

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA **97,51%**

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	7,81	-6,28	29,56	10.134.170,85	4,25
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		7,81	-6,28	26,93	10.134.170,85	4,25

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	2,12	-0,47	11,12	27.417.148,51	11,49	5.340.318.585,55	0,51
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	1,92	-0,30	11,51	18.993.301,03	7,96	1.720.615.299,90	1,10
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,70	-2,47	20,18	11.073.518,01	4,64	428.553.667,84	2,58
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,14	6,07	315.000,00	0,13	7.434.585.418,43	0,00
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,72	-2,48	20,27	37.603.697,43	15,76	6.381.244.003,26	0,59
BRADERSCO	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	4,71	-2,48	20,15	40.904.089,54	17,14	791.488.480,46	5,17
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,72	-2,54	20,20	47.161.027,35	19,76	6.860.700.810,84	0,69
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,93	-0,34	11,51	27.076.155,41	11,34	9.996.525.968,83	0,27
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,01	-4,10	26,61	12.055.224,63	5,05	2.996.336.299,76	0,40
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,66	-1,89	16,31	222.599.161,91	93,27		
Renda Fixa			3,84	-2,09	16,33	232.733.332,76	97,51		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

2,49%

Artigo 8º I, Alinea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	17,77	0,99	5,05	5.937.765,37	2,49	636.603.614,74	0,93
Sub-total Artigo 8º I, Alinea a			17,77	0,99	5,05	5.937.765,37	2,49		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			14,21	0,99	5,05	5.937.765,37	2,49		
Total						238.671.098,13	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	10.134.170,85	4,25	0,00	10,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	222.599.161,91	93,27	0,00	90,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	232.733.332,76	97,51				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	5.937.765,37	2,49				30,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	5.937.765,37	2,49				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

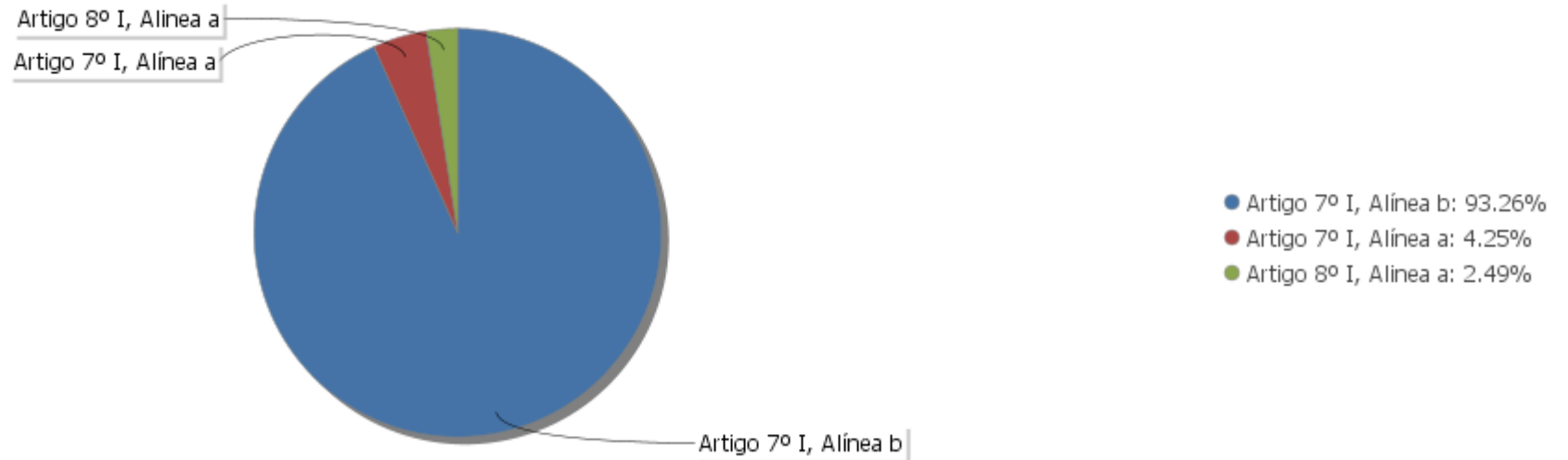
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-6,28 -1.650,88	26,93 483,91	1,93 145,05	8,41 290,25		-679.033,46	2.174.848,69
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,89 -497,12	16,31 293,10	3,38 254,38	7,34 253,34		-4.306.944,66	31.167.450,07
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	0,99 0,05	5,05 0,42				37.774,17	180.765,37
						-4.948.203,95	33.523.064,13

