FIM	20.291.297,65	2,10%
		0,00%
SEG. OPERAÇÃO COM PART.	**12.171.900,90**	**1,26%**
EMPRÉSTIMOS	**12.171.900,90**	**1,26%**
Simples	12.171.900,90	1,26%
SEGMENTO DE IMÓVEIS	**48.212.254,67**	**4,99%**
LOCADOS A TERCEIROS	**48.212.254,67**	**4,99%**
Life Center Parking	28.813.078,86	2,98%
Life Center Sistema de Saúde	16.362.919,46	1,69%
Aluguéis a Receber	3.036.256,35	0,31%

RENTABILIDADE DA DESBAN X BENCHMARK X MÍNIMO ATUARIAL - 1º SEMESTRE 2019

SEGMENTO	Rentabilidade %	%	BENCHMARK	MINIMO ATUARIAL
Renda Fixa	4,62%	56,93%	Mínimo Atuarial	5,19%
Renda Variavel	14,80%	18,18%	Ibovespa + 3%	
Oper. C/ participantes	3,43%	1,26%	Mínimo Atuarial	
Imóveis	2,12%	5,17%	Mínimo Atuarial	
Investimentos Estruturados	7,36%	18,46%	Mínimo Atuarial + 4%	
Investimentos Totais	6,12%	100,00%	Mínimo Atuarial	

ALOCAÇÃO DE RECURSOS - COMPARATIVO

2º SEMESTRE DE 2018			1º SEMESTRE DE 2019		
SEGMENTO	**R$**	**%**	**SEGMENTO**	**R$**	**%**
Investimentos Totais	938.864.204,29	100,00%	Investimentos Totais	966.989.659,58	100,00%
Renda Fixa	534.537.618,57	56,93%	Renda Fixa	548.133.893,69	56,68%
Renda Variável	170.680.340,98	18,18%	Renda Variável	197.717.251,43	20,45%
Investimentos Imobiliários	48.560.823,75	5,17%	Investimentos Imobiliários	48.212.254,67	4,99%
Operações com Participantes	11.810.056,35	1,26%	Operações com Participantes	12.171.900,90	1,26%
Investimentos Estruturados	173.275.364,64	18,46%	Investimentos Estruturados	160.754.358,89	16,62%

CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO

ATIVOS	RATING	AGÊNCIA	ATIVOS	RATING	AGÊNCIA
FIDC'S			**DEBÊNTURES**		
ZEMA I FIDC - ZEMA I	AAA	S&P	VALE	N/A	
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	AA	Fitch			

DI - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BDMG - 1º SEMESTRE DE 2019

INFORMAÇÕES SOBRE A ENTIDADE

Nome da Entidade:	DESBAN Fundação BDMG de Seguridade Social	**Sigla da Entidade:**	DESBAN
Estado da Entidade:	MG	**Nome do Plano:**	Plano BDMG CV
Tipo do Plano:	CV	**Telefone** (31) 3249-8500	**E-mail**: investimentos@desban.org.br
Administrador Responsável :	Mauro Camilo Clemente de Souza	**CPF:**	489.370.296-34
Auditoria de Gestão:	Teixeira & Associados Auditores Independentes	**CNPJ do Auditor de Gestão:**	38.726.261/0001-66

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS			Valores em reais	28/06/2019	
PROGRAMA DE INVESTIMENTOS	**9.404.669,95**	**%**	**SEGMENTO DE RENDA VARIÁVEL**	**2.004.852,27**	**21,32%**
		100,00%	**FUNDO DE INVESTIMENTO- AÇÕES**	**2.004.852,27**	**21,32%**
SEGMENTO DE RENDA FIXA	**5.868.168,69**	**62,40%**	IT NOW IBOVESPA ÍNDI	878.297,20	9,34%
FUNDOS DE INVESTIMENTOS	**5.773.861,25**	**61,39%**	OCEANA SELEC FIA	779.558,91	8,29%
AF INVEST FIRF CRDPR	1.286.840,29	13,68%	FRANK TEMPLEN VL FIA	288.730,16	3,07%
AZ QU LUCE FICFIRF L	1.314.783,92	13,98%	ISHARES IBOVESPA FUNDO DE INDICE	58.266,00	0,62%
BTG CAPMARK FIRF CP	726.977,73	7,73%			
ITAU SOB RF SIMP LP	1.786.010,24	18,99%			
FI INSTITUCIONAL	659.249,07	7,01%	**SEGMENTO DE INV. ESTRUTURADOS**	**1.372.483,00**	**14,59%**
FIDC'S	**94.307,44**	**1,00%**	BAH AM MARAU ES FICM	423.376,61	4,50%
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	94.307,44	1,00%	EXPLORITAS ALP FIM	273.298,67	2,91%
			FIP MALBEC E1 S1	184.041,02	1,96%
			KINEA PRI EQ IV FIP	34.663,16	0,37%
			PAT EST III P FICFIP	45.518,28	0,48%
			SPX NIM ESTR FIC FIM	411.585,26	4,38%
SEG. OPERAÇÃO COM PART.				**159.165,99**	**1,69%**
EMPRÉSTIMOS				**159.165,99**	**1,69%**
Simples				159.165,99	1,69%

