

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2018



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 / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	209.310,03	0,27%	632	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	752.795,09	0,97%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.119.973,51	10,42%	336	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.996.934,64	11,54%	1.472	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.802.454,64	4,88%	717	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.156.763,35	1,48%	73	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.003.819,87	8,99%	711	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.354.742,00	1,74%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.131.342,94	1,45%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.431.570,82	1,84%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	96.856,71	0,12%	1.269	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	73.107,05	0,09%	756	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	658.851,31	0,85%	504	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	D+1	Não há	158.145,96	0,20%	66	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	984.510,69	1,26%	266	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.146.768,80	1,47%	435	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.127.841,43	2,73%	56	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.568.809,03	3,30%	190	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.113.239,61	3,99%	807	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.773.905,18	11,26%	329	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.460.650,29	5,72%	13.272	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	1.066.789,14	1,37%	73	0,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2018)

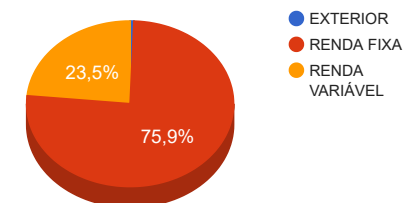
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.482.081,46	1,90%	43	1,60%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.555.393,90	2,00%	6	2,51%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+33	Não há	620.987,48	0,80%	31	1,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+45	Não há	861.742,55	1,11%	54	0,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.744.097,41	3,52%	1.497	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.298.425,58	4,23%	451	8,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.225.609,20	1,57%	151	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.531.186,76	3,25%	3.053	8,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	1.055.399,53	1,35%	955	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	513.868,35	0,66%	223	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.138.468,06	2,74%	729	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	263.363,08	0,34%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	456.924,25	0,59%	74	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso III
TOTAL -			77.936.729,70				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (novembro / 2018)

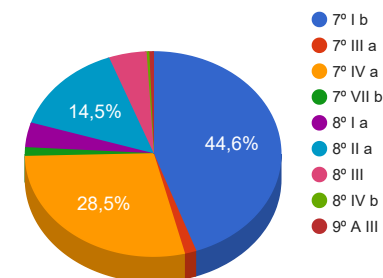
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	34.788.521,96	44,64%	15,00%	25,00%	90,00%	35.354.534,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	1.142.656,65	1,47%	5,00%	10,00%	60,00%	45.619.381,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	22.191.214,34	28,47%	5,00%	10,00%	40,00%	8.983.477,54
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	15,00%	11.690.509,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.896.836,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.066.789,14	1,37%	0,00%	5,00%	5,00%	2.830.047,35
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	3.037.475,36	3,90%	0,00%	5,00%	10,00%	4.756.197,61
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	11.282.048,98	14,48%	0,00%	5,00%	20,00%	4.305.296,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.707.735,94	4,76%	0,00%	10,00%	10,00%	4.085.937,03
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.896.836,49
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	263.363,08	0,34%	0,00%	5,00%	5,00%	3.633.473,41
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	456.924,25	0,59%	0,00%	0,00%	0,00%	-456.924,25
Total Carteira		77.936.729,70					

EXTERIOR	456.924,25	0,59%
RENDA FIXA	59.189.182,09	75,95%
RENDA VARIÁVEL	18.290.623,36	23,47%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: novembro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	34.788.521,96	44,64%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.142.656,65	1,47%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	22.191.214,34	28,47%	5,00%	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 "	1.066.789,14	1,37%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	3.037.475,36	3,90%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	11.282.048,98	14,48%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	3.707.735,94	4,76%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	263.363,08	0,34%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	456.924,25	0,59%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	77.936.729,70	100,00%	25,00	270,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 2018)

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	59.084.734,21	75,81%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.328.065,56	10,69%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	5.349.812,13	6,86%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.890.866,21	4,99%	0,00%
VINCI PARTNERS	861.742,55	1,11%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	263.363,08	0,34%	0,02%
SICREDI	158.145,96	0,20%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	0,99%	9,06%	5,97%	6,58%	10,42%	27,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	9,10%	6,13%	6,68%	10,39%	27,51%	0,20%	1,205%	3,49%

IMA-B	0,90%	11,22%	7,95%	9,60%	12,15%	29,10%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,92%	11,13%	7,90%	9,48%	12,04%	28,36%	0,20%	2,076%	5,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	10,97%	7,87%	9,45%	11,87%	28,47%	0,20%	2,116%	5,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	11,03%	7,93%	9,50%	11,92%	28,55%	0,20%	2,111%	5,48%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,12%	4,23%	5,99%	4,81%	4,85%	13,85%	0,20%	1,915%	6,73%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,41%	3,06%	1,60%	3,49%	11,70%	0,20%	0,615%	4,37%