Análise de Liquidez

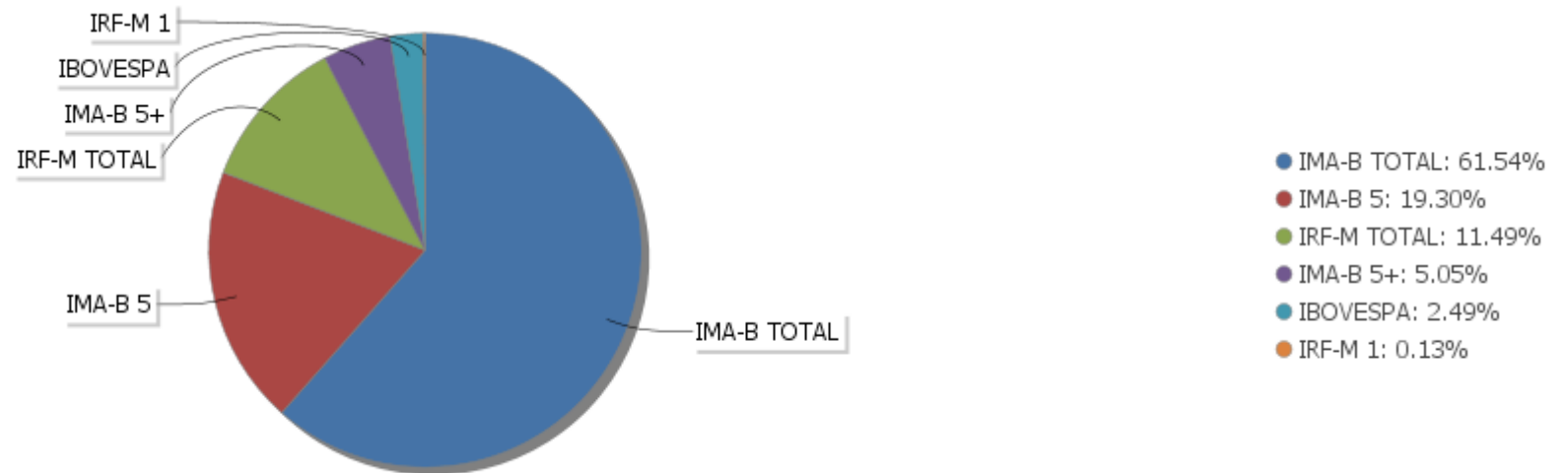
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	228.536.927,28	95,75	228.536.927,28	95,75
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	228.536.927,28	95,75
acima de 365 dias	10.134.170,85	4,25	238.671.098,13	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