RENTABILIDADE DA DESBAN X BENCHMARK - 1º SEMESTRE 2019

SEGMENTO	Rentabilidade %	%	BENCHMARK
Renda Fixa	3,89%	62,40%	Índice de Referência (IPCA + 4,38% a.a.)
Renda Variavel	16,74%	21,32%	Ibovespa + 3%
Oper. C/ participantes	7,34%	1,69%	Índice de Referência (IPCA + 4,38% a.a.)
Investimentos Estruturados	5,81%	14,59%	Índice de Referência + 4,00% a.a.
Investimentos Totais	6,51%	100,00%	Índice de Referência (IPCA + 4,38% a.a.)

ALOCAÇÃO DE RECURSOS - COMPARATIVO

2º SEMESTRE DE 2018			1º SEMESTRE DE 2019		
SEGMENTO	**R$**	**%**	**SEGMENTO**	**R$**	**%**
Investimentos Totais	8.713.586,88	100,00%	Investimentos Totais	9.404.669,95	100,00%
Renda Fixa	6.020.796,09	69,10%	Renda Fixa	5.868.168,69	62,40%
Renda Variável	1.515.996,18	17,40%	Renda Variável	2.004.852,27	21,32%
Operações com Participantes	165.218,11	1,90%	Operações com Participantes	159.165,99	1,69%
Investimentos Estruturados	1.011.576,50	11,61%	Investimentos Estruturados	1.372.483,00	14,59%

CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO

ATIVOS	RATING	AGÊNCIA	ATIVOS	RATING	AGÊNCIA
FIDC'S					
SANEAGOIFR IV 1 FIDC	AA	Fitch			

DI - DEMONSTRATIVO DE INVESTIMENTOS PLANO DE BENEFÍCIOS PREVIDENCIÁRIOS BDMG - 1º SEMESTRE DE 2019

INFORMAÇÕES SOBRE A ENTIDADE

Nome da Entidade:	DESBAN Fundação BDMG de Seguridade Social	**Sigla da Entidade:**		DESBAN
Estado da Entidade:	MG	**Nome do Plano:**		PGA
Tipo do Plano:	PGA	**Telefone**	(31) 3249-8500	**E-mail**: investimentos@desban.org.br
Administrador Responsável :	Mauro Camilo Clemente de Souza	**CPF:**		489.370.296-34
Auditoria de Gestão:	Teixeira & Associados Auditores Independentes	**CNPJ do Auditor de Gestão:**		38.726.261/0001-66

COMPOSIÇÃO DOS INVESTIMENTOS

			Valores em reais	28/06/2019	
PROGRAMA DE INVESTIMENTOS	**9.618.119,52**	**%**	**FUNDOS DE INVESTIMENTOS**	**7.383.984,99**	**76,77%**
		100,00%	AF INVEST FIRF CRDPR	1.337.579,67	13,91%
SEGMENTO DE RENDA FIXA	**9.618.119,52**	**100,00%**	AZ QU LUCE FICFIRF L	684.315,54	7,11%
TÍTULOS PRIVADOS	**2.234.134,53**	**23,23%**	FI INSTITUCIONAL	439.375,53	4,57%
CDB	**2.234.134,53**	**23,23%**	ITAU SOB RF SIMP LP	4.017.188,87	41,77%
Banco Daycoval	717.834,52	7,46%	BTG CAPMARK FIRF CP	905.525,38	9,41%
Banco ABC	716.277,64	7,45%			
BTG Pactual	800.022,37	8,32%			

RENTABILIDADE DA DESBAN X BENCHMARK - 1º SEMESTRE 2019

SEGMENTO	Rentabilidade %	%	BENCHMARK
Renda Fixa	3,18%	100,00%	103% Selic
Investimentos Totais	3,18%	100,00%	103% Selic

ALOCAÇÃO DE RECURSOS - COMPARATIVO

2º SEMESTRE DE 2018			1º SEMESTRE DE 2019		
SEGMENTO	**R$**	**%**	**SEGMENTO**	**R$**	**%**
Investimentos Totais	9.155.715,98	100,00%	Investimentos Totais	9.618.119,52	100,00%
Renda Fixa	9.155.715,98	100,00%	Renda Fixa	9.618.119,52	100,00%

CLASSIFICAÇÃO DE RISCO DE CRÉDITO

ATIVOS	RATING	AGÊNCIA	ATIVOS	RATING	AGÊNCIA
CDB			**CDB**		
Banco Daycoval	AA	Fitch	BTG Pactual	AA-	Fitch
Banco ABC	AA	Moody's			