

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2019)

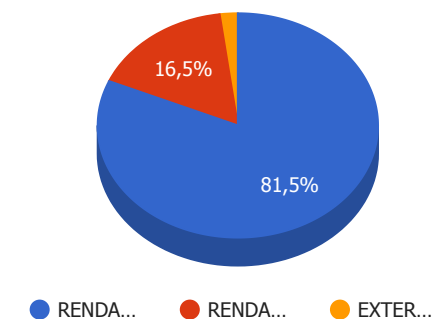
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	54.262.699,78	7,61%	683	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	32.858.796,06	4,61%	28	6,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	174.205,45	0,02%	16	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	6.831.706,90	0,96%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	102.928.767,26	14,44%	375	3,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	29.448.362,99	4,13%	715	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	127.241.990,45	17,86%	693	1,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	41.711.855,17	5,85%	52	12,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	20.582.422,67	2,89%	15	7,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	25.581.312,42	3,59%	1	7,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.085.664,42	0,43%	667	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	126.746.018,07	17,79%	118	6,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	1.129,83	0,00%	1	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	19.094,49	0,00%	47	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.077.112,99	1,27%	74	1,57%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	13.812.959,40	1,94%	88	1,51%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.530.542,20	1,06%	7.509	1,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	31.749.228,71	4,46%	17.809	1,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	7.209.077,51	1,01%	6.722	6,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	20.593.031,21	2,89%	2.521	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	13.406.379,13	1,88%	8.123	1,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	8.068.596,66	1,13%	8.377	1,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.505.367,59	0,77%	6.363	0,73%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	3.483.107,84	0,49%	105	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.911.019,58	0,41%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.963.981,43	0,28%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.055.386,84	0,15%		2,98%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	14.792.454,59	2,08%	2.756	4,06%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			712.632.271,64				

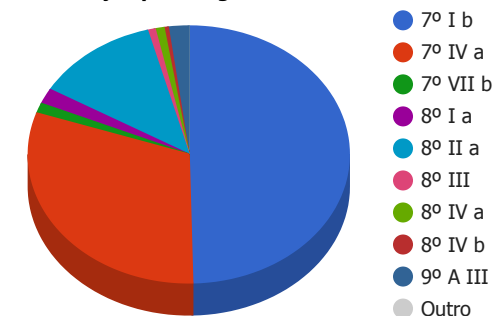
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	712.632.271,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	353.746.528,89	49,64%	10,00%	58,00%	100,00%	358.885.742,75
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	712.632.271,64
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	35.631.613,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	427.579.362,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	427.579.362,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	217.707.272,75	30,55%	0,00%	25,00%	40,00%	67.345.635,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	285.052.908,66
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	142.526.454,33
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	106.894.840,75
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	106.894.840,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	20.224,32	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	35.611.389,26
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	9.077.112,99	1,27%	0,00%	1,00%	5,00%	26.554.500,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	35.631.613,58
Total Renda Fixa	100,00%	580.551.138,95	81,47%	10,00%	84,00%	570,00%	

Distribuição por Segmento


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	13.812.959,40	1,94%	0,00%	2,00%	30,00%	199.976.722,09
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	213.789.681,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	88.556.855,42	12,43%	2,00%	9,00%	20,00%	53.969.598,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	142.526.454,33
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.505.367,59	0,77%	0,00%	1,00%	10,00%	65.757.859,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.394.127,42	0,90%	0,00%	1,00%	5,00%	29.237.486,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.019.368,27	0,42%	0,00%	1,00%	5,00%	32.612.245,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	35.631.613,58
Total Renda Variável	30,00%	117.288.678,10	16,46%	2,00%	14,00%	125,00%	

Distribuição por Artigos


Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2019			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	71.263.227,16
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	71.263.227,16
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	14.792.454,59	2,08%	0,00%	2,00%	10,00%	56.470.772,57
Total Exterior	10,00%	14.792.454,59	2,08%	0,00%	2,00%	30,00%	

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Novembro / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	189.050.904,45	26,53	0,02
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	186.603.565,30	26,19	0,04
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	182.893.915,26	25,66	0,01
WESTERN ASSET	73.739.040,91	10,35	0,16
ICATU VANGUARDA	57.330.541,13	8,04	0,16
AZ QUEST INVESTIMENTOS	13.406.379,13	1,88	0,04
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.483.107,84	0,49	0,02
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	2.911.019,58	0,41	6,94
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.963.981,43	0,28	0,45
REDITUS INVESTIMENTOS	1.055.386,84	0,15	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	174.205,45	0,02	0,00
VILA RICA CAPITAL	19.094,49	0,00	0,52
BRASIL PLURAL	1.129,83	0,00	0,00