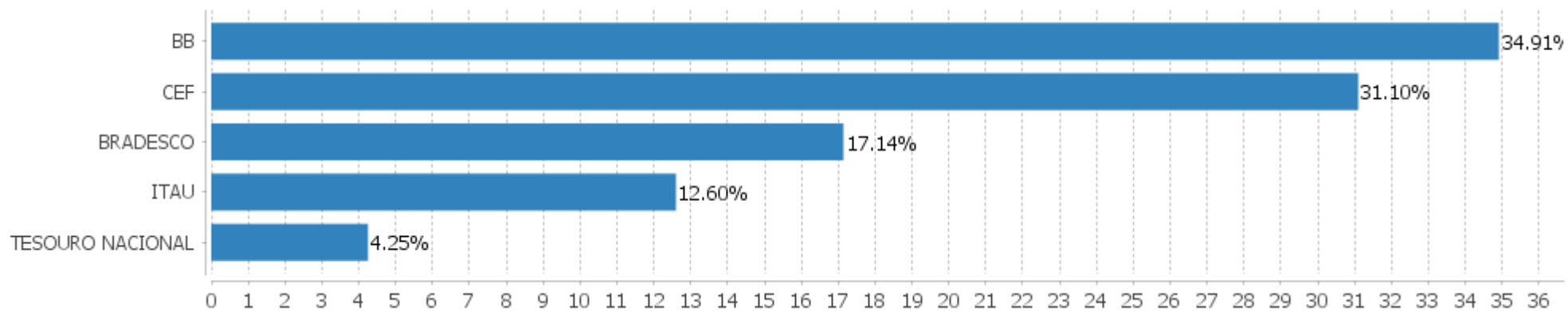


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS
Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

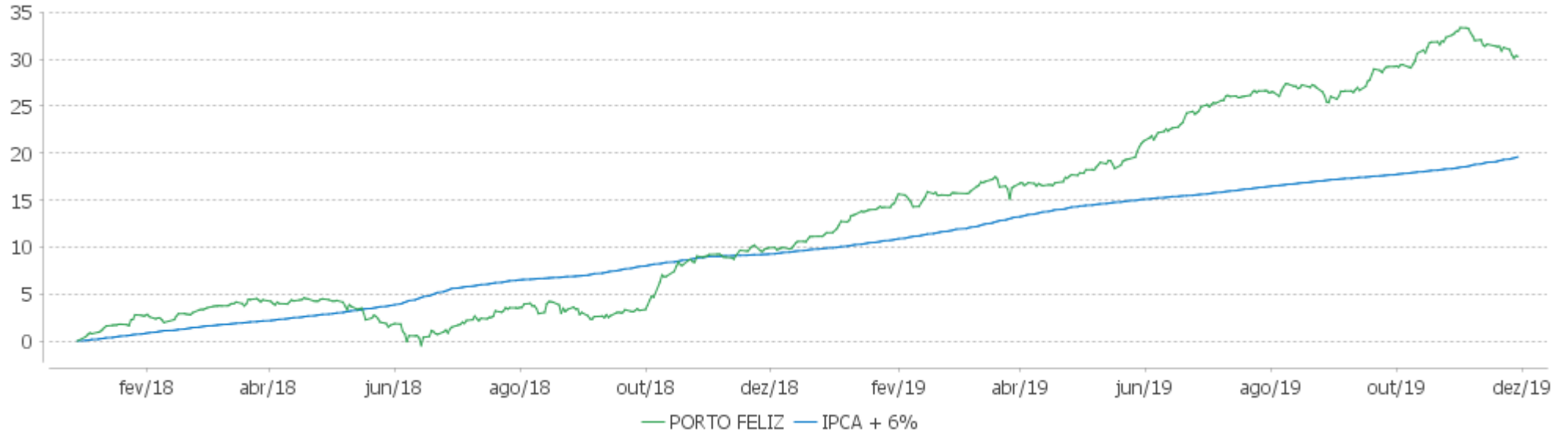
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2019	3,29	0,47	0,58	1,25	2,87	3,03	1,18	-0,30	2,52	2,94	-2,03		16,83
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98		8,80
p.p. indexador	2,46	-0,43	-0,62	0,19	2,23	2,58	0,46	-0,92	2,07	2,30	-3,01		8,02
2018	2,70	0,63	1,00	0,02	-2,62	-0,18	1,98	-0,44	0,21	5,62	0,80	1,47	11,54
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,90	-0,11	0,42	-0,69	-3,50	-1,93	1,14	-0,88	-0,71	4,66	0,55	0,86	1,62

PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL
RELATÓRIO TRIMESTRAL

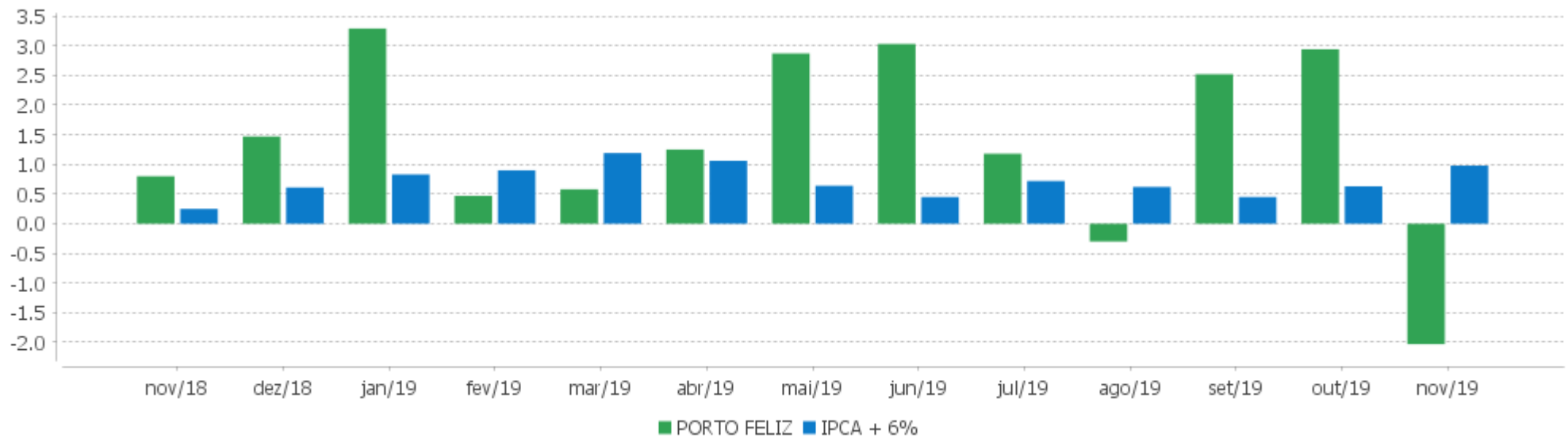
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	13	56,52	03 meses	3,39	2,07	1,32	3,85
Meses abaixo da Meta Atuarial	10	43,48	06 meses	7,46	3,91	3,55	3,75
			12 meses	18,55	9,47	9,08	3,74
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-2,62	2018-05	Desde 29/12/2017	30,31	19,60	10,72	4,17

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,47 -0,01	20,18 -0,35	3,65 -0,06	8,39 -0,14	22,12 -0,40	36,22 -1,18	56,11 -2,06
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,54 -0,09	20,20 -0,34	3,57 -0,14	8,30 -0,23	22,16 -0,37	36,72 -0,68	57,04 -1,14
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-0,34 -0,05	11,51 -0,26	3,04 -0,09	5,82 -0,15	13,05 -0,25	23,35 -0,53	39,33 -0,85
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	-0,30 -0,01	11,51 -0,26	3,08 -0,05	5,87 -0,10	13,00 -0,30	23,05 -0,84	38,68 -1,49
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,31 -0,02	6,07 -0,24	1,53 -0,08	3,36 -0,13	6,64 -0,27	13,87 -0,50	27,00 -0,88
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,48 -0,03	20,27 -0,27	3,66 -0,05	8,43 -0,10	22,21 -0,31	36,71 -0,69	57,00 -1,17
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,47 -0,01	11,12 -0,22	2,64 -0,05	6,21 -0,11	12,80 -0,25	24,32 -0,50	43,68 -0,96
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,48 -0,02	20,15 -0,38	3,63 -0,08	8,35 -0,18	22,11 -0,42	36,46 -0,94	56,29 -1,89
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-4,10 -0,03	26,61 -0,45	4,09 -0,06	10,09 -0,12	28,94 -0,51	46,86 -0,93	69,57 -1,90
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-4,33 -1,88	29,56 9,03	4,04 0,33	10,66 2,12	32,20 9,68	48,67 11,27	74,55 16,37
BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO Var. IBOVESPA p.p.	0,99 0,05	24,49 1,34	6,97 -0,05	12,80 1,25	23,42 2,49	49,69 -0,69	79,63 4,80
CDI	0,38	5,56	1,33	2,90	6,09	12,95	24,88
IBOVESPA	0,95	23,15	7,02	11,55	20,93	50,38	74,83
INPC + 6%	1,01	8,91	2,03	3,79	9,57	20,22	29,88
IPCA + 6%	0,98	8,80	2,07	3,91	9,47	20,68	31,48

