

# Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano 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 (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 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	8.075.023,23	3,75%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	38.511.116,49	17,89%	695	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.538.961,14	3,97%	1.198	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.037.494,67	6,05%	580	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.447.694,34	3,92%	876	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.144.821,08	3,78%	949	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.710.505,77	2,65%	613	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	397.375,14	0,18%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.165.163,30	1,01%	443	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	4.357.790,85	2,02%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.893.996,76	7,38%	923	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.976.596,95	6,49%	964	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.622.220,68	1,22%	708	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	24.268.998,63	11,27%	66	2,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.808.623,60	0,84%	726	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	257.215,87	0,12%	300	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.237.965,45	2,43%	167	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.868.603,60	0,87%	289	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.440.096,11	1,60%	90	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.500.810,97	1,63%	927	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	8.049.448,35	3,74%	209	0,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	15.436.606,61	7,17%	12.392	1,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

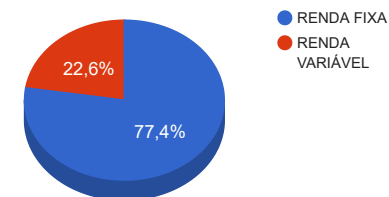
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	5.481.052,54	2,55%	59.465	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.153.567,81	0,54%	41	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.341.977,80	2,02%	6.606	0,54%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.388.474,97	3,90%	26.794	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	Não se aplica	Não se aplica	2.211.427,65	1,03%		0,98%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total</b>			<b>215.323.630,36</b>				

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

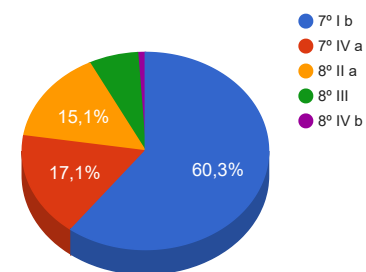
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	129.878.760,40	60,32%	15,00%	40,00%	90,00%	63.912.506,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	129.194.178,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	36.881.503,26	17,13%	5,00%	29,00%	40,00%	49.247.948,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	10.766.181,52
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	43.064.726,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	32.467.918,47	15,08%	0,00%	10,00%	20,00%	10.596.807,60
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.884.020,58	6,45%	0,00%	5,00%	10,00%	7.648.342,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	10.766.181,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.211.427,65	1,03%	0,00%	2,50%	5,00%	8.554.753,87
<b>Total Carteira</b>		<b>215.323.630,36</b>					

RENDA FIXA	166.760.263,66	77,45%
RENDA VARIÁVEL	48.563.366,70	22,55%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	129.878.760,40	60,32%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	36.881.503,26	17,13%	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 "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	32.467.918,47	15,08%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	13.884.020,58	6,45%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.211.427,65	1,03%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>215.323.630,36</b>	<b>100,00%</b>	<b>20,00</b>	<b>285,00</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	134.860.798,02	62,63%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.421.477,16	22,49%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	13.544.629,67	6,29%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	7.349.656,14	3,41%	0,00%
WESTERN ASSET	4.341.977,80	2,02%	0,01%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	3.440.096,11	1,60%	0,00%
ZION Invest	2.211.427,65	1,03%	16,35%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.153.567,81	0,54%	0,00%

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	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%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,49%	11,75%	2,89%	3,65%	11,75%	18,46%	0,20%	1,766%	6,37%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	10,46%	2,42%	4,56%	10,46%	21,28%	0,20%	0,515%	1,14%

IMA-B 5	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-	-
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%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	14,15%	2,45%	5,43%	14,15%	26,26%	0,15%	1,012%	2,59%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,85%	12,43%	1,81%	4,38%	12,43%	23,11%	0,40%	1,092%	3,13%
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,40%	13,69%	2,35%	4,81%	13,69%	19,20%	0,40%	0,110%	2,86%
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%