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 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 "	353.746.528,89	49,64	10,00	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 "	217.707.272,75	30,55	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 "	20.224,32	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	9.077.112,99	1,27	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	13.812.959,40	1,94	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	88.556.855,42	12,43	2,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.505.367,59	0,77	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.394.127,42	0,90	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.019.368,27	0,42	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,65%	8,96%	2,22%	4,71%	9,80%	20,96%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,00%	527,51%	-21,17%	-26,25%	527,51%	-78,80%	1,14%	5,50%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,83%	13,42%	3,27%	7,53%	15,61%	29,19%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,00%	15,98%	1,43%	4,96%	15,98%	32,82%	0,02%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-4,07%	27,06%	4,15%	10,21%	29,45%	47,79%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00%	26,62%	0,39%	4,75%	26,62%	45,67%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00%	26,50%	0,29%	4,73%	26,50%	45,45%	0,03%	0,10%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,33%	6,31%	1,61%	3,49%	6,91%	14,37%	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00%	6,09%	0,92%	2,79%	6,09%	13,34%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,28%	11,77%	3,13%	5,97%	13,30%	23,89%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,00%	14,34%	1,42%	4,51%	14,34%	27,79%	0,01%	0,04%
110% do CDI (Benchmark)	0,42%	6,14%	1,46%	3,19%	6,71%	14,33%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	-80,20%	-38,73%	-61,98%	-80,20%	-93,72%	-	0,22%
IMA-B (Benchmark)	-2,45%	20,53%	3,71%	8,53%	22,52%	37,40%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	20,27%	0,79%	4,54%	20,27%	35,61%	0,02%	0,07%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,00%	23,17%	0,87%	4,78%	23,17%	41,12%	0,02%	0,09%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00%	20,43%	0,83%	4,56%	20,43%	35,93%	0,02%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	12,52%	1,38%	4,12%	12,52%	24,45%	0,01%	0,03%
IRF-M (Benchmark)	-0,46%	11,34%	2,69%	6,32%	13,05%	24,82%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	11,12%	1,20%	3,98%	11,12%	22,82%	0,01%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,00%	5,37%	0,78%	2,29%	5,37%	12,04%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,51%	3,12%	0,57%	0,88%	3,27%	7,45%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00%	10,98%	1,32%	3,97%	10,98%	23,16%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	15,75%	1,20%	4,35%	15,75%	24,79%	0,01%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	3,40%	25,30%	7,33%	14,13%	13,80%	18,64%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00%	28,92%	6,05%	8,41%	28,92%	25,79%	0,03%	0,17%
IBX-50 (Benchmark)	0,85%	21,20%	6,85%	10,57%	18,64%	47,41%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,00%	20,88%	3,25%	6,64%	20,88%	35,87%	0,07%	0,12%
ICON (Benchmark)	2,99%	43,71%	3,63%	23,17%	43,50%	38,80%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	0,00%	43,62%	1,52%	19,26%	43,62%	25,59%	0,08%	0,17%
IDIV (Benchmark)	2,35%	31,98%	5,87%	14,68%	32,84%	60,60%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00%	32,65%	2,33%	9,04%	32,65%	61,35%	0,06%	0,12%
Ibovespa (Benchmark)	0,95%	23,15%	7,02%	11,55%	20,93%	50,38%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00%	19,59%	1,64%	8,75%	19,59%	50,83%	0,08%	0,09%
SMLL (Benchmark)	5,14%	40,43%	9,78%	25,98%	43,38%	62,52%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00%	37,50%	6,92%	17,16%	37,50%	44,38%	0,07%	0,12%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	155,64%	155,64%	155,64%	155,64%	-	-	-