IRF-M 1	0,54%	6,38%	2,08%	3,77%	6,98%	19,62%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,53%	6,24%	2,07%	3,68%	6,85%	19,31%	0,20%	0,075%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	6,23%	2,07%	3,69%	6,83%	19,23%	0,20%	0,073%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,19%	2,06%	3,67%	6,78%	19,10%	0,10%	0,073%	0,55%

CDI	0,49%	5,90%	1,51%	3,17%	6,47%	17,72%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	5,84%	1,52%	3,13%	6,46%	17,83%	0,20%	0,004%	0,06%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,49%	5,69%	1,45%	3,06%	6,24%	17,42%	0,25%	0,012%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,48%	5,74%	1,49%	3,10%	6,31%	17,59%	0,20%	0,013%	0,03%

Selic	0,49%	5,91%	1,51%	3,18%	6,48%	17,74%	-	-	-
-------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---	---

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	5,82%	1,49%	3,12%	6,38%	18,08%	0,20%	0,001%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano	0,25%	9,25%	2,15%	5,28%	10,24%	20,10%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	3,76%	2,28%	2,75%	4,49%	7,28%	0,20%	0,128%	4,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	8,83%	5,29%	6,99%	9,97%	26,21%	0,15%	1,259%	4,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	15,90%	4,96%	11,62%	16,71%	27,17%	0,20%	1,149%	4,52%
IDKA IPCA 2 Anos	0,17%	8,40%	3,51%	5,44%	9,65%	24,73%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	8,05%	3,40%	4,85%	8,99%	22,88%	0,20%	0,692%	2,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	7,90%	3,40%	4,89%	8,83%	22,80%	0,20%	0,695%	2,35%
IMA-B 5	0,14%	8,39%	4,16%	5,90%	9,35%	23,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	8,18%	4,12%	5,80%	9,12%	23,25%	0,20%	0,927%	3,05%
IPCA	-0,21%	3,59%	0,72%	2,23%	4,05%	6,96%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,75%	6,63%	1,68%	3,24%	7,48%	22,87%	0,40%	1,159%	1,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,37%	6,40%	2,74%	4,33%	7,25%	19,88%	0,002	0,980%	1,78%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,33%	9,76%	4,14%	6,63%	10,89%	28,20%	0,20%	0,797%	3,01%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2018)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,28%	15,21%	19,75%	18,35%	20,90%	43,07%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,85%	20,87%	17,53%	17,39%	27,84%	56,37%	1,50%	9,606%	20,05%
SMLL	4,79%	5,91%	15,67%	12,13%	13,35%	57,33%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	6,17%	10,24%	16,14%	12,64%	18,92%	48,28%	1,72%	8,672%	18,69%
ICON	4,08%	-9,44%	9,35%	5,68%	-3,27%	18,60%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	3,30%	-12,21%	8,24%	3,31%	-6,29%	14,83%	1,60%	9,292%	20,16%
IGCT	2,83%	17,09%	18,74%	18,98%	24,58%	50,74%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	2,78%	16,67%	18,56%	18,74%	24,19%	49,58%	0,90%	9,987%	20,99%
IFIX	2,59%	3,32%	7,53%	3,90%	3,95%	25,22%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
Ibovespa	2,38%	17,15%	16,73%	16,61%	24,36%	44,58%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,02%	10,99%	23,97%	17,38%	15,74%	36,87%	2,00%	9,765%	22,09%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,97%	-	25,39%	20,72%	-	-	2,00%	9,908%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2,89%	21,56%	16,03%	15,04%	28,49%	58,42%	2,50%	8,857%	19,02%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2,33%	16,56%	16,40%	16,21%	23,82%	42,76%	0,50%	10,214%	21,67%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,80%	-	4,63%	-	-	-	1,60%	0,830%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	0,60%	-	3,39%	3,84%	-	-	1,60%	0,422%	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2018)

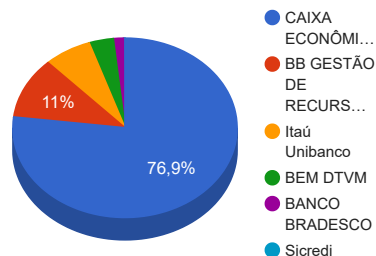
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,49%	5,90%	1,51%	3,17%	6,47%	17,72%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,62%	6,49%	2,53%	3,66%	7,35%	20,37%	0,60%	0,720%	2,57%

