

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.977.249,79	1,18%	964	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.803.210,87	4,05%	104	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	15.061.332,94	8,96%	695	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.027.490,15	2,40%	115	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.881.941,76	10,05%	613	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.456.231,76	5,03%	681	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	3.176.509,48	1,89%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.834.058,65	7,64%	923	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.634.616,18	6,92%	67	9,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.334.593,56	1,39%	726	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.039.168,41	0,62%	324	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.765.201,17	5,22%	167	0,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.888.054,05	6,48%	289	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.106.959,08	3,63%	28	8,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	5.912.113,91	3,52%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	195.784,39	0,12%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	2.948.345,35	1,75%	59.465	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.293.177,71	2,55%	7.771	0,86%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.282.094,17	1,95%	2.426	1,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	8.840.371,56	5,26%	6.311	0,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.576.032,21	2,13%	5.767	0,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	3.761.082,61	2,24%	1.463	2,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

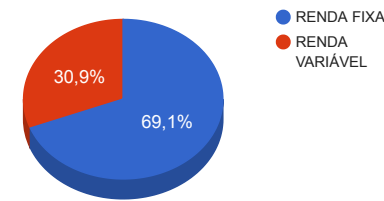
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.905.623,45	1,73%	927	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.314.019,31	1,97%	1.982	0,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.683.142,98	3,98%	52	7,74%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.369.386,16	3,79%	26.794	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.169.756,75	1,89%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	2.825.466,54	1,68%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
Total			168.063.014,95				

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

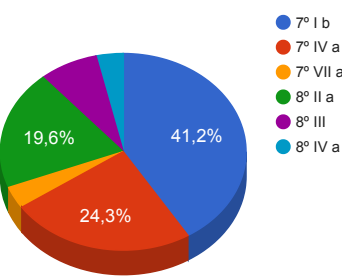
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	69.218.025,40	41,19%	15,00%	25,00%	70,00%	48.426.085,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	100.837.808,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	40.768.592,45	24,26%	10,00%	30,00%	40,00%	26.456.613,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	6.107.898,30	3,63%	1,00%	5,00%	5,00%	2.295.252,45
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	32.920.746,37	19,59%	7,00%	12,50%	20,00%	691.856,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.052.529,14	7,77%	7,00%	10,00%	10,00%	3.753.772,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.995.223,29	3,57%	2,00%	5,00%	5,00%	2.407.927,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	8.403.150,75
Total Carteira		168.063.014,95					

RENTA FIXA	116.094.516,15	69,08%
RENTA VARIÁVEL	51.968.498,80	30,92%

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 "	69.218.025,40	41,19%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40.768.592,45	24,26%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	6.107.898,30	3,63%	1,00%	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%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	32.920.746,37	19,59%	7,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	13.052.529,14	7,77%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.995.223,29	3,57%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total	168.063.014,95	100,00%	42,00	406,00

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	37.281.195,95	22,18%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.754.900,01	20,08%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	24.424.718,24	14,53%	4,23%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.568.412,04	9,26%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	13.836.399,40	8,23%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	11.665.838,10	6,94%	0,01%
Aurora Capital	5.912.113,91	3,52%	7,91%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.293.177,71	2,55%	0,41%
BANCO J. SAFRA S/A	4.027.490,15	2,40%	0,00%
HIX CAPITAL	3.761.082,61	2,24%	0,21%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	3.576.032,21	2,13%	0,07%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.314.019,31	1,97%	0,01%
PERFIN INVESTIMENTOS	3.282.094,17	1,95%	0,05%
A5 CAPITAL PARTNERS	3.169.756,75	1,89%	-
BRASIL PLURAL	195.784,39	0,12%	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 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%	-	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,22%	23,44%	3,12%	6,84%	23,44%	41,32%	0,30%	3,119%	7,31%
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%
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%

IPCA + 7,00% ao ano	1,72%	11,64%	3,53%	5,66%	11,64%	23,86%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,47%	-9,88%	0,83%	-3,47%	-9,88%	-24,64%	1,65%	-	7,55%

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%	-	-	-
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 VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	15,21%	2,59%	5,66%	15,21%	27,96%	0,20%	1,240%	3,07%
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%
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%

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
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%
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,31%	5,07%	1,03%	2,36%	5,07%	10,90%	0,80%	0,007%	0,20%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	4,82%	0,97%	2,23%	4,82%	10,36%	1,00%	0,009%	0,20%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,57%	4,71%	-1,56%	-3,71%	4,71%	-27,65%	0,72%	0,084%	12,49%

