

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	103.287,56	0,11%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.296.908,78	1,41%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.651.249,07	5,04%	450	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.547.167,31	1,68%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	81.353,31	0,09%	876	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	17.070.401,64	18,50%	683	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	819.638,79	0,89%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.323.969,31	2,52%	965	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.715.362,12	10,53%	956	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	805.171,05	0,87%	693	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.395.962,00	1,51%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.166.437,13	1,26%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.171.126,94	3,44%	1.360	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.917.602,60	8,58%	929	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	D+1	Não há	1.587.104,06	1,72%	278	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.201.375,92	1,30%	306	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	6.732,17	0,01%	667	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.255.188,55	2,44%	66	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.161.697,39	1,26%	714	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.646.777,99	9,37%	290	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.497.050,53	1,62%	322	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.196.980,60	1,30%	74	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2019)

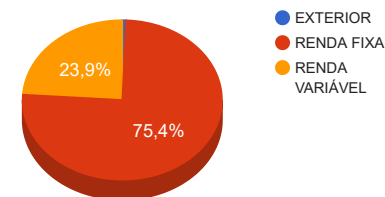
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.557.761,52	2,77%	99	0,53%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.163.155,66	1,26%	6	1,82%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	611.456,15	0,66%	56.113	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.535.824,71	1,66%	4.879	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	519.361,17	0,56%	8.377	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.824.344,53	1,98%	425	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.612.224,23	1,75%	165	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.886.021,87	3,13%	2.521	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.151.649,85	1,25%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.369.682,65	2,57%	729	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.621.043,70	6,09%	22.826	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	244.485,60	0,26%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	576.529,36	0,62%	64	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
		Total	92.292.085,82				

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

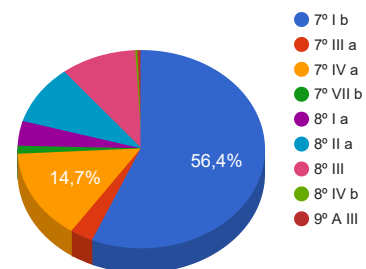
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	52.065.637,61	56,41%	15,00%	27,00%	90,00%	30.997.239,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	2.788.479,98	3,02%	0,00%	10,00%	60,00%	52.586.771,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	13.567.446,63	14,70%	10,00%	30,00%	40,00%	23.349.387,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	4.614.604,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.196.980,60	1,30%	0,00%	2,00%	5,00%	3.417.623,69
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	3.720.917,18	4,03%	0,00%	5,00%	10,00%	5.508.291,40
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	8.989.232,66	9,74%	0,00%	10,00%	20,00%	9.469.184,50
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.142.376,20	9,91%	0,00%	10,00%	10,00%	86.832,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	4.614.604,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	244.485,60	0,26%	0,00%	2,00%	5,00%	4.370.118,69
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	922.920,86
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	576.529,36	0,62%	0,00%	1,00%	5,00%	4.038.074,93
Total Carteira		92.292.085,82					

EXTERIOR	576.529,36	0,62%
RENDA FIXA	69.618.544,82	75,43%
RENDA VARIÁVEL	22.097.011,64	23,94%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: novembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	52.065.637,61	56,41%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	2.788.479,98	3,02%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	13.567.446,63	14,70%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.196.980,60	1,30%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	3.720.917,18	4,03%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	8.989.232,66	9,74%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.142.376,20	9,91%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	244.485,60	0,26%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 9º - A, Inciso III	576.529,36	0,62%	0,00%	5,00%
Total	92.292.085,82	100,00%	25,00	291,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 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	67.659.134,41	73,31%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	12.033.614,03	13,04%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.384.675,32	6,92%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	4.383.072,40	4,75%	0,00%
SICREDI	1.587.104,06	1,72%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	244.485,60	0,26%	0,02%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	8,80%	2,07%	3,91%	9,47%	20,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	2,68%	1,84%	0,83%	3,04%	7,67%	0,20%	0,065%	3,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22%	12,08%	2,98%	5,78%	13,79%	32,81%	0,20%	0,620%	2,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	12,82%	3,10%	6,10%	14,66%	26,09%	0,15%	0,718%	2,65%

IPCA	0,51%	3,12%	0,57%	0,88%	3,27%	7,45%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,35%	11,53%	1,64%	5,55%	13,22%	21,66%	0,40%	0,000%	2,82%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,19%	10,98%	3,00%	5,33%	12,20%	24,42%	0,20%	0,567%	1,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,51%	15,75%	3,34%	7,20%	17,28%	25,78%	0,002	0,798%	3,90%