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,33	6,31	1,61	3,49	6,91	14,37	27,89
IRF-M 1+	-0,83	13,42	3,27	7,53	15,61	29,19	51,70
IRF-M TOTAL	-0,46	11,34	2,69	6,32	13,05	24,82	44,64
IMA-B 5	-0,28	11,77	3,13	5,97	13,30	23,89	40,17
IMA-B 5+	-4,07	27,06	4,15	10,21	29,45	47,79	71,47
IMA-B TOTAL	-2,45	20,53	3,71	8,53	22,52	37,40	58,18
IMA-C TOTAL	-1,15	18,93	3,20	8,96	19,85	41,50	57,00
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-0,70	11,61	2,45	5,61	12,93	23,64	41,02
IMA-GERAL TOTAL	-0,71	11,82	2,47	5,71	13,13	24,13	41,42
IDKA 2	0,01	10,49	2,86	5,28	11,88	22,68	39,55
IDKA 20	-6,02	38,79	4,15	11,72	41,69	68,38	100,86
CDI	0,38	5,56	1,33	2,90	6,09	12,95	24,88
Renda Variável							
IBOVESPA	0,95	23,15	7,02	11,55	20,93	50,38	74,83
IBRX 100	0,97	24,34	6,51	11,98	22,74	52,63	78,38
IBRX 50	0,85	21,20	6,85	10,57	18,64	47,41	71,10
SMALL CAP	5,14	40,43	9,78	25,98	43,38	62,52	125,57
IFIX	3,52	22,91	8,79	13,22	25,64	30,60	57,32
Índice Consumo - ICON	2,99	43,71	3,63	23,17	43,50	38,80	70,19
Índice Dividendos - IDIV	2,35	31,98	5,87	14,68	32,84	60,60	90,05
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,51	3,12	0,57	0,88	3,27	7,45	10,47
INPC	0,54	3,22	0,53	0,76	3,37	7,04	9,13
IGPM	0,30	5,12	0,97	1,50	3,99	14,07	13,06
SELIC	0,38	5,56	1,33	2,89	6,08	12,95	24,90
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,82	6,91	1,58	2,91	7,41	16,19	24,20

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	0,90	7,86	1,82	3,41	8,44	18,42	27,80
IPCA + 5,5%	0,94	8,33	1,95	3,66	8,95	19,55	29,63
IPCA + 5,89%	0,97	8,70	2,04	3,86	9,36	20,43	31,07
IPCA + 6%	0,98	8,80	2,07	3,91	9,47	20,68	31,48
INPC + 4%	0,85	7,02	1,54	2,79	7,50	15,74	22,69
INPC + 6%	1,01	8,91	2,03	3,79	9,57	20,22	29,88

