

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	2.698.777,59	2,11%	1.198	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.191.385,10	4,05%	929	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.120.535,93	2,43%	1.360	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.494.849,00	1,17%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.118.591,13	1,65%	693	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.964.729,35	3,87%	965	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.411.497,23	5,00%	956	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.201.475,00	1,72%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	81.687,96	0,06%	65	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.888.659,47	4,59%	59	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.151.429,35	11,04%	683	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.574.029,76	2,79%	621	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.900.940,59	3,04%	105	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.347.023,15	3,39%	876	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.053.989,93	1,60%	72	1,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	401.009,83	0,31%	116	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.144.367,43	3,23%	118	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.615.202,26	1,26%	714	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.756.955,87	7,61%	30	13,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.558.741,98	6,68%	290	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.225.155,38	2,52%	667	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	858.750,50	0,67%	76	0,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2019)

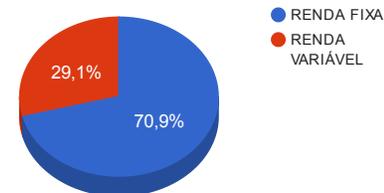
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.570.972,90	1,23%	425	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.029.469,49	2,36%	214	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	5.808.803,40	4,53%	165	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	4.123.476,98	3,22%	56.113	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.119.797,90	0,87%	6.808	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	3.452.895,97	2,69%	118	1,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.347.876,57	2,61%	8.123	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.227.003,37	3,30%	9.355	0,38%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.390.968,31	3,43%	22.826	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.485.373,97	2,72%	58	3,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRH1	Não se aplica	Não se aplica	2.710.000,00	2,11%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	176.683,22	0,14%	749	0,63%	Desenquadrado - RF
Total			128.203.105,87				

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

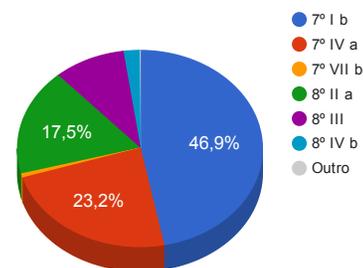
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	60.145.610,61	46,91%	15,00%	25,00%	70,00%	29.596.563,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	76.921.863,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	29.755.422,68	23,21%	10,00%	30,00%	40,00%	21.525.819,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.410.155,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	858.750,50	0,67%	0,00%	0,00%	5,00%	5.551.404,79
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	22.453.293,21	17,51%	7,00%	10,00%	20,00%	3.187.327,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.103.345,65	9,44%	7,00%	10,00%	10,00%	716.964,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.410.155,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.710.000,00	2,11%	2,00%	5,00%	5,00%	3.700.155,29
Desenquadrado - RF	0,00%	176.683,22	0,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-176.683,22
Total Carteira		128.203.105,87					

RENDA FIXA	90.936.467,01	70,93%
RENDA VARIÁVEL	37.266.638,86	29,07%

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 " b "	60.145.610,61	46,91%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	29.755.422,68	23,21%	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%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	858.750,50	0,67%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	22.453.293,21	17,51%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	12.103.345,65	9,44%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.710.000,00	2,11%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	176.683,22	0,14%	0,00%	0,00%
Total	128.203.105,87	100,00%	50,00	240,00

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	51.337.825,40	40,04%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	24.862.379,62	19,39%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTV M	17.534.549,91	13,68%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	15.296.319,77	11,93%	2,48%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.074.777,51	8,64%	0,00%
META ASSET MANAGEMENT	3.452.895,97	2,69%	1,56%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.347.876,57	2,61%	0,01%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	1.119.797,90	0,87%	0,13%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	176.683,22	0,14%	0,40%

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 IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-1,11%	14,80%	3,45%	7,36%	16,15%	24,18%	0,20%	1,048%	3,95%
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%
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%
CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,35%	5,41%	1,26%	2,80%	5,92%	12,62%	0,18%	0,026%	0,19%
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%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	-0,28%	5,64%	1,30%	2,72%	6,18%	13,89%	0,75%	0,388%	1,02%
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%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,27%	6,11%	1,58%	3,41%	6,68%	13,87%	0,18%	0,113%	0,43%
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%

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
IMA-B 5+	-4,07%	27,06%	4,15%	10,21%	29,45%	47,79%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-1,25%	7,82%	2,05%	3,69%	8,66%	19,15%	0,50%	1,007%	2,77%
IMA-B	-2,45%	20,53%	3,71%	8,53%	22,52%	37,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	2,11%	2,31%	1,21%	3,06%	6,64%	0,20%	0,292%	4,15%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,99%	10,11%	3,60%	5,17%	12,09%	17,41%	0,20%	1,036%	6,40%
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 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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-2,56%	20,43%	3,75%	8,45%	22,49%	37,08%	0,20%	2,006%	7,09%
IDKA PRÉ 2 ANOS	-0,35%	11,22%	2,84%	6,18%	13,07%	25,82%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,40%	11,01%	2,76%	6,09%	12,85%	25,22%	0,20%	0,787%	2,63%
IMA-B 5	-0,28%	11,77%	3,13%	5,97%	13,30%	23,89%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	-0,30%	11,51%	3,08%	5,87%	13,00%	23,05%	0,18%	0,631%	2,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,31%	11,56%	3,07%	5,87%	13,06%	23,39%	0,20%	0,646%	2,31%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,05%	52,09%	0,39%	76,22%	52,66%	129,00%	2,00%	0,266%	77,88%