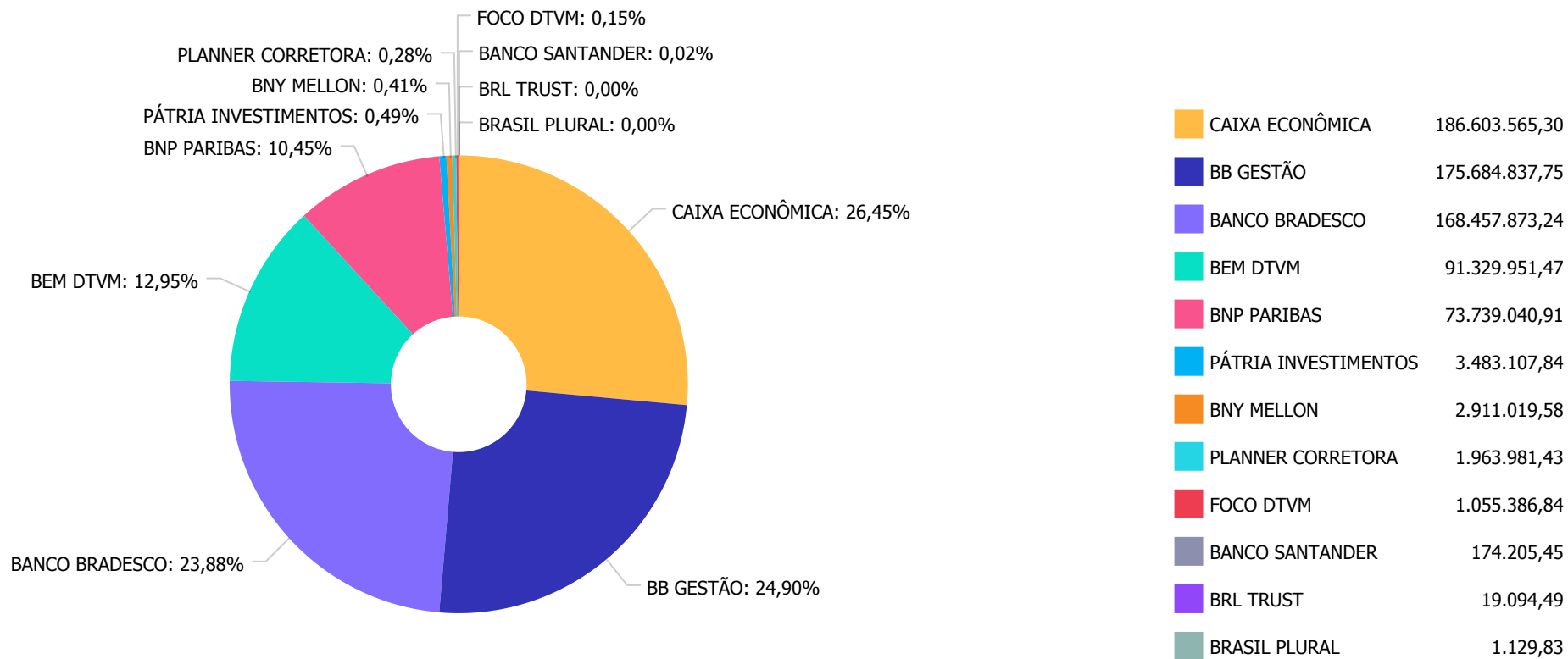
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-7,70%	-23,40%	-25,00%	-7,70%	-15,30%	0,13%	0,31%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00%	33,69%	3,43%	8,73%	33,69%	44,98%	0,07%	0,17%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00%	15,27%	1,44%	2,67%	15,27%	39,67%	0,07%	0,09%