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

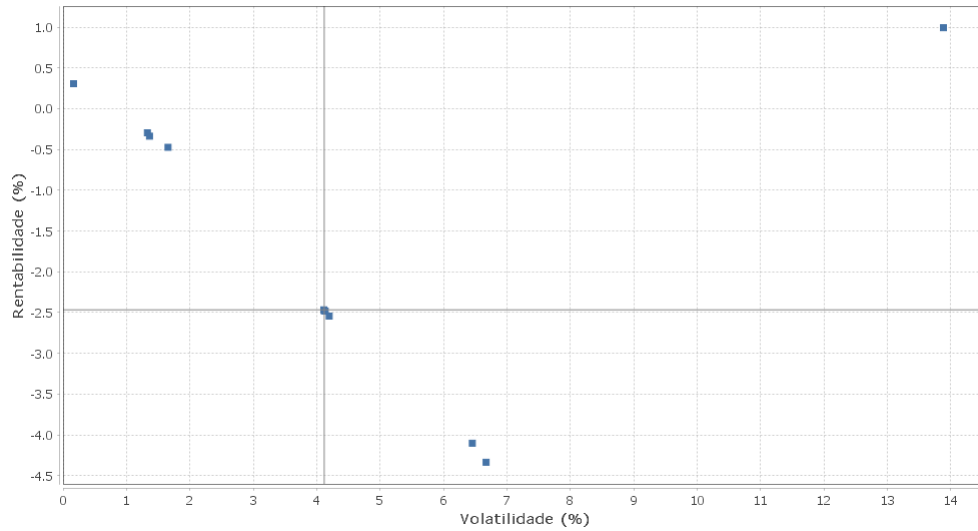
Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
08/11/2019	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	235.219,56	89.854,55173600	2,6177812300
11/11/2019	BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	2.020.000,00	0,00	706.061,50833800	2,8609405500
21/11/2019	BB PREVID RF IRF-M1	330.000,00	0,00	125.929,33329300	2,6205173280
26/11/2019	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	330.157,69	125.929,33329300	2,6217695230
27/11/2019	BB PREV RF IRF-M	0,00	970.000,00	169.226,64338300	5,7319579270
29/11/2019	BB PREVID RF IRF-M1	315.000,00	0,00	120.074,83988000	2,6233638980

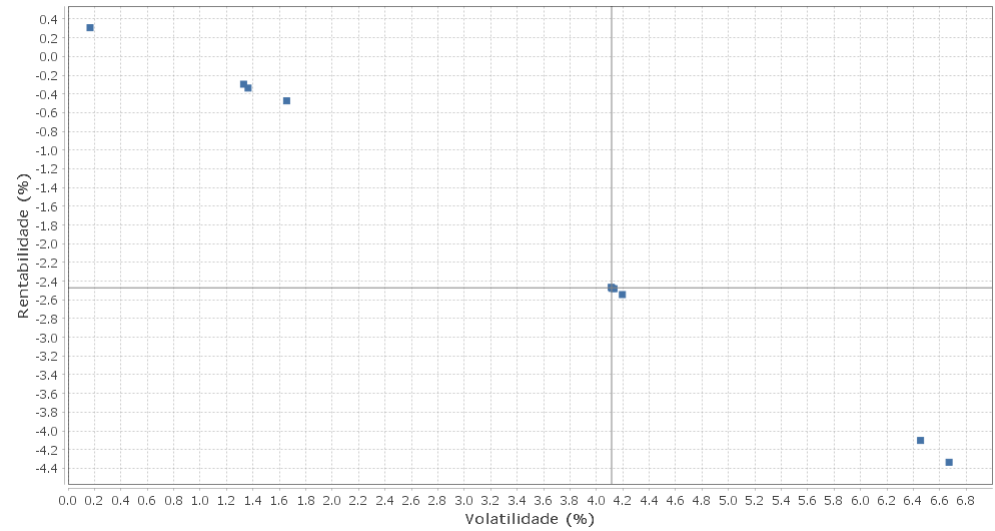
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