IMA Geral ex-C	0,91%	12,63%	1,90%	4,54%	12,63%	23,66%	-	-	-
----------------	-------	--------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	13,07%	1,81%	4,48%	13,07%	24,27%	0,30%	1,209%	3,22%
IRF-M	0,62%	12,03%	1,86%	4,72%	12,03%	24,05%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,61%	11,68%	1,81%	4,59%	11,68%	23,64%	0,20%	0,932%	2,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	11,79%	1,81%	4,61%	11,79%	23,56%	0,20%	0,932%	2,64%
IRF-M 1	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-	-
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%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,37%	5,87%	1,14%	2,70%	5,87%	12,49%	0,20%	0,053%	0,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	4,82%	0,97%	2,23%	4,82%	10,36%	1,00%	0,009%	0,20%
Selic	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,77%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,37%	5,83%	1,16%	2,70%	5,83%	12,53%	0,20%	0,012%	0,23%

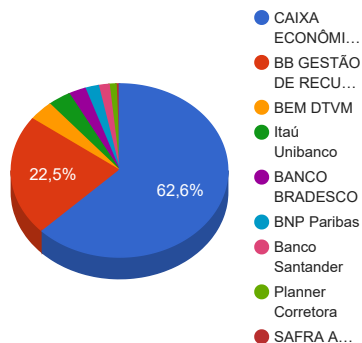


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

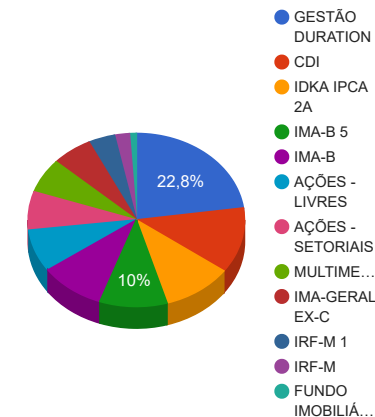
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	12,65%	58,20%	21,15%	32,65%	58,20%	71,06%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,55%	54,75%	20,34%	31,86%	54,75%	62,50%	1,50%	5,088%	15,32%
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
BB AÇÕES VALOR 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%
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	7,19%	27,57%	9,30%	14,65%	27,57%	60,83%	1,50%	5,094%	9,13%
S&P 500	2,86%	28,88%	8,53%	9,82%	28,88%	20,84%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2,63%	31,99%	8,77%	11,11%	31,99%	28,57%	1,00%	3,417%	12,73%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,62%	32,29%	8,83%	11,25%	32,29%	29,08%	1,00%	3,468%	12,85%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,09%	18,08%	3,77%	7,38%	18,08%	29,14%	0,50%	1,100%	3,47%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	22,86%	-25,00%	-15,69%	-27,93%	-25,00%	-41,36%	1,60%	37,237%	45,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	134.860.798,02	62,63%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.421.477,16	22,49%
BEM DTVM	8.049.448,35	3,74%
Itaú Unibanco	7.349.656,14	3,41%
BANCO BRADESCO	5.495.181,32	2,55%
BNP Paribas	4.341.977,80	2,02%
Banco Santander	3.440.096,11	1,60%
Planner Corretora	2.211.427,65	1,03%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.153.567,81	0,54%