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
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	12,11%	50,88%	18,52%	27,59%	50,88%	85,36%	2,00%	3,700%	15,58%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,81%	41,43%	13,36%	16,02%	41,43%	-	2,00%	4,042%	16,51%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,64%	40,61%	15,22%	19,53%	40,61%	56,68%	1,85%	3,148%	10,79%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	1,90%	4,076%	12,62%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,19%	39,23%	9,97%	18,71%	39,23%	68,43%	3,00%	4,082%	10,50%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6,70%	41,91%	10,08%	14,72%	41,91%	44,59%	2,00%	4,141%	15,53%

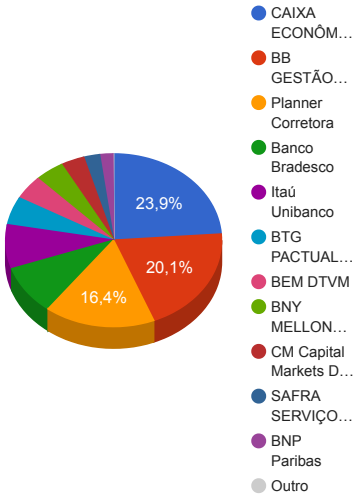
IPCA + 8,00% ao ano	1,80%	12,68%	3,78%	6,16%	12,68%	26,18%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

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%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,85%	6,59%	1,45%	2,96%	6,59%	13,87%	1,00%	0,613%	0,89%

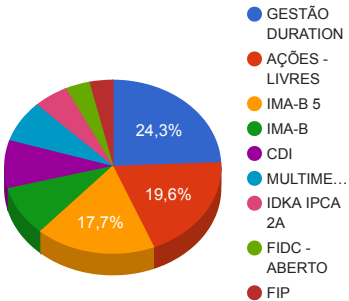
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	14,28%	68,20%	25,08%	39,98%	68,20%	67,31%	2,00%	4,094%	16,52%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	7,05%	34,10%	11,27%	19,10%	34,10%	54,59%	2,00%	4,716%	11,92%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.106.662,49	23,86%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.754.900,01	20,08%
Planner Corretora	27.594.474,99	16,42%
Banco Bradesco	15.568.412,04	9,26%
Itaú Unibanco	13.836.399,40	8,23%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	8.840.371,56	5,26%
BEM DTVM	7.575.271,88	4,51%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	7.337.114,82	4,37%
CM Capital Markets DTVM	5.912.113,91	3,52%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA	4.027.490,15	2,40%
BNP Paribas	3.314.019,31	1,97%
SANTANDER SECURITIES SERVICES	195.784,39	0,12%



