



## Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.481.997,58	4,78%	964	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.218.594,50	1,64%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	82.011,44	0,06%	64	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.955.688,00	3,65%	56	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.824.772,47	10,93%	695	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.616.715,08	2,67%	613	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.440.946,65	3,28%	876	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.709.502,34	2,00%	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	5.765.949,62	4,25%	923	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.133.093,35	2,31%	1.361	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.517.087,00	1,12%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.160.424,10	1,59%	681	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.921.869,12	2,89%	104	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.354.822,83	3,95%	949	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	525.105,57	0,39%	114	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.227.672,59	3,12%	115	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.620.885,45	1,20%	688	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.833.525,46	7,25%	28	13,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.114.976,03	6,72%	289	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.236.568,09	2,39%	654	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.065.446,82	1,52%	67	1,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	871.338,00	0,64%	76	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

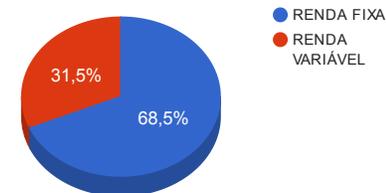
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	3.247.407,77	2,39%	209	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.401.702,93	4,72%	165	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	5.183.860,75	3,82%	59.465	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	D+15	Não há	2.354.227,55	1,74%	7.771	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FIAÇÕES	D+4	Não há	3.873.676,72	2,86%	119	1,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.668.899,27	3,44%	9.213	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.709.352,39	1,26%	927	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.482.703,49	3,31%	26.794	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.514.950,89	2,59%	52	4,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.320.883,60	3,19%	18.924	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRH11	Não se aplica	Não se aplica	2.979.980,00	2,20%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	176.806,91	0,13%	749	0,63%	Desenquadrado - RF
<b>Total</b>			<b>135.593.444,36</b>				

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

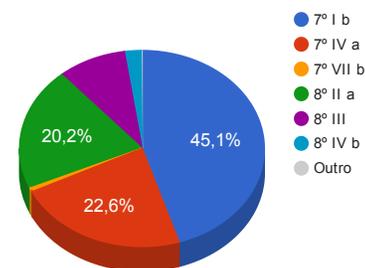
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	61.183.474,08	45,12%	15,00%	25,00%	70,00%	33.731.936,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	81.356.066,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	30.624.180,01	22,59%	10,00%	30,00%	40,00%	23.613.197,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.779.672,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	871.338,00	0,64%	0,00%	0,00%	5,00%	5.908.334,22
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	27.439.127,38	20,24%	7,00%	10,00%	20,00%	-320.438,51
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.318.537,98	9,08%	7,00%	10,00%	10,00%	1.240.806,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.779.672,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.979.980,00	2,20%	2,00%	5,00%	5,00%	3.799.692,22
Desenquadrado - RF	0,00%	176.806,91	0,13%	0,00%	0,00%	0,00%	-176.806,91
<b>Total Carteira</b>		<b>135.593.444,36</b>					

RENDA FIXA	92.855.799,00	68,48%
RENDA VARIÁVEL	42.737.645,36	31,52%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	61.183.474,08	45,12%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30.624.180,01	22,59%	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 "	871.338,00	0,64%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	27.439.127,38	20,24%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	12.318.537,98	9,08%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.979.980,00	2,20%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	176.806,91	0,13%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>135.593.444,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>50,00</b>	<b>240,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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	53.572.107,89	39,51%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	26.263.344,72	19,37%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTV M	17.873.508,65	13,18%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	15.413.923,17	11,37%	2,67%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.396.949,48	8,41%	0,00%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.668.899,27	3,44%	0,01%
