

# 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
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.567.916,00	1,00%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	112.838,43	0,04%	876	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	27.767.482,57	10,83%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4 du	Não há	2.278.677,43	0,89%	35	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.830.005,30	8,51%	1.360	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	47.314.523,70	18,45%	575	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	26.776.744,20	10,44%	683	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	6.079.148,98	2,37%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	7.662.587,25	2,99%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	13.140.599,20	5,12%	348	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.386.954,43	0,93%	1.198	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	503.852,53	0,20%	667	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.957.483,75	0,76%	52	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.520.415,85	0,98%	118	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.000.000,00	0,78%	75	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	6.340.694,65	2,47%	1.472	1,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	518,87	0,00%	385	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.661,34	0,00%	322	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.511.609,16	0,98%	732	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.880.335,17	1,12%	160	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.241.233,74	7,89%	94	2,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.983.040,12	3,11%	278	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2019)

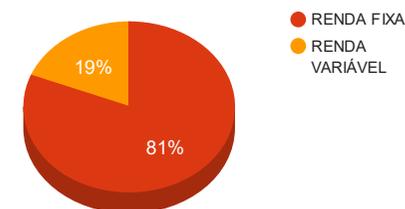
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	2.426.203,71	0,95%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	3.025.295,11	1,18%	101.949	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.944.947,62	0,76%	3.639	0,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	6.995.987,30	2,73%	56.113	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.238.667,94	3,60%	4.450	0,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.907.035,78	2,69%	1.316	0,49%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.500.418,19	1,36%	728	4,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	4.178.637,30	1,63%	17.382	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	3.324.197,22	1,30%	878	0,38%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.115.612,05	0,43%	22.826	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	6.913.696,36	2,70%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não há	1.536.088,84	0,60%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>255.976.110,09</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			522.662,93				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>256.498.773,02</b>				

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

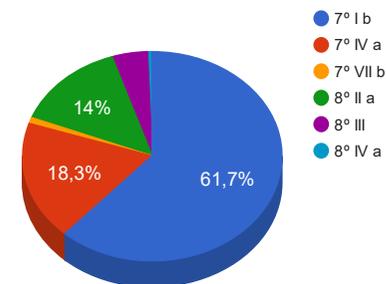
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	157.917.477,49	61,69%	40,00%	55,00%	100,00%	98.058.632,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	46.951.845,18	18,34%	0,00%	20,00%	40,00%	55.438.598,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.426.203,71	0,95%	0,00%	5,00%	5,00%	10.372.601,79
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	76.792.833,03
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	35.790.989,24	13,98%	0,00%	7,00%	20,00%	15.404.232,78
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.353.505,63	4,44%	0,00%	5,00%	10,00%	14.244.105,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.536.088,84	0,60%	0,00%	0,00%	5,00%	11.262.716,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	12.798.805,50
<b>Total Carteira</b>		<b>255.976.110,09</b>					

EXTERIOR	0,00	0,00%
RENDA FIXA	207.818.189,31	81,19%
RENDA VARIÁVEL	48.680.583,71	19,02%

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%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	157.917.477,49	61,57%	40,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	46.951.845,18	18,30%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	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 "	2.426.203,71	0,95%	0,00%	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%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	35.790.989,24	13,95%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.353.505,63	4,43%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.536.088,84	0,60%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>255.976.110,09</b>	<b>99,80%</b>	<b>40,00</b>	<b>690,00</b>

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	138.130.073,82	53,85%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	59.216.635,25	23,09%	0,01%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	24.106.902,26	9,40%	0,00%
Itaú Unibanco	10.320.184,52	4,02%	0,00%
Navi Capital	9.238.667,94	3,60%	0,52%
Moat Capital	4.178.637,30	1,63%	0,04%
Alaska Asset Management	3.025.295,11	1,18%	0,02%
BANCO J. SAFRA S/A	2.278.677,43	0,89%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	2.000.000,00	0,78%	0,00%
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.944.947,62	0,76%	0,00%
FL Asset Management	1.536.088,84	0,60%	20,49%