Selic	0,38%	5,56%	1,33%	2,89%	6,08%	12,95%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,33%	5,45%	1,25%	2,81%	5,96%	12,72%	0,20%	0,011%	0,20%

CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,34%	5,37%	1,24%	2,76%	5,86%	12,70%	0,20%	0,010%	0,19%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,31%	5,34%	1,21%	2,73%	5,85%	12,49%	0,20%	0,047%	0,22%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,26%	5,48%	1,25%	2,80%	5,98%	12,67%	0,20%	0,069%	0,28%

IRF-M 1	0,33%	6,31%	1,61%	3,49%	6,91%	14,37%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,31%	6,12%	1,56%	3,39%	6,70%	13,99%	0,20%	0,079%	0,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	6,07%	1,53%	3,36%	6,64%	13,87%	0,10%	0,079%	0,37%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,21%	6,29%	1,56%	3,43%	6,87%	14,19%	0,20%	0,151%	0,52%
IDKA IPCA 2 Anos	0,01%	10,49%	2,86%	5,28%	11,88%	22,68%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	9,94%	2,88%	5,10%	11,28%	21,11%	0,20%	0,510%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	9,98%	2,73%	5,04%	11,25%	21,26%	0,20%	0,499%	1,61%
IMA-B	-2,45%	20,53%	3,71%	8,53%	22,52%	37,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	2,15%	2,32%	1,20%	3,10%	6,70%	0,20%	0,292%	4,16%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,99%	10,13%	3,61%	4,81%	12,12%	17,55%	0,20%	1,036%	6,41%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,48%	20,27%	3,66%	8,43%	22,21%	36,71%	0,20%	1,960%	6,91%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-2,53%	20,07%	3,60%	8,30%	22,03%	36,72%	0,20%	1,987%	6,90%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,54%	20,20%	3,57%	8,30%	22,16%	36,72%	0,20%	1,990%	6,96%
IRF-M	-0,46%	11,34%	2,69%	6,32%	13,05%	24,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,49%	11,00%	2,64%	6,19%	12,64%	24,35%	0,20%	0,799%	2,69%
IMA-B 5	-0,28%	11,77%	3,13%	5,97%	13,30%	23,89%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	11,51%	3,04%	5,82%	13,05%	23,35%	0,20%	0,647%	2,33%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	3,52%	22,91%	8,79%	13,22%	25,64%	30,60%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
ICON	2,99%	43,71%	3,63%	23,17%	43,50%	38,80%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	3,31%	43,62%	4,06%	23,98%	43,05%	34,06%	1,60%	7,813%	17,44%
IDIV	2,35%	31,98%	5,87%	14,68%	32,84%	60,60%	-	-	-
BRABESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,05%	15,27%	4,26%	6,58%	15,56%	47,73%	1,50%	6,572%	9,29%
IGCT	1,09%	25,41%	7,27%	13,32%	24,40%	54,98%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1,04%	24,61%	7,06%	12,87%	23,62%	53,52%	0,90%	6,598%	11,12%
Ibovespa	0,95%	23,15%	7,02%	11,55%	20,93%	50,38%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3,20%	41,11%	6,04%	20,03%	42,37%	64,78%	2,00%	7,453%	14,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3,00%	26,89%	3,43%	15,64%	31,54%	69,02%	2,50%	7,257%	9,79%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,88%	29,98%	6,42%	9,71%	29,09%	-	2,00%	5,941%	15,59%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2,54%	9,90%	6,12%	7,63%	10,81%	-	1,60%	1,966%	3,23%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,90%	34,35%	7,90%	21,91%	34,31%	73,20%	1,90%	6,122%	11,77%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,97%	22,61%	6,92%	11,28%	20,47%	49,18%	0,50%	6,643%	11,68%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,85%	7,63%	2,06%	4,23%	9,12%	-	1,60%	0,803%	1,30%
CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-

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

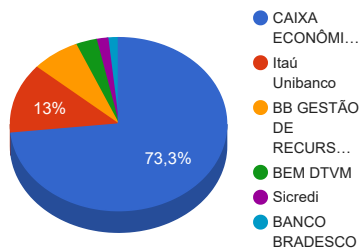
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,77%	15,67%	3,18%	7,62%	16,78%	28,31%	0,50%	1,452%	3,41%

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (novembro / 2019)