META ASSET MANAGEMENT	3.873.676,72	2,86%	1,57%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.354.227,55	1,74%	0,23%
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	176.806,91	0,13%	0,39%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,60%	30,37%	3,02%	7,64%	30,37%	50,45%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,78%	8,66%	1,31%	3,57%	8,66%	19,18%	0,50%	1,153%	2,77%
IMA-B	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,99%	22,59%	2,70%	6,52%	22,59%	38,33%	0,20%	2,796%	6,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,97%	22,64%	2,78%	6,61%	22,64%	38,29%	0,20%	2,774%	6,92%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,49%	11,75%	2,88%	3,64%	11,75%	18,45%	0,20%	1,766%	6,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,19%	12,89%	2,54%	5,34%	12,89%	23,78%	0,20%	1,002%	2,29%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	2,90%	2,39%	1,38%	2,90%	6,35%	0,20%	0,433%	4,13%
IMA-B 5	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,22%	12,87%	2,57%	5,37%	12,87%	23,49%	0,18%	0,998%	2,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,21%	12,85%	2,52%	5,31%	12,85%	23,77%	0,20%	1,015%	2,31%
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	11,20%	2,62%	5,15%	11,20%	21,46%	0,20%	0,751%	1,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	11,19%	2,40%	4,92%	11,19%	21,53%	0,20%	0,738%	1,60%
IPCA	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,47%	16,48%	2,64%	5,99%	16,48%	25,49%	0,20%	1,689%	3,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,59%	16,43%	1,80%	4,97%	16,43%	25,53%	0,002	0,931%	3,98%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

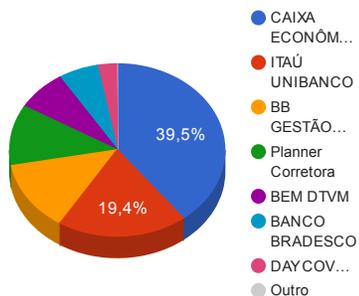
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	11,91%	1,19%	3,28%	11,91%	21,11%	0,40%	0,008%	2,85%
IDKA PRÉ 2 ANOS	0,60%	11,89%	1,86%	4,92%	11,89%	24,90%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,54%	11,60%	1,75%	4,67%	11,60%	24,20%	0,20%	0,986%	2,58%
IRF-M 1	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,55%	1,33%	3,22%	6,55%	13,80%	0,20%	0,067%	0,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	6,49%	1,31%	3,18%	6,49%	13,69%	0,10%	0,069%	0,40%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,40%	6,53%	1,33%	3,23%	6,53%	13,69%	0,18%	0,070%	0,46%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,56%	6,23%	1,10%	2,72%	6,23%	13,93%	0,75%	0,431%	1,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	5,74%	1,14%	2,65%	5,74%	12,44%	0,20%	0,013%	0,23%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,35%	5,72%	1,11%	2,62%	5,72%	12,30%	0,20%	0,012%	0,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,33%	5,76%	1,14%	2,67%	5,76%	12,40%	0,18%	0,072%	0,24%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,01%	22,85%	2,85%	6,66%	22,85%	38,66%	0,20%	2,837%	7,09%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,07%	52,20%	0,26%	75,56%	52,20%	130,90%	2,00%	0,088%	77,90%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	7,27%	33,39%	10,70%	15,40%	33,39%	53,96%	-	-	-
META VALOR FIAÇÕES	12,19%	34,28%	17,84%	22,28%	34,28%	64,14%	2,50%	5,872%	16,08%
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	12,11%	50,88%	18,52%	27,59%	50,88%	85,36%	2,00%	3,700%	15,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10,21%	39,84%	14,53%	21,51%	39,84%	76,22%	2,50%	4,418%	12,54%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,81%	41,43%	13,36%	16,02%	41,43%	-	2,00%	4,042%	16,51%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	1,90%	4,076%	12,62%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,53%	28,60%	9,30%	16,94%	28,60%	62,19%	2,00%	4,443%	10,55%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	7,19%	27,57%	9,30%	14,65%	27,57%	60,83%	1,50%	5,094%	9,13%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,22%	13,70%	4,58%	6,93%	13,70%	22,92%	1,00%	1,530%	3,39%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,09%	18,08%	3,77%	7,38%	18,08%	29,14%	0,50%	1,100%	3,47%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,85%	6,59%	1,45%	2,96%	6,59%	13,87%	1,00%	0,613%	0,89%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	9,96%	47,62%	34,23%	44,38%	47,62%	39,25%	1,20%	13,663%	16,78%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.572.107,89	39,51%