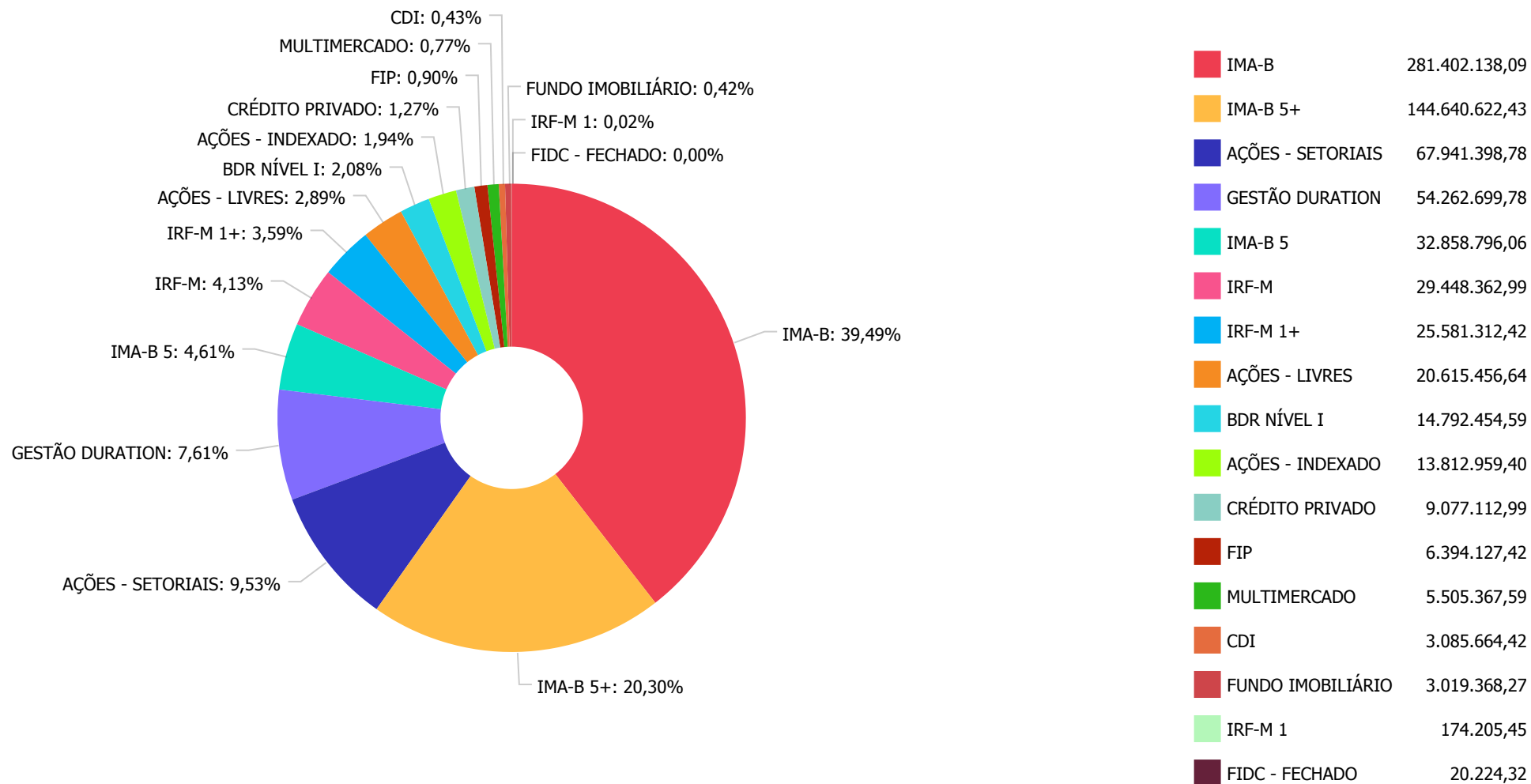
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	9,03%	37,76%	10,40%	23,12%	27,12%	61,05%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00%	37,73%	7,16%	16,57%	37,73%	51,26%	0,05%	0,17%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2019)



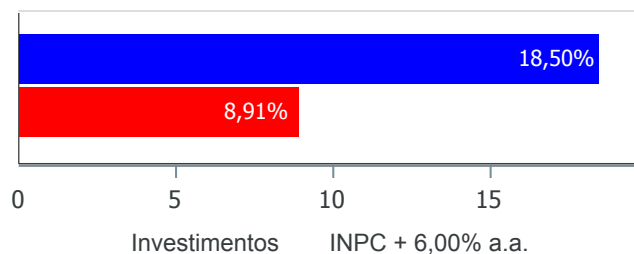
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Novembro / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