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%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,75%	14,06%	3,34%	6,87%	16,24%	28,16%	0,15%	0,922%	3,45%
IPCA	0,51%	3,12%	0,57%	0,88%	3,27%	7,45%	-	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,19%	13,23%	3,76%	6,75%	14,54%	19,70%	0,40%	0,289%	2,77%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,59%	13,76%	3,26%	6,62%	15,67%	27,52%	0,20%	0,774%	3,11%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,94%	11,49%	2,45%	5,67%	12,86%	-	0,40%	0,910%	3,14%
CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,37%	5,40%	1,29%	2,81%	5,90%	12,55%	0,15%	0,000%	0,17%
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%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,33%	5,44%	1,23%	2,79%	5,93%	13,12%	0,20%	0,015%	0,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,31%	4,75%	1,12%	2,46%	5,20%	11,09%	0,80%	0,000%	0,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	4,52%	1,06%	2,33%	4,95%	10,54%	1,00%	0,004%	0,16%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,17%	3,09%	0,67%	1,56%	3,39%	7,14%	3,00%	0,002%	0,14%
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%

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

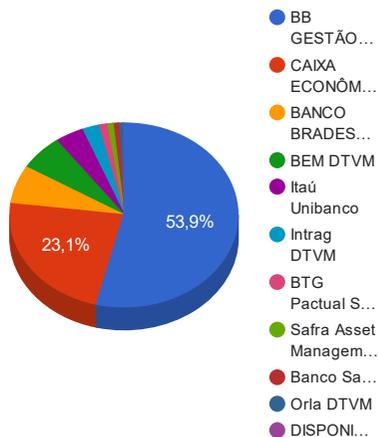
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	6,07%	1,53%	3,36%	6,64%	13,87%	0,10%	0,079%	0,37%
IDKA IPCA 2 Anos	0,01%	10,49%	2,86%	5,28%	11,88%	22,68%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	9,94%	2,88%	5,10%	11,28%	21,11%	0,20%	0,510%	1,48%
IMA-B 5+	-4,07%	27,06%	4,15%	10,21%	29,45%	47,79%	-	-	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	-2,50%	21,11%	3,93%	8,27%	23,75%	-	0,15%	2,118%	7,30%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-4,10%	26,61%	4,09%	10,09%	28,94%	46,86%	0,20%	3,058%	10,44%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-4,11%	26,62%	4,10%	10,03%	28,97%	46,79%	0,20%	3,072%	10,47%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	9,46%	2,58%	4,67%	10,73%	21,08%	0,20%	0,298%	1,18%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,49%	20,15%	3,63%	8,35%	22,04%	36,71%	0,30%	1,956%	6,91%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-2,56%	20,43%	3,75%	8,45%	22,49%	37,08%	0,20%	2,006%	7,09%
IMA Geral ex-C	-0,70%	11,61%	2,45%	5,61%	12,93%	23,64%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,94%	12,00%	2,36%	5,73%	13,31%	24,20%	0,30%	0,923%	3,22%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