ITAÚ UNIBANCO	26.263.344,72	19,37%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.873.508,65	13,18%
Planner Corretora	15.413.923,17	11,37%
BEM DTVM	10.270.534,59	7,57%
BANCO BRADESCO	8.149.541,71	6,01%
DAY COVAL ASSET MANAGEMENT	3.873.676,72	2,86%
Orla DTVM	176.806,91	0,13%



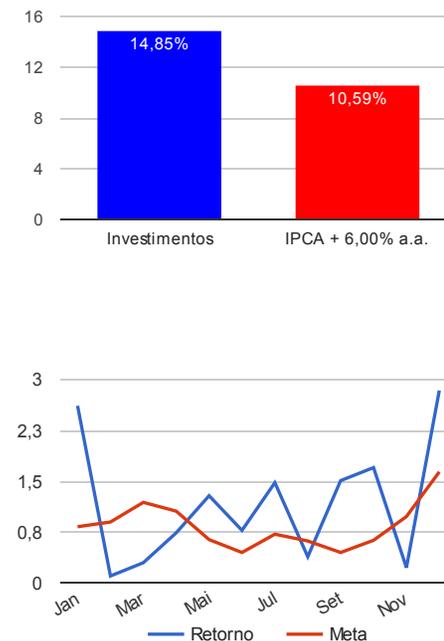
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	33.773.273,96	24,91%
AÇÕES - LIVRES	27.439.127,38	20,24%
IMA-B 5	16.556.947,20	12,21%
IDKA IPCA 2A	14.844.813,35	10,95%
IMA-B	13.260.006,52	9,78%
MULTIMERCADO	12.318.537,98	9,08%
CDI	7.448.005,93	5,49%
IRF-M 1	5.924.607,13	4,37%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.979.980,00	2,20%
CRÉDITO PRIVADO	1.048.144,91	0,77%



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%
Dezembro	125.273.778,83	4.910.800,63	1.042.000,00	132.811.185,40	3.668.605,94	2,84%	1,64%	172,97%	2,00%
Acumulado no ano					16.657.351,57	14,85%	10,59%	140,24%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.144.367,43	0,00	0,00	4.227.672,59	83.305,16	2,01%	2,84%	2,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.118.591,13	0,00	0,00	2.160.424,10	41.832,97	1,97%	2,77%	1,97%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.964.729,35	289.863,28	0,00	5.354.822,83	100.230,20	1,91%	2,80%	1,99%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.494.849,00	0,00	0,00	1.517.087,00	22.238,00	1,49%	1,77%	1,49%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	858.750,50	0,00	0,00	871.338,00	12.587,50	1,47%	1,69%	1,47%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.574.029,76	0,00	0,00	3.616.715,08	42.685,32	1,19%	1,00%	1,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.191.385,10	507.750,54	0,00	5.765.949,62	66.813,98	1,17%	1,01%	1,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.347.023,15	43.573,82	0,00	4.440.946,65	50.349,68	1,15%	0,75%	1,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	5.888.659,47	0,00	1.000.000,00	4.955.688,00	67.028,53	1,14%	1,00%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.411.497,23	0,00	0,00	6.481.997,58	70.500,35	1,10%	0,74%	1,10%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	9.756.955,87	0,00	0,00	9.833.525,46	76.569,59	0,78%	1,15%	0,78%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.201.475,00	0,00	0,00	2.218.594,50	17.119,50	0,78%	0,43%	0,78%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.151.429,35	587.518,09	0,00	14.824.772,47	85.825,03	0,58%	0,93%	0,59%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.053.989,93	0,00	0,00	2.065.446,82	11.456,89	0,56%	0,43%	0,56%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.900.940,59	0,00	0,00	3.921.869,12	20.928,53	0,54%	0,99%	0,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.120.535,93	0,00	0,00	3.133.093,35	12.557,42	0,40%	0,07%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.698.777,59	0,00	0,00	2.709.502,34	10.724,75	0,40%	0,07%	0,40%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	81.687,96	0,00	0,00	82.011,44	323,48	0,40%	0,07%	0,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.225.155,38	0,00	0,00	3.236.568,09	11.412,71	0,35%	0,01%	0,35%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.615.202,26	0,00	0,00	1.620.885,45	5.683,19	0,35%	0,01%	0,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.558.741,98	526.804,57	0,00	9.114.976,03	29.429,48	0,32%	0,01%	0,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	401.009,79	279.795,39	157.035,93	525.105,57	1.336,32	0,20%	0,07%	0,33%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	176.683,22	0,00	0,00	176.806,91	123,69	0,07%	0,09%	0,07%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>841.062,27</b>	<b>0,91%</b>	<b>0,98%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
META VALOR FIAÇÕES	3.452.895,97	0,00	0,00	3.873.676,72	420.780,75	12,19%	5,87%	12,19%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.710.000,00	0,00	42.000,00	2.979.980,00	311.980,00	11,51%	13,66%	9,96%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.119.797,90	1.000.000,00	0,00	2.354.227,55	234.429,65	11,06%	3,70%	12,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.808.803,40	0,00	0,00	6.401.702,93	592.899,53	10,21%	4,42%	10,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.570.972,90	0,00	0,00	1.709.352,39	138.379,49	8,81%	4,04%	8,81%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.123.476,98	675.494,94	0,00	5.183.860,75	384.888,83	8,02%	4,08%	8,13%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.347.876,57	1.000.000,00	0,00	4.668.899,27	321.022,70	