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (novembro / 2018)

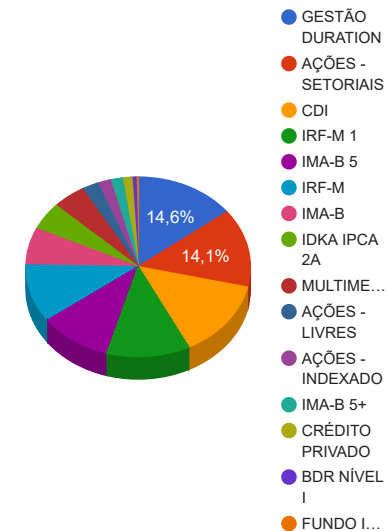
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	4,77%	21,40%	-10,57%	6,01%	26,69%	48,31%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	4,78%	19,52%	-10,58%	5,36%	24,50%	44,53%	0,70%	9,076%	17,21%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (novembro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	59.946.476,76	76,92%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.591.428,64	11,02%
Itaú Unibanco	5.349.812,13	6,86%
BEM DTVM	2.744.097,41	3,52%
BANCO BRADESCO	1.146.768,80	1,47%
Sicredi	158.145,96	0,20%

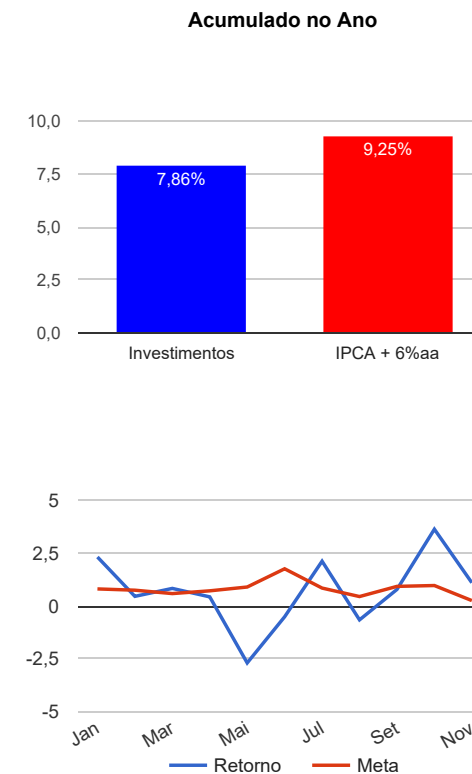


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	11.342.714,21	14,55%
AÇÕES - SETORIAIS	10.990.846,20	14,10%
CDI	10.848.500,13	13,92%
IRF-M 1	9.251.937,31	11,87%
IMA-B 5	8.135.162,81	10,44%
IRF-M	8.119.973,51	10,42%
IMA-B	5.193.801,29	6,66%
IDKA IPCA 2A	3.875.561,69	4,97%
MULTIMERCADO	3.707.735,94	4,76%
AÇÕES - LIVRES	1.846.596,68	2,37%
AÇÕES - INDEXADO	1.482.081,46	1,90%
IMA-B 5+	1.354.742,00	1,74%
CRÉDITO PRIVADO	1.066.789,14	1,37%
BDR NÍVEL I	456.924,25	0,59%
FUNDO IMOBILIÁRIO	263.363,08	0,34%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	74.839.932,74	5.062.074,36	6.070.623,12	75.556.887,15	1.725.503,17	2,31%	0,80%	287,67%	2,05%
Fevereiro	75.556.887,15	2.895.072,78	3.934.061,59	74.857.607,11	339.708,77	0,45%	0,74%	60,89%	2,62%
Março	74.857.607,11	8.446.072,79	9.581.353,87	74.339.187,50	616.861,47	0,82%	0,58%	142,77%	1,69%
Abril	74.339.187,50	1.203.821,13	2.363.417,02	73.495.581,69	315.990,08	0,43%	0,71%	60,05%	1,68%
Mai	73.495.581,69	5.206.006,73	4.318.893,09	72.380.507,67	-2.002.187,66	-2,69%	0,89%	-302,88%	2,86%
Junho	72.380.507,67	3.803.919,33	3.198.156,10	72.610.861,35	-375.409,55	-0,51%	1,75%	-29,34%	3,30%
Julho	72.610.861,35	6.328.377,86	7.176.047,28	73.294.159,80	1.530.967,87	2,11%	0,84%	250,51%	1,82%
Agosto	73.294.159,80	7.606.206,99	7.360.650,48	73.054.238,59	-485.477,72	-0,66%	0,44%	-149,10%	2,99%
Setembro	73.054.238,59	2.991.304,10	2.572.414,83	74.042.319,24	569.191,38	0,77%	0,92%	83,99%	2,31%
Outubro	74.042.319,24	3.819.514,04	3.356.625,88	77.200.955,91	2.695.748,51	3,62%	0,96%	376,00%	3,66%
Novembro	77.200.955,91	2.541.903,36	2.650.131,46	77.936.729,70	844.001,89	1,09%	0,25%	432,89%	2,39%
Acumulado no ano					5.774.898,21	7,86%	9,25%	84,98%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.040.109,80	0,00	0,00	8.119.973,51	79.863,71	0,99%	1,21%	0,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	975.534,68	0,00	0,00	984.510,69	8.976,01	0,92%	2,08%	0,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	652.920,54	0,00	0,00	658.851,31	5.930,77	0,91%	2,12%	0,91%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	207.447,81	0,00	0,00	209.310,03	1.862,22	0,90%	2,11%	0,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.549.758,12	0,00	0,00	2.568.809,03	19.050,91	0,75%	1,16%	0,75%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.346.712,00	0,00	0,00	1.354.742,00	8.030,00	0,60%	0,13%	0,60%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	157.312,26	0,00	0,00	158.145,96	833,70	0,53%	0,07%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	96.355,18	0,00	0,00	96.856,71	501,53	0,52%	0,07%	0,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.095.171,24	