

# 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
TÍTULOS PÚBLICOS			86.763.748,73	15,47%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	55.028.857,03	9,81%	956	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	54.035.107,21	9,63%	693	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.890.866,38	9,25%	1.198	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	45.689.571,14	8,15%	575	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.829.631,33	10,31%	450	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	47.710.500,99	8,51%	683	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	45.688.975,75	8,15%	290	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.806.533,30	0,68%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.265.683,98	0,23%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	1.385.658,50	0,25%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.935.011,03	0,35%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	2.260,84	0,00%	11	2,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	2.127,87	0,00%	2	5,38%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.863.795,05	0,33%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se aplica	Não se aplica	1.137,58	0,00%	5	2,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	21.795.674,06	3,89%	7.508	1,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	19.370.346,25	3,45%	8.123	2,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	15.629.235,45	2,79%	1.963	5,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	27.495.828,38	4,90%	56.113	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	223.759,47	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.277.548,95	1,30%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2019)

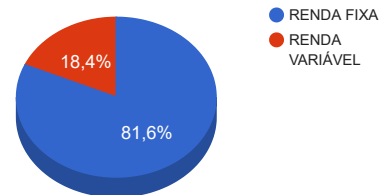
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIELABORADORA FIP	Não se aplica	Não se aplica	936,93	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.293.875,78	0,23%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.983.342,65	0,35%		5,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	4.839.936,41	0,86%		6,78%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se aplica	Não se aplica	2.898.800,00	0,52%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	322.944,54	0,06%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>558.031.695,58</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.834.378,65				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>560.866.074,23</b>				

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

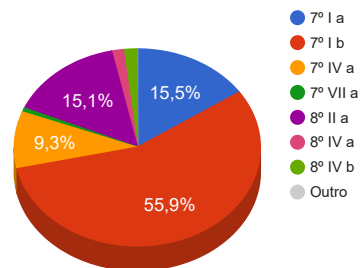
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	86.763.748,73	15,55%	0,00%	15,00%	100,00%	471.267.946,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	312.184.534,08	55,94%	0,00%	49,00%	100,00%	245.847.161,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	52.146.851,53	9,34%	0,00%	16,50%	40,00%	171.065.826,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.804.332,37	0,68%	0,00%	0,50%	2,00%	7.356.301,54
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	167.409.508,67
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	167.409.508,67
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	84.291.084,14	15,11%	0,00%	12,40%	20,00%	27.315.254,98
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	223.759,47	0,04%	0,00%	0,10%	3,00%	16.517.191,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.572.361,66	1,54%	0,00%	1,50%	3,00%	8.168.589,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.045.023,60	1,80%	0,00%	1,00%	3,00%	6.695.927,27
Total Carteira		558.031.695,58					

RENDA FIXA	457.733.845,36	82,03%
RENDA VARIÁVEL	103.132.228,87	18,48%

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 "	86.763.748,73	15,47%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	312.184.534,08	55,66%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	52.146.851,53	9,30%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.804.332,37	0,68%	0,00%	2,00%
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 "	84.291.084,14	15,03%	5,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	223.759,47	0,04%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.572.361,66	1,53%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.045.023,60	1,79%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>558.031.695,58</b>	<b>99,49%</b>	<b>5,00</b>	<b>449,00</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
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	160.568.989,35	28,63%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	151.615.544,73	27,03%	0,01%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	86.763.748,73	15,47%	-
ITAÚ UNIBANCO	73.184.804,13	13,05%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	41.166.020,31	7,34%	0,12%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	15.629.235,45	2,79%	0,03%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	7.283.075,24	1,30%	0,05%
Queluz Gestão de Recursos	6.225.594,91	1,11%	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.965.303,80	1,06%	2,52%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.898.800,00	0,52%	0,27%
Reditus Investimentos	1.983.342,65	0,35%	-
PETRA Capital	1.863.795,05	0,33%	0,03%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.293.875,78	0,23%	3,09%
Veritas Capital Management	1.265.683,98	0,23%	0,06%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	322.944,54	0,06%	0,00%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
VALORA INVESTIMENTOS	936,93	0,00%	0,00%%