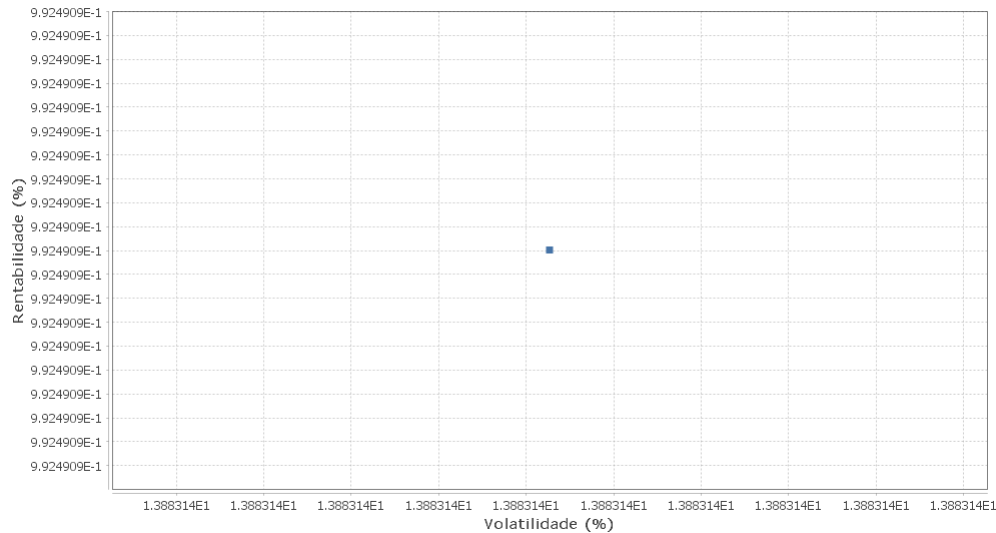
PORTO FELIZ - No Mês



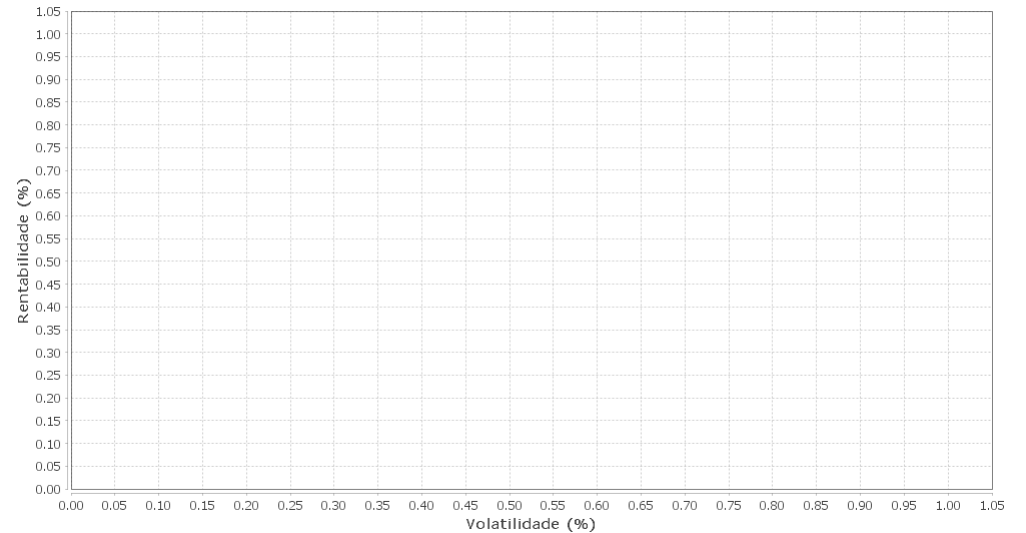
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,17	0,03	0,31	315.000,00	0,13
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,33	0,12	-0,30	18.993.301,03	7,96
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,36	0,12	-0,34	27.076.155,41	11,34
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,66	0,15	-0,47	27.417.148,51	11,49
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	4,11	0,30	-2,47	11.073.518,01	4,64
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	Artigo 7º I, Alínea b	4,12	0,30	-2,48	40.904.089,54	17,14
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	4,13	0,30	-2,48	37.603.697,43	15,76
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	4,20	0,31	-2,54	47.161.027,35	19,76
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	6,45	0,46	-4,10	12.055.224,63	5,05
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	6,67	0,47	-4,33	10.134.170,85	4,25
BB AÇÕES GOVERNANÇA FUNDO DE INVESTIMENTO	Artigo 8º I, Alínea a	13,88	1,49	0,99	5.937.765,37	2,49