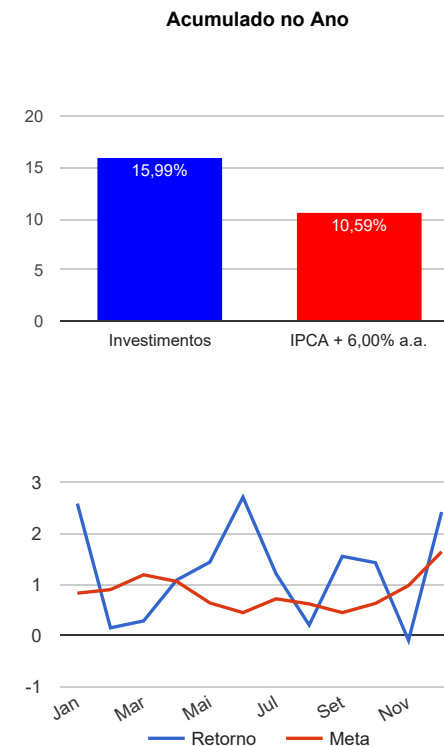


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	49.057.781,65	22,78%
CDI	26.334.838,10	12,23%
IDKA IPCA 2A	22.424.291,29	10,41%
IMA-B 5	21.604.502,53	10,03%
IMA-B	20.975.010,30	9,74%
AÇÕES - LIVRES	17.031.311,86	7,91%
AÇÕES - SETORIAIS	15.436.606,61	7,17%
MULTIMERCADO	13.884.020,58	6,45%
IMA-GERAL EX-C	13.037.494,67	6,05%
IRF-M 1	8.538.961,14	3,97%
IRF-M	4.787.383,98	2,22%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.211.427,65	1,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	151.624.985,03	22.135.693,01	16.553.674,62	161.265.801,00	4.058.797,58	2,58%	0,83%	310,45%	2,18%
Fevereiro	161.265.801,00	2.448.820,38	2.495.450,27	161.465.315,43	246.144,32	0,15%	0,90%	17,04%	2,36%
Março	161.465.315,43	6.683.054,96	1.147.628,61	167.481.116,75	480.374,97	0,29%	1,19%	24,10%	3,46%
Abril	167.481.116,75	13.955.347,40	13.971.624,50	169.284.762,47	1.819.922,82	1,09%	1,06%	102,56%	1,95%
Mai	169.284.762,47	10.511.294,90	11.574.563,67	170.655.361,35	2.433.867,65	1,44%	0,64%	224,42%	3,43%
Junho	170.655.361,35	10.878.585,27	1.157.622,26	185.262.487,99	4.886.163,63	2,71%	0,45%	601,52%	2,76%
Julho	185.262.487,99	7.538.076,28	4.446.848,72	190.633.447,02	2.279.731,47	1,21%	0,72%	167,12%	1,95%
Agosto	190.633.447,02	9.507.897,60	6.551.745,38	193.991.210,61	401.611,37	0,21%	0,62%	33,43%	3,49%
Setembro	193.991.210,61	3.959.475,65	1.258.195,03	199.743.554,40	3.051.063,17	1,55%	0,45%	347,36%	2,10%
Outubro	199.743.554,40	8.114.398,85	5.224.022,50	205.525.869,04	2.891.938,29	1,43%	0,63%	225,19%	2,10%
Novembro	205.525.869,04	7.788.954,31	5.426.367,08	207.695.468,63	-192.987,64	-0,09%	0,98%	-9,51%	1,81%
Dezembro	207.695.468,63	3.982.835,15	1.436.826,19	215.323.630,36	5.082.152,77	2,42%	1,64%	147,18%	1,91%
Acumulado no ano					27.438.780,40	15,99%	10,59%	150,98%	