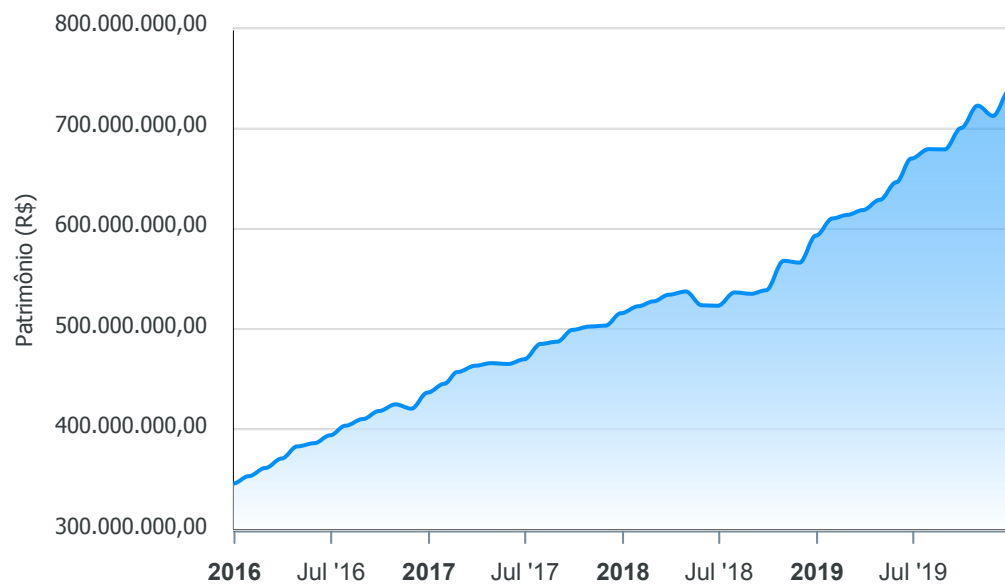
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	593.297.858,41	40.413.142,15	46.233.944,81	610.374.535,60	22.897.479,85	22.897.479,85	3,86%	3,86%	0,87%	0,87%	442,67%	2,56%
Fevereiro	610.374.535,60	8.001.990,69	6.516.050,48	613.910.008,96	2.049.533,15	24.947.013,00	0,33%	4,21%	1,01%	1,89%	223,00%	3,04%
Março	613.910.008,96	7.567.223,02	6.238.636,40	618.691.174,16	3.452.578,58	28.399.591,58	0,56%	4,79%	1,21%	3,12%	153,43%	4,60%
Abril	618.691.174,16	32.560.118,28	31.258.086,87	628.908.633,52	8.915.427,95	37.315.019,53	1,44%	6,30%	1,09%	4,25%	148,32%	2,29%
Mai	628.908.633,52	81.366.215,48	80.330.403,76	646.486.988,71	16.542.543,47	53.857.563,00	2,63%	9,09%	0,66%	4,94%	184,17%	2,88%
Junho	646.486.988,71	20.072.469,68	18.636.920,29	670.103.065,81	22.180.527,71	76.038.090,71	3,42%	12,82%	0,45%	5,41%	237,13%	2,74%
Julho	670.103.065,81	8.689.395,21	7.366.878,54	679.509.259,28	8.083.676,80	84.121.767,51	1,20%	14,18%	0,63%	6,08%	233,42%	1,84%
Agosto	679.509.259,28	63.656.133,15	62.399.433,56	679.253.757,07	-1.512.201,80	82.609.565,71	-0,22%	13,93%	0,63%	6,75%	206,51%	3,65%
Setembro	679.253.757,07	31.578.896,39	28.551.636,07	700.604.449,80	18.323.432,41	100.932.998,12	2,69%	16,99%	0,44%	7,21%	235,60%	2,57%
Outubro	700.604.449,80	8.225.789,32	6.844.340,18	722.875.590,23	20.889.691,29	121.822.689,41	2,98%	20,47%	0,57%	7,83%	261,57%	2,94%
Novembro	722.875.590,23	50.055.121,30	48.434.908,87	712.632.271,64	-11.863.531,02	109.959.158,39	-1,64%	18,50%	1,01%	8,91%	207,59%	2,75%

