CRÉDITO E MERCADO
Consultoria em Investimentos

0.25468132
0.4512783
0.3548621
0.332548
0.89521
0.3

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)

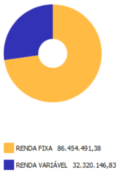
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.028.067,01	18,55%	923	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	21.655.578,14	18,23%	580	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	547.417,72	0,46%	964	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.240.457,52	1,89%	876	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.087.720,87	13,54%	613	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	21.310.385,42	17,94%	695	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	776.625,12	0,65%	681	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.399.534,94	1,18%	165	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	34.747,49	0,03%	324	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	263.094,97	0,22%	726	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.202,64	0,01%	300	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	102.659,54	0,09%	101	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.077.112,42	1,75%	1.635	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.176.493,85	5,20%	59.465	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	160.079,89	0,13%	165	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.646.570,95	1,39%	13.541	0,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.634.666,25	4,74%	927	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.797.740,21	2,36%	119	1,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.591.468,61	3,87%	18.924	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	108.476,38	0,09%	856	0,01%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.591.468,61	3,87%	18.924	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	2.579.998,71	2,17%		1,14%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			**118.774.638,21**				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			**16.269,11**				Artigo 6º
PL Total			**118.790.907,32**				

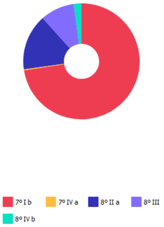
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	86.045.786,74	72,44%	0,00%	50,00%	100,00%	32.728.851,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	47.509.855,28
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	408.704,64	0,34%	0,00%	30,00%	40,00%	47.101.150,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.938.731,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.938.731,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.938.731,91
Total Renda Fixa	100,00%	86.454.491,38	72,79%	0,00%	90,00%	195,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2019)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira $	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	11.877.463,82
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	11.877.463,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	18.492.663,57	15,57%	0,00%	5,00%	20,00%	5.262.264,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.247.484,55	9,47%	0,00%	2,00%	10,00%	629.979,27
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.938.731,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.579.998,71	2,17%	0,00%	0,00%	5,00%	3.358.733,20
Total Renda Variável	30,00%	32.320.146,83	27,21%	0,00%	10,00%	60,00%	



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	55.059.625,81	46,36	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	49.704.248,76	41,85	0,00
ITAÚ UNIBANCO	6.547.709,66	5,51	0,00
META ASSET MANAGEMENT	2.797.740,21	2,36	1,14
ZION INVEST	2.579.998,71	2,17	19,07
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.085.315,06	1,76	0,00

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira $	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	86.045.786,74	72,44	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	408.704,64	0,34	0,00	40,00
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	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	18.492.663,57	15,57	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	11.247.484,55	9,47	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.579.998,71	2,17	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,91%	12,63%	1,90%	4,54%	12,63%	23,66%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	13,07%	1,81%	4,48%	13,07%	24,27%	0,01%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	11,19%	2,40%	4,92%	11,19%	21,53%	0,01%	0,02%
IMA-B 5 (Benchmark)	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%	12,86%	2,52%	5,31%	12,86%	23,77%	0,01%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,19%	12,89%	2,54%	5,34%	12,89%	23,79%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,98%	22,64%	2,78%	6,61%	22,64%	38,29%	0,03%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	10,46%	2,42%	4,56%	10,46%	21,28%	0,01%	0,01%
Selic (Benchmark)	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,77%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,37%	5,83%	1,16%	2,70%	5,83%	12,53%	0,00%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	4,82%	0,97%	2,23%	4,82%	10,36%	0,00%	0,00%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,31%	5,07%	1,03%	2,36%	5,07%	10,90%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,46%	10,69%	2,50%	4,61%	10,69%	-	0,00%	0,02%
IPCA (Benchmark)	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,59%	16,43%	1,80%	4,97%	16,43%	25,53%	0,01%	0,04%