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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.985.861,20	0,00	0,00	8.144.821,08	158.959,88	1,99%	2,80%	1,99%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.956.517,64	0,00	0,00	8.075.023,23	118.505,59	1,49%	1,77%	1,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.704.585,07	0,00	0,00	15.893.996,76	189.411,69	1,21%	1,01%	1,21%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.643.109,05	0,00	0,00	5.710.505,77	67.396,72	1,19%	1,00%	1,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.306.918,38	0,00	0,00	4.357.790,85	50.872,47	1,18%	1,01%	1,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.351.433,96	0,00	0,00	8.447.694,34	96.260,38	1,15%	0,75%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.824.582,87	0,00	0,00	13.976.596,95	152.014,08	1,10%	0,74%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.913.678,14	0,00	0,00	13.037.494,67	123.816,53	0,96%	1,21%	0,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	393.763,80	0,00	0,00	397.375,14	3.611,34	0,92%	0,52%	0,92%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.193.966,05	0,00	0,00	5.237.965,45	43.999,40	0,85%	1,09%	0,85%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.152.022,71	0,00	0,00	2.165.163,30	13.140,59	0,61%	0,93%	0,61%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.606.481,31	0,00	0,00	2.622.220,68	15.739,37	0,60%	0,93%	0,60%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	38.283.941,79	0,00	0,00	38.511.116,49	227.174,70	0,59%	0,93%	0,59%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.426.276,50	0,00	0,00	3.440.096,11	13.819,61	0,40%	0,11%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.505.162,22	0,00	0,00	8.538.961,14	33.798,92	0,40%	0,07%	0,40%
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	256.275,99	0,00	0,00	257.215,87	939,88	0,37%	0,01%	0,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.862.202,43	0,00	0,00	1.868.603,60	6.401,17	0,34%	0,01%	0,34%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	20.813.651,25	3.428.000,00	52.000,00	24.268.998,63	79.347,38	0,33%	0,05%	0,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.631.891,89	554.835,15	1.384.826,19	1.808.623,60	6.722,75	0,21%	0,01%	0,28%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.401.932,45</b>	<b>0,85%</b>	<b>0,86%</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(%)
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	1.799.999,25	0,00	0,00	2.211.427,65	411.428,40	22,86%	37,24%	22,86%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13.715.452,35	0,00	0,00	15.436.606,61	1.721.154,26	12,55%	5,09%	12,55%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.217.405,13	0,00	0,00	3.500.810,97	283.405,84	8,81%	4,04%	8,81%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.068.952,28	0,00	0,00	5.481.052,54	412.100,26	8,13%	4,08%	8,13%
BRANDESCO SELECTION FI AÇÕES	7.509.238,12	0,00	0,00	8.049.448,35	540.210,23	7,19%	5,09%	7,19%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.124.023,13	0,00	0,00	1.153.567,81	29.544,68	2,63%	3,42%	2,63%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.231.265,03	0,00	0,00	4.341.977,80	110.712,77	2,62%	3,47%	2,62%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.216.811,09	0,00	0,00	8.388.474,97	171.663,88	2,09%	1,10%	2,09%
Total Renda Variável					3.680.220,32	8,20%	5,49%	

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	37.831.247,03	0,00	0,00	38.511.116,49	679.869,46	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.246.167,86	261.500,00	0,00	15.893.996,76	386.328,90	2,52%	2,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.648.910,67	0,00	0,00	13.976.596,95	327.686,28	2,40%	2,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.805.595,04	0,00	0,00	13.037.494,67	231.899,63	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.848.404,44	0,00	0,00	8.075.023,23	226.618,79	2,89%	2,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.232.114,66	0,00	0,00	8.447.694,34	215.579,68	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	15.285.565,90	13.038.200,23	4.241.000,00	24.268.998,63	186.232,50	0,89%	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.987.708,10	3.000.000,00	0,00	8.144.821,08	157.112,98	1,97%	2,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.569.214,72	0,00	0,00	5.710.505,77	141.291,05	2,54%	2,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.428.675,34	0,00	0,00	8.538.961,14	110.285,80	1,31%	1,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.253.541,54	0,00	0,00	4.357.790,85	104.249,31	2,45%	2,45%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.145.914,21	1.000.000,00	0,00	5.237.965,45	92.051,24	1,79%	1,81%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.361.177,75	0,00	0,00	3.440.096,11	78.918,36	2,35%	2,35%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.575.532,67	0,00	0,00	2.622.220,68	46.688,01	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.126.602,57	0,00	0,00	2.165.163,30	38.560,73	1,81%	1,81%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.702.368,48	2.586.488,08	4.512.357,28	1.808.623,60	32.124,32	0,76%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.846.564,96	0,00	0,00	1.868.603,60	22.038,64	1,19%	1,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	388.001,51	0,00	0,00	397.375,14	9.373,63	2,42%	2,42%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	254.258,45	0,00	0,00	257.215,87	2.957,42	1,16%	1,16%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.089.866,73</b>	<b>1,96%</b>	