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 + 7,00% ao ano	1,05%	9,75%	2,31%	4,41%	10,50%	22,96%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,18%	1,24%	-1,33%	-0,37%	0,89%	800,45%	0,00%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,84%	7,02%	1,60%	2,96%	7,52%	16,43%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,20%	-8,98%	-0,52%	-6,98%	-9,12%	-14,14%	0,15%	0,047%	6,04%
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%
120% do CDI	0,46%	6,71%	1,60%	3,49%	7,35%	15,73%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-26,76%	-80,20%	-50,74%	-67,11%	-81,75%	-93,22%	0,00%	-	20,21%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-26,76%	-80,20%	-50,74%	-67,11%	-81,75%	-93,58%	0,00%	-	20,21%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-26,76%	-80,20%	-50,74%	-67,11%	-81,75%	-93,96%	0,00%	-	20,21%
IRF-M 1	0,33%	6,31%	1,61%	3,49%	6,91%	14,37%	-	-	-
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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,01%	10,49%	2,86%	5,28%	11,88%	22,68%	-	-	-
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%	-	-	-
BRA1 FI RENDA FIXA	-0,32%	-45,26%	1,57%	-43,40%	-44,83%	-37,44%	1,30%	0,373%	44,93%

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
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-1,21%	11,12%	1,76%	4,13%	12,08%	-	0,00%	2,573%	4,06%
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%
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%
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%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,31%	-24,07%	-2,00%	-23,58%	-21,14%	-13,30%	1,30%	0,607%	18,89%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



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

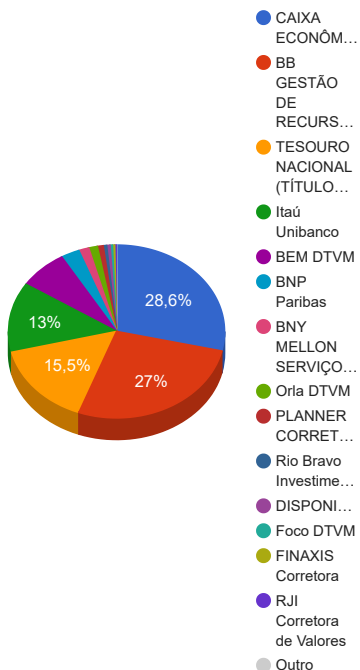
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	5,14%	40,43%	9,78%	25,98%	43,38%	62,52%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,14%	35,05%	8,74%	28,02%	41,40%	79,34%	2,00%	8,000%	11,95%
IFIX	3,52%	22,91%	8,79%	13,22%	25,64%	30,60%	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	7,58%	-3,79%	5,39%	10,02%	-2,50%	-1,58%	0,25%	6,991%	13,16%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	3,01%	-87,92%	14,59%	-88,59%	-87,61%	-88,40%	0,35%	4,421%	13,68%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	155,64%	155,64%	155,64%	155,64%	-	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-7,69%	-7,70%	-23,40%	-25,00%	-7,69%	-15,30%	1,50%	12,965%	31,24%
IPCA + 11,00% ao ano	1,35%	13,52%	3,27%	6,37%	14,64%	32,28%	-	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,20%	0,027%	119,37%
Ibovespa	0,95%	23,15%	7,02%	11,55%	20,93%	50,38%	-	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,90%	34,35%	7,90%	21,91%	34,31%	73,20%	1,90%	6,122%	11,77%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,54%	33,00%	8,74%	12,56%	34,43%	43,37%	2,00%	5,437%	15,10%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-0,62%	19,59%	3,62%	12,43%	19,55%	60,25%	2,00%	7,729%	8,94%
IPCA	0,51%	3,12%	0,57%	0,88%	3,27%	7,45%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
CDI	0,38%	5,56%	1,33%	2,90%	6,09%	12,95%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,86%	-0,11%	-2,60%	-3,83%	1,44%	-94,72%	0,00%	0,019%	3,25%

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

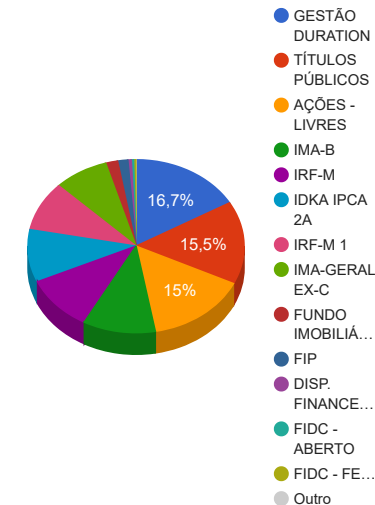
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,10%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	160.568.989,35	28,63%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	151.615.544,73	27,03%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	86.763.748,73	15,47%
Itaú Unibanco	73.184.804,13	13,05%
BEM DTVM	41.166.957,24	7,34%
BNP Paribas	15.629.235,45	2,79%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	8.571.424,73	1,53%
Orla DTVM	7.350.962,30	1,31%
PLANNER CORRETORA	4.839.936,41	0,86%
Rio Bravo Investimentos	2.898.800,00	0,52%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.834.378,65	0,51%
Foco DTVM	1.983.342,65	0,35%
FINAXIS Corretora	1.863.795,05	0,33%
RJI Corretora de Valores	1.265.683,98	0,23%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	322.944,54	0,06%
BRASIL PLURAL S.A. BANCO MÚLTIPLO	5.526,29	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	93.399.476,74	16,65%
TÍTULOS PÚBLICOS	86.763.748,73	15,47%
AÇÕES - LIVRES	84.291.084,14	15,03%
IMA-B	60.492.982,99	10,79%
IRF-M	57.829.631,33	10,31%
IDKA IPCA 2A	55.028.857,03	9,81%
IRF-M 1	51.890.866,38	9,25%
IMA-GERAL EX-C	45.689.571,14	8,15%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.045.023,60	1,79%
FIP	8.572.361,66	1,53%
DISP. FINANCEIRA	2.834.378,65	0,51%
FIDC - ABERTO	1.935.011,03	0,35%
FIDC - FECHADO	1.869.321,34	0,33%
MULTIMERCADO	223.759,47	0,04%