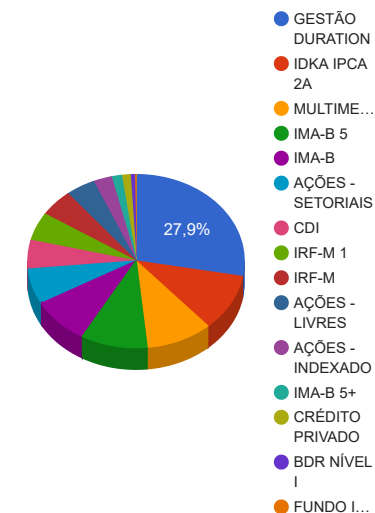
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	9,03%	37,76%	10,40%	23,12%	27,12%	61,05%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	8,92%	36,87%	10,29%	23,03%	26,18%	57,09%	0,70%	6,646%	18,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	67.659.134,41	73,31%
Itaú Unibanco	12.033.614,03	13,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.629.160,92	7,18%
BEM DTVM	2.886.021,87	3,13%
Sicredi	1.587.104,06	1,72%
BANCO BRADESCO	1.497.050,53	1,62%

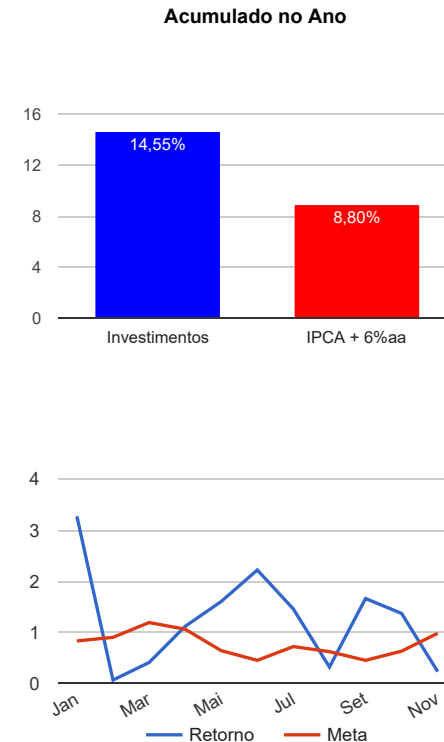


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	25.717.179,63	27,86%
IDKA IPCA 2A	9.796.715,43	10,61%
MULTIMERCADO	9.142.376,20	9,91%
IMA-B 5	9.084.039,73	9,84%
IMA-B	7.994.231,16	8,66%
AÇÕES - SETORIAIS	6.104.363,41	6,61%
CDI	4.920.668,64	5,33%
IRF-M 1	4.861.518,56	5,27%
IRF-M	4.651.249,07	5,04%
AÇÕES - LIVRES	4.048.024,91	4,39%
AÇÕES - INDEXADO	2.557.761,52	2,77%
IMA-B 5+	1.395.962,00	1,51%
CRÉDITO PRIVADO	1.196.980,60	1,30%
BDR NÍVEL I	576.529,36	0,62%
FUNDO IMOBILIÁRIO	244.485,60	0,26%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	80.445.558,00	1.132.453,93	2.697.847,21	81.511.600,07	2.631.435,35	3,27%	0,83%	393,34%	2,09%
Fevereiro	81.511.600,07	7.523.087,89	6.241.455,76	82.845.672,69	52.440,49	0,06%	0,90%	7,07%	2,57%
Março	82.845.672,69	1.690.098,38	2.423.381,46	82.449.984,44	337.594,83	0,41%	1,19%	34,14%	3,51%
Abril	82.449.984,44	3.101.558,79	2.930.697,93	83.541.954,06	921.108,76	1,11%	1,06%	105,22%	1,99%
Mai	83.541.954,06	6.457.581,22	6.220.787,61	85.121.083,24	1.342.335,57	1,60%	0,64%	250,09%	2,28%
Junho	85.121.083,24	3.192.211,70	3.012.029,79	87.194.189,63	1.892.924,48	2,22%	0,45%	492,76%	2,12%
Julho	87.194.189,63	3.657.107,79	4.747.191,23	87.373.372,00	1.269.265,81	1,46%	0,72%	200,99%	1,70%
Agosto	87.373.372,00	5.164.990,88	4.869.069,46	87.948.854,62	279.561,20	0,32%	0,62%	51,39%	3,21%
Setembro	87.948.854,62	4.122.826,01	3.632.974,99	89.907.538,69	1.468.833,05	1,66%	0,45%	371,92%	1,88%
Outubro	89.907.538,69	4.273.176,97	3.691.048,14	91.728.366,90	1.238.699,38	1,37%	0,63%	215,99%	2,13%
Novembro	91.728.366,90	18.592.217,07	18.239.853,77	92.292.085,82	211.355,62	0,23%	0,98%	23,52%	1,56%
Acumulado no ano					11.645.554,54	14,55%	8,80%	165,25%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.156.407,62	0,00	0,00	1.166.437,13	10.029,51	0,87%	0,29%	0,87%	
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.385.890,00	0,00	0,00	1.395.962,00	10.072,00	0,73%	0,07%	0,73%	
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.492.062,72	0,00	0,00	1.497.050,53	4.987,81	0,33%	0,01%	0,33%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.952.291,97	3.667.633,89	0,00	8.646.777,99	26.852,13	0,31%	0,00%	0,35%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.158.127,78	0,00	0,00	1.161.697,39	3.569,61	0,31%	0,05%	0,31%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	102.971,55	0,00	0,00	103.287,56	316,01	0,31%	0,08%	0,31%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.673,07	2.040,00	0,00	6.732,17	19,10	0,28%	0,01%	0,34%	
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.249.429,49	0,00	0,00	2.255.188,55	5.759,06	0,26%	0,07%	0,26%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	81.184,36	0,00	0,00	81.353,31	168,95	0,21%	0,51%	0,21%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.013.840,68	2.963.701,58	3.818.474,22	3.171.126,94	12.058,90	0,17%	0,08%	0,31%	