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%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	13,48%	34,24%	23,52%	32,85%	33,37%	26,64%	1,20%	17,330%	15,08%

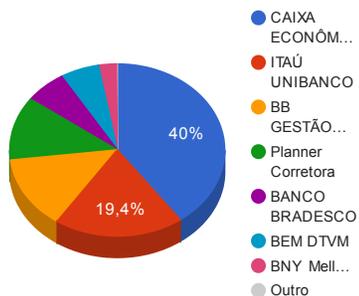
IBX	0,97%	24,34%	6,51%	11,98%	22,74%	52,63%	-	-	-
META VALOR FIAÇÕES	4,01%	19,70%	8,11%	15,42%	18,92%	56,43%	2,50%	9,122%	12,42%

Ibovespa	0,95%	23,15%	7,02%	11,55%	20,93%	50,38%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	3,91%	34,58%	7,18%	19,66%	37,02%	76,30%	2,00%	6,255%	12,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	3,00%	26,89%	3,43%	15,64%	31,54%	69,02%	2,50%	7,257%	9,79%
BB AÇÕES VALOR FIAÇÕES	2,88%	29,98%	6,42%	9,71%	29,09%	-	2,00%	5,941%	15,59%
ITAÚ DUNAMIS FIAÇÕES	1,90%	34,35%	7,90%	21,91%	34,31%	73,20%	1,90%	6,122%	11,77%
AZ QUEST AÇÕES FIAÇÕES	-0,62%	19,59%	3,62%	12,43%	19,55%	60,25%	2,00%	7,729%	8,94%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	-1,45%	19,01%	2,32%	10,90%	19,36%	58,74%	1,50%	6,823%	7,35%

CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,10%	11,23%	3,66%	6,16%	10,93%	22,72%	1,00%	2,864%	3,40%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,77%	15,67%	3,18%	7,62%	16,78%	28,31%	0,50%	1,452%	3,41%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	-0,08%	5,70%	1,28%	2,75%	6,18%	13,51%	1,00%	0,598%	0,83%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	51.337.825,40	40,04%
ITAÚ UNIBANCO	24.862.379,62	19,39%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.534.549,91	13,68%
Planner Corretora	15.296.319,77	11,93%
BANCO BRADESCO	8.045.308,02	6,28%
BEM DTVM	7.497.143,96	5,85%
BNY Mellon Serviços Financeiros	3.452.895,97	2,69%
Orla DTVM	176.683,22	0,14%

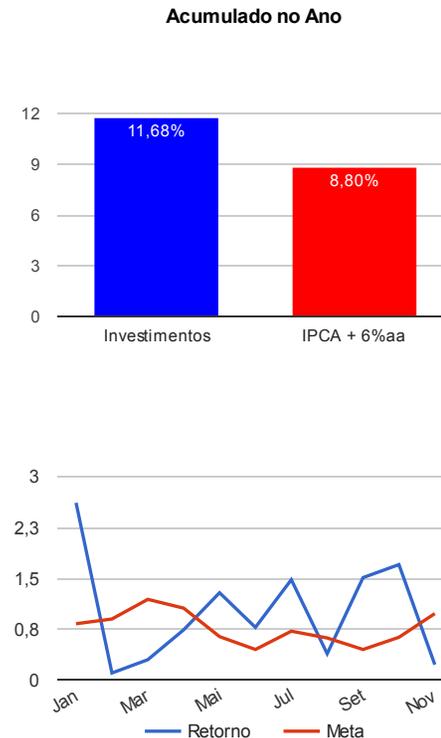


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	32.467.127,20	25,32%
AÇÕES - LIVRES	22.453.293,21	17,51%
IMA-B 5	16.855.549,33	13,15%
IDKA IPCA 2A	14.659.460,97	11,43%
IMA-B	12.722.536,91	9,92%
MULTIMERCADO	12.103.345,65	9,44%
CDI	7.295.357,40	5,69%
IRF-M 1	5.901.001,48	4,60%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.710.000,00	2,11%
CRÉDITO PRIVADO	1.035.433,72	0,81%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	106.357.825,78	7.728.849,03	6.774.629,06	110.118.337,44	2.806.291,69	2,62%	0,83%	314,45%	1,99%
Fevereiro	110.118.337,44	2.527.768,76	1.547.700,70	111.213.080,08	114.674,58	0,10%	0,90%	11,53%	2,36%
Março	111.213.080,08	1.560.630,70	718.884,05	112.390.132,85	335.306,12	0,30%	1,19%	25,07%	3,34%
Abril	112.390.132,85	8.140.343,39	7.038.736,83	114.332.284,75	840.545,34	0,74%	1,06%	69,90%	1,85%
Mai	114.332.284,75	10.581.791,67	9.298.965,83	117.103.777,28	1.488.666,69	1,29%	0,64%	200,98%	4,22%
Junho	117.103.777,28	11.812.666,31	10.953.598,85	118.878.755,91	915.911,17	0,78%	0,45%	172,41%	2,26%
Julho	118.878.755,91	11.653.107,46	12.645.300,64	119.646.225,30	1.759.662,57	1,48%	0,72%	204,38%	1,92%
Agosto	119.646.225,30	2.075.144,56	1.177.165,58	121.011.842,65	467.638,37	0,39%	0,62%	62,51%	3,62%
Setembro	121.011.842,65	1.667.746,69	597.082,07	123.927.235,85	1.844.728,58	1,51%	0,45%	338,38%	1,91%
Outubro	123.927.235,85	1.600.596,92	619.189,75	127.035.860,20	2.127.217,18	1,70%	0,63%	268,71%	2,33%
Novembro	127.035.860,20	616.815,29	2.667.000,00	125.273.778,83	288.103,34	0,23%	0,98%	23,24%	2,30%
Acumulado no ano					12.988.745,63	11,68%	8,80%	132,67%	