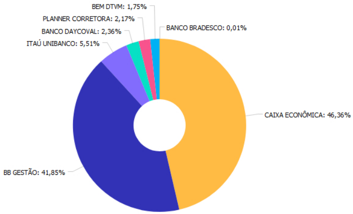
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	2,86%	28,88%	8,53%	9,82%	28,88%	20,84%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,65%	32,41%	8,88%	11,28%	32,41%	28,73%	0,03%	0,13%
IBX (Benchmark)	7,27%	33,39%	10,70%	15,40%	33,39%	53,96%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	12,19%	34,28%	17,84%	22,28%	34,28%	64,14%	0,06%	0,16%
Ibovespa (Benchmark)	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10,21%	39,84%	14,53%	21,51%	39,84%	76,22%	0,04%	0,13%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,81%	41,43%	13,36%	16,02%	41,43%	-	0,04%	0,17%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	0,04%	0,13%
CDI (Benchmark)	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%	0,02%	0,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,09%	18,08%	3,77%	7,38%	18,08%	29,14%	0,01%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	22,86%	-25,00%	-15,69%	-27,93%	-25,00%	-41,36%	0,37%	0,45%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	10,43%	44,48%	15,15%	25,87%	44,48%	78,58%	0,05%	0,12%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

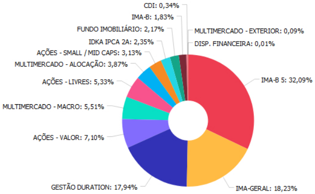
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	12,45%	52,48%	19,58%	29,98%	52,48%	63,78%	0,05%	0,15%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2019)



🟨	CAIXA ECONÔMICA	55.059.625,81
🟦	BB GESTÃO	49.704.248,76
🟪	ITAÚ UNIBANCO	6.547.709,66
🟩	BANCO DAYCOVAL	2.797.740,21
🟥	PLANNER CORRETORA	2.579.998,71
🟦	BEM DTVM	2.077.112,42
🟧	BANCO BRADESCO	8.202,64

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2019)

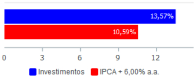


🟥	IMA-B 5	38.115.787,88
🟨	IMA-GERAL	21.655.578,14
🟦	GESTÃO DURATION	21.310.385,42
🟪	AÇÕES - VALOR	8.432.406,46
🟩	MULTIMERCADO - MACRO	6.547.539,56
🟥	AÇÕES - LIVRES	6.336.573,74
🟦	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	4.591.468,61
🟧	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.723.683,37
🟦	IDKA IPCA 2A	2.787.875,24
🟩	FUNDO IMOBILIÁRIO	2.579.998,71
🟫	IMA-B	2.176.160,06
🟥	CDI	408.704,64
🟩	MULTIMERCADO - EXTERIOR	108.476,38
🟥	DISP. FINANCEIRA	16.269,11

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

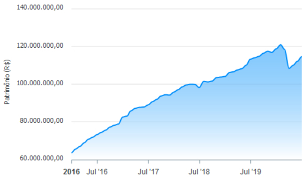
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	104.078.164,48	1.413.078,15	1.027.206,11	106.181.543,83	1.717.507,31	1.717.507,31	1,64%	1,64%	0,83%	0,83%	197,70%	1,37%
Fevereiro	106.181.543,83	12.038.515,97	11.990.436,77	106.505.083,01	275.459,98	1.992.967,29	0,26%	1,91%	0,90%	1,73%	109,98%	1,19%
Março	106.505.083,01	2.061.957,10	1.041.462,18	107.542.615,73	17.037,80	2.010.005,09	0,02%	1,92%	1,19%	2,95%	65,24%	2,32%
Abril	107.542.615,73	6.321.466,89	6.619.960,67	108.259.797,12	1.015.675,17	3.025.680,26	0,94%	2,89%	1,06%	4,04%	71,45%	1,63%
Maio	108.259.797,12	28.379.753,22	27.914.112,82	110.132.803,47	1.407.365,95	4.433.046,21	1,29%	4,22%	0,64%	4,71%	89,63%	2,31%
Junho	110.132.803,47	25.831.682,54	25.554.480,45	113.227.983,82	2.817.978,26	7.251.024,47	2,55%	6,88%	0,45%	5,18%	132,84%	3,39%
Julho	113.227.983,82	1.523.042,23	1.666.616,27	114.042.033,52	957.623,74	8.208.648,21	0,85%	7,78%	0,72%	5,94%	131,02%	2,15%
Agosto	114.042.033,52	3.626.153,29	2.909.182,41	114.787.481,04	28.476,64	8.237.124,85	0,02%	7,81%	0,62%	6,60%	118,37%	3,33%
Setembro	114.787.481,04	23.398.476,16	23.706.935,65	116.412.889,86	1.933.868,31	10.170.993,16	1,68%	9,63%	0,45%	7,07%	136,08%	2,45%
Outubro	116.412.889,86	782.710,85	1.094.662,87	117.549.188,49	1.448.250,65	11.619.243,81	1,24%	10,99%	0,63%	7,75%	141,77%	2,37%
Novembro	117.549.188,49	533.543,25	793.016,19	116.834.475,83	-455.239,72	11.164.004,09	-0,39%	10,56%	0,98%	8,80%	119,95%	2,15%
Dezembro	116.834.475,83	422.170,53	1.668.462,19	118.774.638,21	3.186.454,04	14.350.458,13	2,73%	13,57%	1,64%	10,59%	128,18%	2,39%