4.184,80	1.238,48	3.113.239,61	15.122,05	0,49%	0,00%	0,49%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.439.100,38	0,00	0,00	4.460.650,29	21.549,91	0,49%	0,01%	0,49%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.141.231,11	0,00	0,00	1.146.768,80	5.537,69	0,49%	0,00%	0,49%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.117.587,12	0,00	0,00	2.127.841,43	10.254,31	0,48%	0,01%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.482.412,15	1.586.722,65	2.115.892,98	8.996.934,64	43.692,82	0,39%	0,07%	0,53%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.741.189,39	200.000,00	200.000,00	8.773.905,18	32.715,79	0,37%	0,98%	0,37%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.063.265,75	0,00	0,00	1.066.789,14	3.523,39	0,33%	0,80%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	750.563,11	0,00	0,00	752.795,09	2.231,98	0,30%	1,26%	0,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.427.761,08	0,00	0,00	1.431.570,82	3.809,74	0,27%	1,15%	0,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.994.394,06	0,00	0,00	7.003.819,87	9.425,81	0,13%	0,93%	0,13%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.155.395,28	0,00	0,00	1.156.763,35	1.368,07	0,12%	1,91%	0,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.027,76	0,00	0,00	73.107,05	79,29	0,11%	0,69%	0,11%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.130.163,74	0,00	0,00	1.131.342,94	1.179,20	0,10%	0,61%	0,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.048.681,18	750.995,91	0,00	3.802.454,64	2.777,55	0,07%	0,69%	0,13%
Total Renda Fixa					278.316,45	0,47%	0,70%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2018

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	811.650,98	0,00	0,00	861.742,55	50.091,57	6,17%	8,67%	6,17%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.138.255,65	0,00	0,00	3.298.425,58	160.169,93	5,10%	9,76%	5,02%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	591.598,28	0,00	0,00	620.987,48	29.389,20	4,97%	9,91%	4,97%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.450.214,42	0,00	0,00	2.531.186,76	80.972,34	3,30%	9,29%	3,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.191.129,52	0,00	0,00	1.225.609,20	34.479,68	2,89%	8,86%	2,89%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.668.001,48	0,00	0,00	2.744.097,41	76.095,93	2,85%	9,61%	2,85%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.833.474,76	0,00	330.000,00	1.555.393,90	51.919,14	2,83%	9,99%	2,78%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.448.360,70	0,00	0,00	1.482.081,46	33.720,76	2,33%	10,21%	2,33%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	262.778,05	0,00	3.000,00	263.363,08	3.585,03	1,36%	-	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	1.046.992,30	0,00	0,00	1.055.399,53	8.407,23	0,80%	0,83%	0,80%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	510.689,84	0,00	0,00	513.868,35	3.178,51	0,62%	0,72%	0,62%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.125.655,24	0,00	0,00	2.138.468,06	12.812,82	0,60%	0,42%	0,60%
Total Renda Variável					544.822,14	3,01%	7,73%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2018

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	436.060,95	0,00	0,00	456.924,25	20.863,30	4,78%	9,08%	4,78%
Total Exterior					20.863,30	4,78%	9,08%	