Investimentos x Meta Atuarial



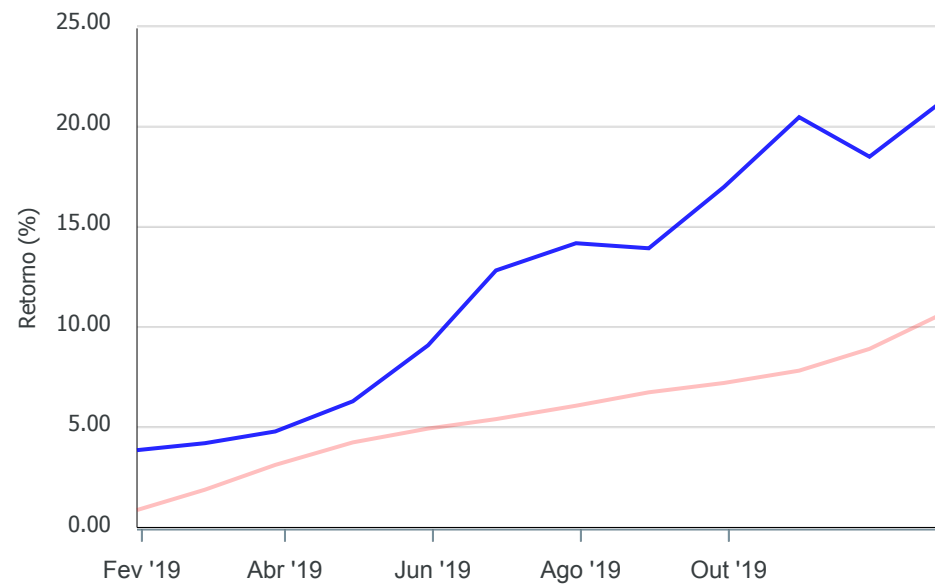
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	12.131,61	0,00	331,99	19.094,49	7.294,87	60,13%	61,86%	113,50%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	173.660,90	0,00	0,00	174.205,45	544,55	0,31%	0,31%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	837.331,03	9.707.333,77	7.477.194,11	3.085.664,42	18.193,73	0,17%	0,34%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	40.157.394,75	0,00	40.131.388,87	0,00	-26.005,88	-0,06%	-0,34%	0,65%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.094.516,08	0,00	0,00	9.077.112,99	-17.403,09	-0,19%	-0,19%	0,57%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.244.511,72	40.131.388,87	0,00	54.262.699,78	-113.200,81	-0,21%	-0,51%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.851.772,44	0,00	0,00	6.831.706,90	-20.065,54	-0,29%	-0,29%	0,61%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.588.465,05	0,00	0,00	29.448.362,99	-140.102,06	-0,47%	-0,47%	0,79%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	33.192.635,53	0,00	0,00	32.858.796,06	-333.839,47	-1,01%	-1,01%	1,15%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	25.917.838,23	0,00	0,00	25.581.312,42	-336.525,81	-1,30%	-1,30%	1,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	130.479.893,06	0,00	0,00	127.241.990,45	-3.237.902,61	-2,48%	-2,48%	1,96%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	130.078.385,30	0,00	0,00	126.746.018,07	-3.332.367,23	-2,56%	-2,56%	2,01%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	21.247.760,24	0,00	0,00	20.582.422,67	-665.337,57	-3,13%	-3,13%	2,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	43.500.340,49	0,00	0,00	41.711.855,17	-1.788.485,32	-4,11%	-4,11%	3,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	107.176.970,47	216.398,66	0,00	102.928.767,26	-4.464.601,87	-4,16%	-4,16%	3,12%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	1.542,54	0,00	0,00	1.129,83	-412,71	-26,76%	-	-
Total Renda Fixa	592.555.149,44	50.055.121,30	47.608.914,97	580.551.138,95	-14.450.216,82	-2,43%		2,00%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.437.084,82	0,00	825.993,90	1.963.981,43	352.890,51	14,48%	-19,41%	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7.187.675,88	0,00	0,00	7.530.542,20	342.866,32	4,77%	4,77%	7,30%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.301.935,00	0,00	0,00	5.505.367,59	203.432,59	3,84%	3,84%	2,81%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	7.810.193,00	0,00	0,00	8.068.596,66	258.403,66	3,31%	3,31%	7,81%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	13.670.767,56	0,00	0,00	13.812.959,40	142.191,84	1,04%	1,04%	6,75%
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.150.014,88	0,00	0,00	7.209.077,51	59.062,63	0,83%	0,83%	7,03%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	31.604.419,93	0,00	0,00	31.749.228,71	144.808,78	0,46%	0,46%	5,77%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.911.793,30	0,00	0,00	2.911.019,58	-773,72	-0,03%	-	-
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	20.602.907,19	0,00	0,00	20.593.031,21	-9.875,98	-0,05%	-0,05%	6,57%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	3.485.406,03	0,00	0,00	3.483.107,84	-2.298,19	-0,07%	-0,07%	0,04%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.057.017,08	0,00	0,00	1.055.386,84	-1.630,24	-0,15%	-7,69%	12,97%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.489.778,41	0,00	0,00	13.406.379,13	-83.399,28	-0,62%	-0,62%	7,73%
Total Renda Variável	116.708.993,08	0,00	825.993,90	117.288.678,10	1.405.678,92	1,20%		6,35%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.611.447,71	0,00	0,00	14.792.454,59	1.181.006,88	8,68%	8,68%	5,10%
Total Renda Variável	13.611.447,71	0,00	0,00	14.792.454,59	1.181.006,88	8,68%		5,10%