Investimentos x Meta Atuarial

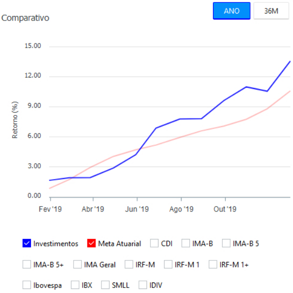


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	761.587,09	0,00	0,00	776.625,12	15.038,03	1,97%	1,97%	2,77%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.683.148,11	83.000,00	0,00	22.028.067,01	261.918,90	1,20%	1,21%	1,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.214.927,81	0,00	0,00	2.240.457,52	25.529,71	1,15%	1,15%	0,75%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.254.510,62	0,00	1.365.000,00	16.087.720,87	198.210,25	1,15%	1,19%	1,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	541.463,82	0,00	0,00	547.417,72	5.953,90	1,10%	1,10%	0,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.449.916,04	0,00	0,00	21.655.578,14	205.662,10	0,96%	0,96%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.386.815,97	0,00	0,00	1.399.534,94	12.718,97	0,92%	0,92%	0,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	21.184.676,77	0,00	0,00	21.310.385,42	125.708,65	0,59%	0,59%	0,93%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	102.188,52	0,00	0,00	102.659,54	471,02	0,46%	0,46%	0,33%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.172,66	0,00	0,00	8.202,64	29,98	0,37%	0,37%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	86.920,32	334.293,46	158.698,52	263.094,97	579,71	0,14%	0,28%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	174.394,89	4.877,07	144.763,67	34.747,49	239,20	0,13%	0,31%	0,01%
Total Renda Fixa	**86.848.722,62**	**422.170,53**	**1.668.462,19**	**86.454.491,38**	**852.060,42**	**0,98%**		**1,04%**

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.099.998,95	0,00	0,00	2.579.998,71	479.999,76	22,86%	22,86%	37,24%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.464.231,15	0,00	0,00	1.646.570,95	182.339,80	12,45%	12,45%	5,12%
META VALOR FI AÇÕES	2.493.833,80	0,00	0,00	2.797.740,21	303.906,41	12,19%	12,19%	5,87%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.880.877,75	0,00	0,00	2.077.112,42	196.234,67	10,43%	10,43%	4,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	145.253,94	0,00	0,00	160.079,89	14.825,95	10,21%	10,21%	4,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.178.515,56	0,00	0,00	5.634.666,25	456.150,69	8,81%	8,81%	4,04%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.712.105,91	0,00	0,00	6.176.493,85	464.387,94	8,13%	8,13%	4,08%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	105.677,74	0,00	0,00	108.476,38	2.798,64	2,65%	2,65%	3,47%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.491.709,36	0,00	0,00	4.591.468,61	99.759,25	2,22%	2,22%	1,53%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.413.549,05	0,00	0,00	6.547.539,56	133.990,51	2,09%	2,09%	1,10%
Total Renda Variável	**29.985.753,21**	**0,00**	**0,00**	**32.320.146,83**	**2.334.393,62**	**7,79%**		**6,01%**