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12.827.277,70	0,00	0,00	15.436.606,61	2.609.328,91	20,34%	20,34%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	7.364.270,79	0,00	0,00	8.049.448,35	685.177,56	9,30%	9,30%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.858.636,91	0,00	0,00	5.481.052,54	622.415,63	12,81%	12,81%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.088.279,44	0,00	0,00	3.500.810,97	412.531,53	13,36%	13,36%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.989.871,43	0,00	0,00	4.341.977,80	352.106,37	8,83%	8,83%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.084.072,02	0,00	0,00	8.388.474,97	304.402,95	3,77%	3,77%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.060.601,16	0,00	0,00	1.153.567,81	92.966,65	8,77%	8,77%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.310.123,00	0,00	3.333.858,49	0,00	23.735,49	0,72%	1,45%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.622.856,05	0,00	0,00	2.211.427,65	-411.428,40	-15,69%	-15,69%
Total Renda Variável					4.691.236,69	10,52%	

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	17.064.911,48	16.809.560,78	0,00	38.511.116,49	4.636.644,23	15,61%	16,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.110.321,89	7.261.500,00	0,00	15.893.996,76	1.522.174,87	12,31%	12,85%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.530.406,55	0,00	0,00	13.037.494,67	1.507.088,12	13,07%	13,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.672.240,46	3.000.000,00	0,00	13.976.596,95	1.304.356,49	10,93%	11,19%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.225.941,85	0,00	380.314,13	8.075.023,23	1.229.395,51	17,53%	11,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.988.105,73	3.000.000,00	3.000.000,00	8.144.821,08	1.156.715,35	21,57%	22,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.402.272,63	0,00	3.000.000,00	8.447.694,34	1.045.421,71	11,22%	11,20%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.392.118,55	39.984.536,72	39.887.500,00	24.268.998,63	779.843,36	4,65%	5,87%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.058.532,60	0,00	0,00	5.710.505,77	651.973,17	12,89%	12,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.020.297,55	0,00	214.594,95	4.357.790,85	552.088,25	14,15%	14,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.384.120,14	1.648.667,18	0,00	8.538.961,14	506.173,82	6,43%	6,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.345.718,14	0,00	0,00	2.622.220,68	276.502,54	11,79%	11,79%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.237.965,45	237.965,45	7,62%	12,43%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.938.674,50	0,00	0,00	2.165.163,30	226.488,80	11,68%	11,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.098.118,31	598.302,34	0,00	1.868.603,60	172.182,95	11,59%	11,91%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.663.164,72	11.346.467,38	13.362.011,84	1.808.623,60	161.003,34	3,81%	4,82%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	3.319.437,95	0,00	3.440.096,11	120.658,16	3,63%	13,69%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.172.613,14	0,00	2.000.000,00	257.215,87	84.602,73	5,39%	5,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	379.898,10	0,00	20.974,77	397.375,14	38.451,81	10,45%	10,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	571.561,15	0,00	597.656,19	0,00	26.095,04	4,57%	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.001.980,65	535.000,00	1.557.689,71	0,00	20.709,06	3,30%	5,81%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>16.256.534,76</b>	<b>12,35%</b>	



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 (%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.340.062,78	5.000.000,00	0,00	15.436.606,61	5.096.543,83	49,29%	54,75%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	6.310.016,42	0,00	0,00	8.049.448,35	1.739.431,93	27,57%	27,57%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	4.000.961,41	0,00	5.481.052,54	1.480.091,13	36,99%	45,27%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.184.039,74	3.000.000,00	0,00	8.388.474,97	1.204.435,23	16,77%	18,08%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.282.081,23	0,00	0,00	4.341.977,80	1.059.896,57	32,29%	32,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.500.810,97	500.810,97	16,69%	41,43%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3.505.244,42	0,00	3.889.968,75	0,00	384.724,33	10,98%	35,09%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	873.979,48	0,00	0,00	1.153.567,81	279.588,33	31,99%	31,99%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.150.503,01	0,00	3.333.858,49	0,00	183.355,48	5,82%	6,59%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2.958.059,81	0,00	0,00	2.211.427,65	-746.632,16	-25,24%	-25,00%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>11.182.245,64</b>	<b>29,36%</b>	