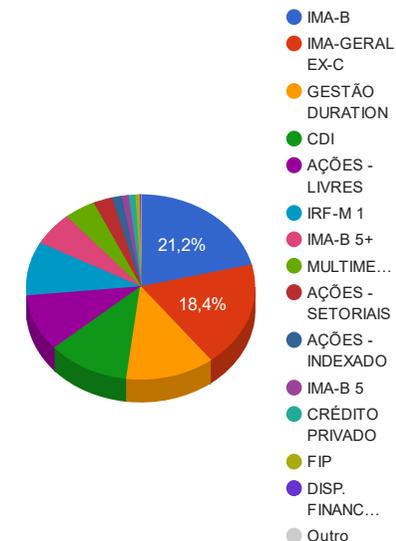
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	5,14%	40,43%	9,78%	25,98%	43,38%	62,52%	-	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2,99%	30,83%	6,94%	19,49%	37,17%	74,43%	1,50%	7,207%	9,58%
S&P 500	3,40%	25,30%	7,33%	14,13%	13,80%	18,64%	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	3,85%	29,00%	8,41%	16,18%	18,41%	27,56%	1,00%	2,814%	16,71%
Ibovespa	0,95%	23,15%	7,02%	11,55%	20,93%	50,38%	-	-	-
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4,39%	32,19%	7,36%	19,50%	29,51%	88,23%	1,85%	6,702%	15,01%
XP INVESTOR FI AÇÕES	3,68%	37,10%	8,12%	21,54%	38,78%	76,88%	2,00%	7,340%	10,99%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,90%	34,35%	7,90%	21,91%	34,31%	73,20%	1,90%	6,122%	11,77%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,85%	7,63%	2,06%	4,23%	9,12%	-	1,60%	0,803%	1,30%
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	0,73%	21,15%	3,21%	14,34%	20,88%	54,23%	2,00%	6,787%	7,79%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,14%	29,60%	5,50%	15,60%	29,51%	80,36%	1,50%	5,829%	12,60%
CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,77%	15,67%	3,18%	7,62%	16,78%	28,31%	0,50%	1,452%	3,41%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3,81%	21,69%	11,99%	20,33%	19,32%	78,01%	2,00%	8,112%	15,36%
FP2 MULTIELSTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	138.130.073,82	53,85%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	59.216.635,25	23,09%
BANCO BRADESCO	17.199.866,48	6,71%
BEM DTVM	16.145.703,72	6,29%
Itaú Unibanco	10.320.184,52	4,02%
Intrag DTVM	6.123.584,92	2,39%
BTG Pactual Serviços Financeiros	3.025.295,11	1,18%
Safra Asset Management	2.278.677,43	0,89%
Banco Santander	2.000.000,00	0,78%
Orla DTVM	1.536.088,84	0,60%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	522.662,93	0,20%

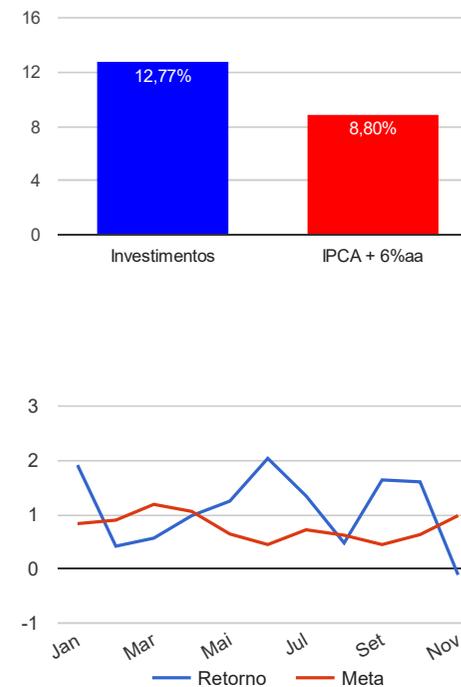


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	54.291.352,20	21,17%
IMA-GERAL EX-C	47.314.523,70	18,45%
GESTÃO DURATION	31.657.079,37	12,34%
CDI	29.610.570,29	11,54%
AÇÕES - LIVRES	25.383.535,27	9,90%
IRF-M 1	24.216.959,73	9,44%
IMA-B 5+	15.098.082,95	5,89%
MULTIMERCADO	11.353.505,63	4,43%
AÇÕES - SETORIAIS	6.907.035,78	2,69%
AÇÕES - INDEXADO	3.500.418,19	1,36%
IMA-B 5	2.567.916,00	1,00%
CRÉDITO PRIVADO	2.426.203,71	0,95%
FIP	1.536.088,84	0,60%
DISP. FINANCEIRA	522.662,93	0,20%
IDKA IPCA 2A	112.838,43	0,04%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