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.405.548,17	83.000,00	0,00	22.028.067,01	539.518,84	2,51%	2,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.028.569,74	0,00	1.365.000,00	16.087.720,87	424.151,13	2,49%	2,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.270.387,53	0,00	0,00	21.655.578,14	385.190,61	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	20.934.175,08	0,00	0,00	21.310.385,42	376.210,34	1,80%	1,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.303.628,35	0,00	122.000,00	2.240.457,52	58.829,17	2,55%	2,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.366.521,47	0,00	0,00	1.399.534,94	33.013,47	2,42%	2,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	755.625,69	0,00	0,00	776.625,12	20.999,43	2,78%	2,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	557.565,66	0,00	23.000,00	547.417,72	12.852,06	2,31%	2,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	415.796,14	1.278.866,96	1.436.295,46	263.094,97	4.727,33	0,28%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	100.152,29	0,00	0,00	102.659,54	2.507,25	2,50%	2,50%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	266.249,19	376.557,67	609.845,79	34.747,49	1.786,42	0,28%	1,03%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.108,32	0,00	0,00	8.202,64	94,32	1,16%	1,16%
			Total Renda Fixa		**1.859.880,37**	**2,11%**	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.475.105,53	0,00	0,00	6.176.493,85	701.388,32	12,81%	12,81%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.970.683,68	0,00	0,00	5.634.666,25	663.982,57	13,36%	13,36%
META VALOR FI AÇÕES	2.374.140,26	0,00	0,00	2.797.740,21	423.599,95	17,84%	17,84%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.803.790,62	0,00	0,00	2.077.112,42	273.321,80	15,15%	15,15%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.376.973,90	0,00	0,00	1.646.570,95	269.597,05	19,58%	19,58%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.309.940,90	0,00	0,00	6.547.539,56	237.598,66	3,77%	3,77%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.390.526,52	0,00	0,00	4.591.468,61	200.942,09	4,58%	4,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	139.768,62	0,00	0,00	160.079,89	20.311,27	14,53%	14,53%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	99.633,73	0,00	0,00	108.476,38	8.842,65	8,88%	8,88%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	3.059.998,47	0,00	0,00	2.579.998,71	-479.999,76	-15,69%	-15,69%
			Total Renda Variável		**2.319.584,60**	**7,73%**	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.404.397,22	11.544.011,23	0,00	21.310.385,42	2.361.976,97	12,47%	16,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.484.124,43	11.920.000,00	0,00	21.655.578,14	2.251.453,71	11,60%	13,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.537.780,79	11.847.000,00	0,00	22.028.067,01	1.643.286,22	8,06%	12,85%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	16.530.952,11	1.365.000,00	16.087.720,87	921.768,76	5,58%	12,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.958.752,84	931.150,34	11.223.000,00	547.417,72	880.514,54	8,09%	11,19%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.775.730,07	0,00	5.151.000,00	2.240.457,52	615.727,45	9,09%	11,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	17.649.567,67	0,00	18.178.819,00	0,00	529.251,33	3,00%	6,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.096.051,40	0,00	11.341.280,00	0,00	245.228,60	2,21%	6,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.337.981,71	0,00	73.872,07	1.399.534,94	135.425,30	10,12%	10,46%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	5.318.938,84	24.761.846,40	30.160.452,39	34.747,49	114.414,64	0,38%	5,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.549.111,34	8.839.617,54	20.231.736,15	263.094,97	106.102,24	0,52%	4,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	108.793,23	735.368,00	118.626,88	776.625,12	51.090,77	6,05%	22,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	625.467,61	0,00	645.440,53	0,00	19.972,92	3,19%	5,68%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	80.974,25	0,00	91.404,91	0,00	10.430,66	12,88%	22,59%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	189.712,01	0,00	197.890,40	0,00	8.178,39	4,31%	12,33%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	100.000,00	0,00	102.659,54	2.659,54	2,66%	10,69%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00	3.200.000,00	3.200.649,56	0,00	649,56	0,02%	5,81%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.750,57	0,00	0,00	8.202,64	452,07	5,83%	5,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.946,09	0,00	2.164,65	0,00	218,56	11,23%	29,73%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.407,58	0,00	2.521,86	0,00	114,28	4,75%	11,79%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.588,32	0,00	2.676,18	0,00	87,86	3,39%	11,68%
			Total Renda Fixa		**9.899.004,37**	**5,54%**	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	5.000.649,56	0,00	6.176.493,85	1.175.844,29	23,51%	45,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	4.821.955,00	0,00	5.634.666,25	812.711,25	16,85%	41,43%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.790.629,90	0,00	4.000.000,00	4.591.468,61	800.838,71	10,28%	13,70%
META VALOR FI AÇÕES	2.083.479,18	0,00	0,00	2.797.740,21	714.261,03	34,28%	34,28%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.437.636,30	0,00	0,00	2.077.112,42	639.476,12	44,48%	44,48%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.079.870,14	0,00	0,00	1.646.570,95	566.700,81	52,48%	52,48%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.547.539,56	547.539,56	9,13%	18,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	114.474,71	0,00	0,00	160.079,89	45.605,18	39,84%	39,84%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	100.000,00	0,00	108.476,38	8.476,38	8,48%	32,41%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	3.439.998,28	0,00	0,00	2.579.998,71	-859.999,57	-25,00%	-25,00%
			Total Renda Variável		**4.451.453,76**	**15,97%**	