Carteira de Títulos Públicos - base (novembro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.817,158022	992.130,00	2.862.868,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.817,158022	998.799,60	2.901.040,10
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.817,158022	1.000.585,27	2.939.211,68
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.817,158022	1.124.114,15	3.244.584,32
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.817,158022	1.006.644,67	2.862.868,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.817,158022	999.750,00	2.862.868,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1100	1.352,073136	3.817,158022	1.487.280,45	4.198.873,82
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.817,158022	859.423,87	2.404.809,55
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.817,158022	136.416,48	381.715,80
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.817,158022	997.614,60	2.786.525,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1100	1.345,077073	3.817,158022	1.479.584,78	4.198.873,82
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.817,158022	1.098.188,08	3.359.099,06
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.526,204039	895.805,83	2.760.984,46
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1010	1.468,534139	4.526,204039	1.483.219,48	4.571.466,08
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1180	1.468,534144	4.526,204039	1.732.870,29	5.340.920,77
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.526,204039	1.249.170,73	4.146.002,90
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.383,804067	1.411.663,50	3.879.666,60
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.383,804067	1.171.463,51	3.252.782,62
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.383,804067	798.050,50	2.191.902,03
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.383,804067	1.046.269,96	2.902.078,29
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.383,804067	960.617,17	2.630.282,44
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.383,804067	1.479.336,56	4.112.008,21

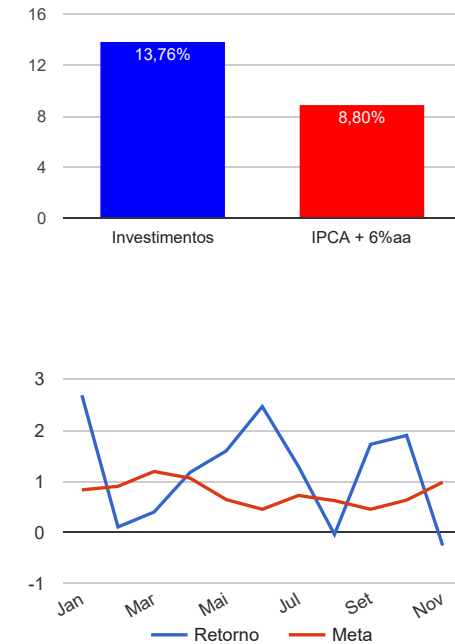
Carteira de Títulos Públicos - base (novembro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.383,804067	798.050,50	2.191.902,03
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.383,804067	1.002.194,60	3.024.824,81
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.383,804067	258.043,50	789.084,73
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.383,804067	909.797,78	2.766.180,37
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.383,804067	429.654,20	1.315.141,22
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1300	1.602,545169	4.383,804067	2.083.308,72	5.698.945,29
TDA - Título da Dívida Agrária	01/12/2019	27/02/2004	1782	61,61359147	104,510000	109.795,42	186.236,82