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	345.258,36	1.239.350,28	0,00	1.587.104,06	2.495,42	0,16%	0,15%	0,21%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.585.139,46	2.129.762,00	0,00	9.715.362,12	460,66	0,00%	0,50%	0,01%	
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.199.275,51	0,00	0,00	1.196.980,60	-2.294,91	-0,19%	0,57%	-0,19%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.550.540,97	0,00	0,00	1.547.167,31	-3.373,66	-0,22%	0,62%	-0,22%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.944.361,22	0,00	0,00	7.917.602,60	-26.758,62	-0,34%	0,65%	-0,34%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	822.760,19	0,00	0,00	819.638,79	-3.121,40	-0,38%	0,72%	-0,38%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.191.799,90	0,00	4.500.000,00	4.651.249,07	-40.550,83	-0,44%	0,80%	-0,49%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.157.061,59	0,00	0,00	17.070.401,64	-86.659,95	-0,51%	0,80%	-0,51%	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.309.819,50	0,00	0,00	1.296.908,78	-12.910,72	-0,99%	1,04%	-0,99%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	825.660,08	0,00	0,00	805.171,05	-20.489,03	-2,48%	1,96%	-2,48%	
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.232.560,19	0,00	0,00	1.201.375,92	-31.184,27	-2,53%	1,99%	-2,53%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.384.635,79	0,00	0,00	2.323.969,31	-60.666,48	-2,54%	1,99%	-2,54%	
Total Renda Fixa						-211.220,71	-0,30%	0,58%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.565.280,95	0,00	0,00	1.612.224,23	46.943,28	3,00%	7,26%	3,00%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.773.220,06	0,00	0,00	1.824.344,53	51.124,47	2,88%	5,94%	2,88%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.310.920,39	0,00	0,00	2.369.682,65	58.762,26	2,54%	1,97%	2,54%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	600.053,94	0,00	0,00	611.456,15	11.402,21	1,90%	6,12%	1,90%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	3.184.209,59	500.000,00	3.225.695,89	519.361,17	60.847,47	1,65%	7,81%	3,31%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.640.397,85	1.500.000,00	3.667.633,89	1.535.824,71	63.060,75	1,23%	7,45%	3,20%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.527.326,36	1.000.000,00	0,00	2.557.761,52	30.435,16	1,20%	6,64%	0,97%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.151.222,01	0,00	0,00	1.163.155,66	11.933,65	1,04%	6,60%	1,04%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.141.922,87	0,00	0,00	1.151.649,85	9.726,98	0,85%	0,80%	0,85%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	5.589.729,32	0,00	5.621.043,70	31.314,38	0,56%	1,45%	0,77%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.023.303,62	0,00	3.026.009,77	0,00	2.706,15	0,09%	0,62%	0,80%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.887.405,95	0,00	0,00	2.886.021,87	-1.384,08	-0,05%	6,57%	-0,05%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	248.040,70	0,00	2.040,00	244.485,60	-1.515,10	-0,61%	-	0,00%
Total Renda Variável					375.357,58	1,63%	4,54%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	529.310,61	0,00	0,00	576.529,36	47.218,75	8,92%	6,65%	8,92%
				Total Exterior	47.218,75	8,92%	6,65%	