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 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.182.647,00	0,00	0,00	2.201.475,00	18.828,00	0,86%	0,29%	0,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.528.999,99	0,00	0,00	8.558.741,98	29.741,99	0,35%	0,00%	0,35%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIA DO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.214.172,27	0,00	0,00	3.225.155,38	10.983,11	0,34%	0,01%	0,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	510.639,29	6.324,57	117.603,20	401.009,83	1.649,17	0,32%	0,03%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.110.756,89	0,00	0,00	3.120.535,93	9.779,04	0,31%	0,08%	0,31%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.610.239,11	0,00	0,00	1.615.202,26	4.963,15	0,31%	0,05%	0,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.690.520,67	0,00	0,00	2.698.777,59	8.256,92	0,31%	0,08%	0,31%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	81.469,79	0,00	0,00	81.687,96	218,17	0,27%	0,11%	0,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.337.995,67	0,00	0,00	4.347.023,15	9.027,48	0,21%	0,51%	0,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.410.831,21	0,00	0,00	6.411.497,23	666,02	0,01%	0,50%	0,01%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	176.767,69	0,00	0,00	176.683,22	-84,47	-0,05%	0,27%	-0,05%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.059.776,82	0,00	0,00	2.053.989,93	-5.786,89	-0,28%	0,39%	-0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	5.906.099,82	0,00	0,00	5.888.659,47	-17.440,35	-0,30%	0,63%	-0,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.585.122,61	0,00	0,00	3.574.029,76	-11.092,85	-0,31%	0,65%	-0,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.208.930,10	0,00	0,00	5.191.385,10	-17.545,00	-0,34%	0,65%	-0,34%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	4.571.528,20	0,00	651.000,00	3.900.940,59	-19.587,61	-0,43%	0,79%	-0,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	13.627.381,49	593.362,54	0,00	14.151.429,35	-69.314,68	-0,49%	0,80%	-0,51%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.509.771,00	0,00	0,00	1.494.849,00	-14.922,00	-0,99%	1,04%	-0,99%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	868.356,00	0,00	0,00	858.750,50	-9.605,50	-1,11%	1,05%	-1,11%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	9.880.130,20	0,00	0,00	9.756.955,87	-123.174,33	-1,25%	1,01%	-1,25%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.155.283,06	17.128,18	0,00	2.118.591,13	-53.820,11	-2,48%	1,96%	-2,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.094.332,03	0,00	0,00	4.964.729,35	-129.602,68	-2,54%	1,99%	-2,54%

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 FIC RENDA FIXA	4.253.329,86	0,00	0,00	4.144.367,43	-108.962,43	-2,56%	2,01%	-2,56%
				Total Renda Fixa	-486.825,85	-0,53%	0,72%	

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(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.388.000,00	0,00	16.000,00	2.710.000,00	338.000,00	14,15%	17,33%	13,48%
META VALOR FIAÇÕES	3.319.767,55	0,00	0,00	3.452.895,97	133.128,42	4,01%	9,12%	4,01%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.077.669,94	0,00	0,00	1.119.797,90	42.127,96	3,91%	6,26%	3,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.639.667,91	0,00	0,00	5.808.803,40	169.135,49	3,00%	7,26%	3,00%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.526.948,79	0,00	0,00	1.570.972,90	44.024,11	2,88%	5,94%	2,88%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.046.583,85	0,00	0,00	4.123.476,98	76.893,13	1,90%	6,12%	1,90%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.180.994,38	0,00	0,00	4.227.003,37	46.008,99	1,10%	2,86%	1,10%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.357.553,72	0,00	0,00	4.390.968,31	33.414,59	0,77%	1,45%	0,77%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.488.238,73	0,00	0,00	3.485.373,97	-2.864,76	-0,08%	0,60%	-0,08%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.368.703,27	0,00	0,00	3.347.876,57	-20.826,70	-0,62%	7,73%	-0,62%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	5.103.316,54	0,00	2.000.000,00	3.029.469,49	-73.847,05	-1,45%	6,82%	-1,45%
Total Renda Variável					785.194,18	2,04%	6,15%	