7,38%	4,44%	7,53%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	3.029.469,49	0,00	0,00	3.247.407,77	217.938,28	7,19%	5,09%	7,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.227.003,37	0,00	0,00	4.320.883,60	93.880,23	2,22%	1,53%	2,22%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.390.968,31	0,00	0,00	4.482.703,49	91.735,18	2,09%	1,10%	2,09%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.485.373,97	0,00	0,00	3.514.950,89	29.576,92	0,85%	0,61%	0,85%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>2.837.511,56</b>	<b>7,11%</b>	<b>4,20%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	13.240.406,94	1.340.223,62	0,00	14.824.772,47	244.141,91	1,79%	1,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.204.212,68	126.284,15	0,00	6.481.997,58	151.500,75	2,39%	2,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	5.358.012,95	460.655,59	1.000.000,00	4.955.688,00	137.019,46	2,35%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.975.985,53	657.750,54	0,00	5.765.949,62	132.213,55	2,46%	2,52%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	9.706.491,87	0,00	0,00	9.833.525,46	127.033,59	1,31%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.340.693,05	896.058,00	0,00	5.354.822,83	118.071,78	2,28%	2,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.110.389,47	0,00	0,00	4.227.672,59	117.283,12	2,85%	2,85%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.284.915,99	43.573,82	0,00	4.440.946,65	112.456,84	2,61%	2,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.486.871,66	526.804,57	0,00	9.114.976,03	101.299,80	1,17%	1,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.527.229,28	0,00	0,00	3.616.715,08	89.485,80	2,54%	2,54%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	4.498.946,47	0,00	651.000,00	3.921.869,12	73.922,65	1,72%	1,75%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.068.651,51	33.802,16	0,00	2.160.424,10	57.970,43	2,78%	2,78%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.166.754,50	0,00	0,00	2.218.594,50	51.840,00	2,39%	2,39%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.474.590,00	0,00	0,00	1.517.087,00	42.497,00	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.091.994,07	0,00	0,00	3.133.093,35	41.099,28	1,33%	1,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.200.161,07	0,00	0,00	3.236.568,09	36.407,02	1,14%	1,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.674.508,03	0,00	0,00	2.709.502,34	34.994,31	1,31%	1,31%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	848.918,50	0,00	0,00	871.338,00	22.419,50	2,64%	2,64%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.043.055,55	0,00	0,00	2.065.446,82	22.391,27	1,10%	1,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.603.033,69	0,00	0,00	1.620.885,45	17.851,76	1,11%	1,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1.137.278,11	286.119,96	905.546,86	525.105,57	7.254,36	0,89%	1,14%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	100.397,36	81.445,49	100.879,73	82.011,44	1.048,32	0,95%	1,33%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	176.347,45	0,00	0,00	176.806,91	459,46	0,26%	0,26%
				Total Renda Fixa	1.740.661,96	1,92%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.220.040,00	0,00	74.000,00	2.979.980,00	833.940,00	37,84%	34,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.589.441,85	0,00	0,00	6.401.702,93	812.261,08	14,53%	14,53%
META VALOR FIC AÇÕES	3.287.171,51	0,00	0,00	3.873.676,72	586.505,21	17,84%	17,84%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.952.390,23	675.494,94	0,00	5.183.860,75	555.975,58	12,70%	12,81%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.293.873,66	1.000.000,00	0,00	4.668.899,27	375.025,61	9,14%	9,30%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	4.932.374,58	0,00	2.000.000,00	3.247.407,77	315.033,19	9,30%	9,30%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	1.059.291,57	1.000.000,00	0,00	2.354.227,55	294.935,98	17,40%	18,52%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.507.924,27	0,00	0,00	1.709.352,39	201.428,12	13,36%	13,36%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.131.783,46	0,00	0,00	4.320.883,60	189.100,14	4,58%	4,58%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.320.034,09	0,00	0,00	4.482.703,49	162.669,40	3,77%	3,77%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.464.586,52	0,00	0,00	3.514.950,89	50.364,37	1,45%	1,45%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>4.377.238,68</b>	<b>11,48%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	9.469.942,30	4.333.570,33	689.699,23	14.824.772,47	1.710.959,07	16,06%	