**Acumulado no Ano**



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	2.545.836,00	0,00	0,00	2.567.916,00	22.080,00	0,87%	0,29%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.052.897,02	0,00	0,00	6.079.148,98	26.251,96	0,43%	0,30%	0,43%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	516,98	0,00	0,00	518,87	1,89	0,37%	0,00%	0,37%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	509.199,27	0,00	7.079,50	503.852,53	1.732,76	0,34%	0,01%	0,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.761.595,13	0,00	0,00	21.830.005,30	68.410,17	0,31%	0,08%	0,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	12.621,82	0,00	0,00	12.661,34	39,52	0,31%	0,00%	0,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.379.651,54	0,00	0,00	2.386.954,43	7.302,89	0,31%	0,08%	0,31%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	23.214.174,21	0,00	3.041.000,00	20.241.233,74	68.059,53	0,29%	0,02%	0,33%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	112.604,10	0,00	0,00	112.838,43	234,33	0,21%	0,51%	0,21%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.824.342,35	11.530.059,69	12.872.699,28	2.511.609,16	29.906,40	0,19%	0,00%	0,29%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	13.179.492,67	6.848.700,30	6.340.694,65	9.902,28	0,08%	0,00%	0,17%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.000.000,00	0,00	0,00%	0,29%	0,19%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2.430.855,35	0,00	0,00	2.426.203,71	-4.651,64	-0,19%	0,57%	-0,19%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.000.000,00	0,00	7.983.040,12	-16.959,88	-0,21%	1,96%	-2,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	26.912.679,57	0,00	0,00	26.776.744,20	-135.935,37	-0,51%	0,80%	-0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.931.915,10	0,00	0,00	27.767.482,57	-164.432,53	-0,59%	0,77%	-0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.912.466,35	0,00	191.198,85	7.662.587,25	-58.680,25	-0,74%	0,92%	-0,75%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.907.592,43	0,00	0,00	2.880.335,17	-27.257,26	-0,94%	0,91%	-0,94%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.762.544,55	0,00	0,00	47.314.523,70	-448.020,85	-0,94%	0,92%	-0,94%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,00	2.302.359,73	0,00	2.278.677,43	-23.682,30	-1,03%	2,12%	-2,50%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.586.681,85	0,00	0,00	2.520.415,85	-66.266,00	-2,56%	2,01%	-2,56%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.702.753,17	0,00	0,00	13.140.599,20	-562.153,97	-4,10%	3,06%	-4,10%

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(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.041.415,07	0,00	0,00	1.957.483,75	-83.931,32	-4,11%	3,07%	-4,11%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>-1.358.049,64</b>	<b>-0,65%</b>	<b>0,84%</b>	

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(%)
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	2.702.155,31	1.300.000,00	0,00	4.178.637,30	176.481,99	4,41%	6,70%	4,39%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	3.201.104,21	0,00	0,00	3.324.197,22	123.093,01	3,85%	2,81%	3,85%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.914.162,66	0,00	0,00	3.025.295,11	111.132,45	3,81%	8,11%	3,81%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.875.962,14	0,00	0,00	1.944.947,62	68.985,48	3,68%	7,34%	3,68%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6.706.452,70	0,00	0,00	6.907.035,78	200.583,08	2,99%	7,21%	2,99%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.865.528,62	0,00	0,00	6.995.987,30	130.458,68	1,90%	6,12%	1,90%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	6.855.302,38	0,00	0,00	6.913.696,36	58.393,98	0,85%	0,80%	0,85%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.107.122,42	0,00	0,00	1.115.612,05	8.489,63	0,77%	1,45%	0,77%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.475.022,93	0,00	0,00	3.500.418,19	25.395,26	0,73%	6,79%	0,73%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.225.584,28	0,00	0,00	9.238.667,94	13.083,66	0,14%	5,83%	0,14%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.536.198,83	0,00	0,00	1.536.088,84	-109,99	-0,01%	-	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>915.987,23</b>	<b>1,92%</b>	<b>5,38%</b>	

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(%)
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.042.778,64	0,00	5.155.033,79	0,00	112.255,15	2,23%	6,28%	9,72%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.259.867,34	0,00	2.302.359,73	0,00	42.492,39	1,88%	5,13%	6,55%
Total Exterior					154.747,54	2,12%	0,00%	