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	467.642.250,96	4.900.000,00	2.655.136,10	482.501.862,21	12.614.747,35	2,68%	0,83%	322,82%	1,94%
Fevereiro	482.501.862,21	5.913.071,48	3.583.646,50	485.336.511,02	505.223,83	0,10%	0,90%	11,64%	2,02%
Março	485.336.511,02	48.067.650,69	44.732.641,08	490.604.118,18	1.932.597,55	0,40%	1,19%	33,13%	3,26%
Abril	490.604.118,18	4.190.243,99	3.800.177,72	496.753.963,42	5.759.778,97	1,17%	1,06%	110,72%	1,77%
Mai	496.753.963,42	67.431.373,41	78.563.264,11	493.537.200,28	7.915.127,56	1,59%	0,64%	248,71%	2,08%
Junho	493.537.200,28	27.281.265,70	13.423.666,88	519.888.643,79	12.493.844,69	2,46%	0,45%	546,78%	2,14%
Julho	519.888.643,79	10.542.289,75	8.532.379,16	528.641.681,23	6.743.126,85	1,29%	0,72%	178,40%	1,81%
Agosto	528.641.681,23	8.270.000,00	6.746.432,08	529.938.850,80	-226.398,35	-0,04%	0,62%	-6,88%	2,92%
Setembro	529.938.850,80	4.805.573,90	3.039.330,86	540.859.751,47	9.154.657,63	1,72%	0,45%	385,56%	2,26%
Outubro	540.859.751,47	5.470.000,00	3.758.887,90	552.860.607,90	10.289.744,33	1,90%	0,63%	299,24%	2,13%
Novembro	552.860.607,90	5.780.000,00	7.025.820,60	550.185.207,83	-1.429.579,47	-0,26%	0,98%	-26,50%	1,96%
Acumulado no ano					65.752.870,94	13,76%	8,80%	156,36%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	45.530.204,71	0,00	0,00	45.688.975,75	158.771,04	0,35%	0,00%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.267.569,06	3.810.000,00	4.350.000,00	51.890.866,38	163.297,32	0,29%	0,08%	0,31%
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.653.575,88	370.000,00	0,00	55.028.857,03	5.281,15	0,01%	0,50%	0,01%
LME REC IPKA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.938.489,98	0,00	0,00	1.935.011,03	-3.478,95	-0,18%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.867.578,60	0,00	0,00	1.863.795,05	-3.783,55	-0,20%	0,05%	-0,21%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.269.598,79	0,00	0,00	1.265.683,98	-3.914,81	-0,31%	0,61%	-0,31%
BRA1 FI RENDA FIXA	1.390.056,14	0,00	0,00	1.385.658,50	-4.397,64	-0,32%	0,37%	-0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.114.596,40	0,00	0,00	57.829.631,33	-284.965,07	-0,49%	0,80%	-0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	47.952.709,09	0,00	0,00	47.710.500,99	-242.208,10	-0,51%	0,80%	-0,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.122.205,34	0,00	0,00	45.689.571,14	-432.634,20	-0,94%	0,92%	-0,94%
TÍTULOS PÚBLICOS	88.023.484,60	0,00	356.049,64	86.763.748,73	-903.686,23	-1,03%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.853.048,49	0,00	0,00	3.806.533,30	-46.515,19	-1,21%	2,57%	-1,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	55.410.128,26	0,00	0,00	54.035.107,21	-1.375.021,05	-2,48%	1,96%	-2,48%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	2.905,14	0,00	0,00	2.127,87	-777,27	-26,75%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	3.086,69	0,00	0,00	2.260,84	-825,85	-26,76%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	1.553,13	0,00	0,00	1.137,58	-415,55	-26,76%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-2.975.273,95</b>	<b>-0,65%</b>	<b>0,75%</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(%)
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.156.730,94	0,00	0,00	1.293.875,78	137.144,84	11,86%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	300.190,08	0,00	1.785,30	322.944,54	24.539,76	8,17%	6,99%	7,58%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	20.928.736,19	0,00	0,00	21.795.674,06	866.937,87	4,14%	8,00%	4,14%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.814.000,00	0,00	18.000,00	2.898.800,00	102.800,00	3,65%	4,42%	3,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	26.983.096,00	0,00	0,00	27.495.828,38	512.732,38	1,90%	6,12%	1,90%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14.550.392,73	1.000.000,00	0,00	15.629.235,45	78.842,72	0,51%	5,44%	0,54%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.279.483,25	0,00	0,00	7.277.548,95	-1.934,30	-0,03%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.986.406,29	0,00	0,00	1.983.342,65	-3.063,64	-0,15%	12,97%	-7,69%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.376.176,83	0,00	2.499.985,66	4.839.936,41	-36.254,76	-0,49%	-	0,00%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	18.480.270,37	1.000.000,00	0,00	19.370.346,25	-109.924,12	-0,56%	7,73%	-0,62%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	225.710,61	0,00	0,00	223.759,47	-1.951,14	-0,86%	0,02%	-0,86%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	966,78	0,00	0,00	936,93	-29,85	-3,09%	0,03%	-3,09%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.569.839,76</b>	<b>1,54%</b>	<b>6,89%</b>	