16,43%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	9.049.511,69	0,00	0,00	9.833.525,46	784.013,77	8,66%	8,66%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.819.323,87	0,00	4.651.000,00	3.921.869,12	753.545,25	11,46%	11,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.602.796,14	2.615.169,19	4.195.834,55	5.765.949,62	743.818,84	12,19%	12,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.987.761,08	1.467.588,47	1.580.939,30	6.481.997,58	607.587,33	10,91%	11,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	4.149.558,40	1.223.297,50	1.000.000,00	4.955.688,00	582.832,10	12,48%	12,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	10.312.547,89	1.770.000,00	9.114.976,03	572.428,14	6,79%	11,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.267.366,95	793.872,91	2.000.000,00	3.616.715,08	555.475,22	12,92%	12,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.639.456,17	384.505,11	16.867,95	4.440.946,65	433.853,32	11,12%	11,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	8.442.225,03	852.000,00	9.692.782,78	0,00	398.557,75	4,40%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.346.424,25	1.221.775,39	4.744.734,52	3.133.093,35	309.628,23	6,32%	6,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.396.589,72	5.209,51	1.923.204,72	2.709.502,34	230.907,83	6,35%	6,49%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.357.630,00	0,00	71.260,83	1.517.087,00	230.717,83	17,51%	11,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	5.124.149,97	0,00	5.354.822,83	230.672,86	5,00%	22,59%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	4.001.740,00	0,00	4.227.672,59	225.932,59	5,65%	22,85%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.156.023,50	0,00	116.725,38	2.218.594,50	179.296,38	8,59%	2,90%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	748.032,00	0,00	0,00	871.338,00	123.306,00	16,48%	16,48%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1.944.361,76	0,00	0,00	2.065.446,82	121.085,06	6,23%	6,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.048.552,67	0,00	2.160.424,10	111.871,43	5,53%	22,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	572.341,44	2.935.027,59	362.425,17	3.236.568,09	91.624,23	5,24%	5,74%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.516.983,01	2.378.212,15	2.344.479,46	1.620.885,45	70.169,75	4,94%	5,72%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	116.167,98	0,00	0,00	176.806,91	60.638,93	52,20%	52,20%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	245.974,60	5.318.278,63	5.093.418,60	525.105,57	54.270,94	4,29%	5,76%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	161.673,43	151.445,49	238.879,73	82.011,44	7.772,25	5,80%	6,53%
Total Renda Fixa					9.190.965,10	11,34%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4.974.062,15	0,00	500.000,00	6.401.702,93	1.927.640,78	40,16%	39,84%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.018.720,00	0,00	206.000,00	2.979.980,00	1.167.260,00	61,40%	47,62%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	4.087.388,05	0,00	5.183.860,75	1.096.472,70	33,82%	45,27%
META VALOR FIAÇÕES	2.884.729,88	0,00	0,00	3.873.676,72	988.946,84	34,28%	34,28%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.799.396,54	1.000.000,00	0,00	4.668.899,27	869.502,73	28,42%	28,60%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	0,00	4.421.868,90	2.000.000,00	3.247.407,77	825.538,87	20,81%	27,57%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	832.053,58	1.000.000,00	0,00	2.354.227,55	522.173,97	49,47%	50,88%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	4.128.694,93	0,00	4.482.703,49	354.008,56	8,57%	18,08%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	1.377.777,67	0,00	1.709.352,39	331.574,72	24,84%	41,43%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	4.000.000,00	0,00	4.320.883,60	320.883,60	8,02%	13,70%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.297.518,04	0,00	0,00	3.514.950,89	217.432,85	6,59%	6,59%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.459.029,92	0,00	2.568.000,80	0,00	108.970,88	4,43%	23,60%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	3.022.318,04	1.000.000,00	4.130.070,84	0,00	107.752,80	3,01%	6,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.191.128,96	1.000.000,00	4.297.622,81	0,00	106.493,85	3,13%	7,00%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.256.306,89	0,00	1.324.264,13	0,00	67.957,24	5,41%	28,47%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES	632.418,46	0,00	690.818,55	0,00	58.400,09	9,23%	33,90%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>9.071.010,48</b>	<b>28,12%</b>	