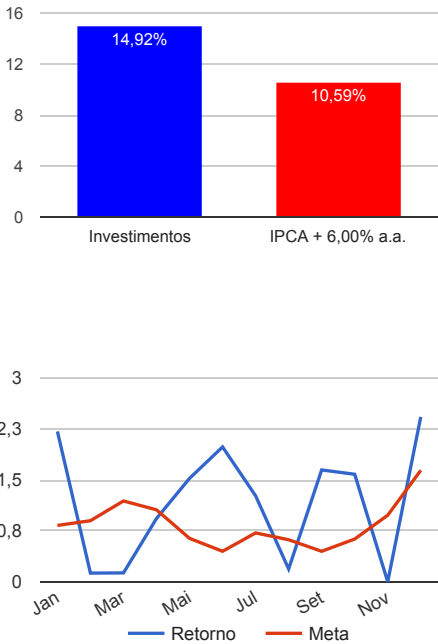
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	40.821.547,24	24,29%
AÇÕES - LIVRES	32.920.746,37	19,59%
IMA-B 5	29.716.000,41	17,68%
IMA-B	15.660.231,39	9,32%
CDI	15.008.378,15	8,93%
MULTIMERCADO	13.052.529,14	7,77%
IDKA IPCA 2A	8.780.460,66	5,22%
FIDC - ABERTO	6.107.898,30	3,63%
FIP	5.995.223,29	3,57%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	146.458.485,09	4.258.701,74	3.477.204,61	150.498.104,38	3.258.122,16	2,21%	0,83%	266,08%	1,66%
Fevereiro	150.498.104,38	29.163.354,34	28.363.666,48	151.493.308,15	195.515,91	0,13%	0,90%	14,43%	1,98%
Março	151.493.308,15	2.839.786,38	3.012.544,51	151.520.465,58	199.915,56	0,13%	1,19%	11,06%	2,71%
Abril	151.520.465,58	7.816.188,97	7.834.190,96	152.914.794,10	1.412.330,51	0,93%	1,06%	87,97%	1,42%
Mai	152.914.794,10	31.137.710,98	32.463.049,20	153.917.527,83	2.328.071,95	1,52%	0,64%	237,64%	5,91%
Junho	153.917.527,83	2.166.805,89	2.341.115,97	156.797.884,11	3.054.666,36	1,98%	0,45%	440,69%	1,82%
Julho	156.797.884,11	17.178.334,01	17.228.410,46	158.732.463,40	1.984.655,74	1,27%	0,72%	174,77%	1,49%
Agosto	158.732.463,40	2.384.094,34	2.656.027,51	158.763.373,43	302.843,20	0,19%	0,62%	30,74%	3,18%
Setembro	158.763.373,43	12.628.654,30	13.623.327,31	160.382.552,15	2.613.851,73	1,65%	0,45%	368,68%	1,64%
Outubro	160.382.552,15	1.368.898,82	2.059.184,57	162.230.597,15	2.538.330,75	1,58%	0,63%	249,72%	2,00%
Novembro	162.230.597,15	1.525.699,81	2.770.930,61	160.988.382,92	3.016,57	0,00%	0,98%	0,19%	1,87%
Dezembro	160.988.382,92	10.838.549,85	7.744.468,54	168.063.014,95	3.980.550,72	2,43%	1,64%	147,71%	1,65%
Acumulado no ano					21.871.871,16	14,92%	10,59%	140,86%	

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.292.491,08	0,00	0,00	8.456.231,76	163.740,68	1,97%	2,77%	1,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.136.319,87	0,00	0,00	3.176.509,48	40.189,61	1,28%	1,24%	1,28%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.604.771,14	78.817,73	0,00	16.881.941,76	198.352,89	1,19%	1,00%	1,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.267.980,84	1.125.847,82	2.718.375,60	12.834.058,65	158.605,59	1,03%	1,01%	1,21%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.059.406,71	0,00	0,00	6.106.959,08	47.552,37	0,78%	1,15%	0,78%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.670.321,72	0,00	4.000.000,00	8.765.201,17	94.879,45	0,75%	1,09%	0,85%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,00	4.000.000,00	0,00	4.027.490,15	27.490,15	0,69%	3,12%	2,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	574.525,97	1.390.000,00	0,00	1.977.249,79	12.723,82	0,65%	0,74%	1,10%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.972.487,07	0,00	0,00	15.061.332,94	88.845,87	0,59%	0,93%	0,59%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	11.570.079,82	0,00	0,00	11.634.616,18	64.536,36	0,56%	0,43%	0,56%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	6.766.906,45	0,00	0,00	6.803.210,87	36.304,42	0,54%	0,99%	0,54%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	5.884.530,04	0,00	0,00	5.912.113,91	27.583,87	0,47%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.850.755,43	0,00	0,00	10.888.054,05	37.298,62	0,34%	0,01%	0,34%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	54.378,90	1.919.870,69	935.599,64	1.039.168,41	518,46	0,03%	0,01%	0,31%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.210,61	2.324.013,61	11.675,57	2.334.593,56	44,91	0,00%	0,01%	0,28%
BBIF MASTER FIDC LP	196.915,88	0,00	0,00	195.784,39	-1.131,49	-0,57%	0,08%	-0,57%
Total Renda Fixa					997.535,58	0,87%	1,03%	

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(%)
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.291.044,58	0,00	0,00	3.761.082,61	470.038,03	14,28%	4,09%	14,28%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.829.344,02	0,00	0,00	4.293.177,71	463.833,69	12,11%	3,70%	12,11%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.670.400,62	0,00	0,00	2.905.623,45	235.222,83	8,81%	4,04%	8,81%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.020.986,56	0,00	0,00	3.282.094,17	261.107,61	8,64%	3,15%	8,64%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.726.670,06	0,00	0,00	2.948.345,35	221.675,29	8,13%	4,08%	8,13%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.247.320,99	0,00	0,00	8.840.371,56	593.050,57	7,19%	4,08%	7,19%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	3.340.526,80	0,00	0,00	3.576.032,21	235.505,41	7,05%	4,72%	7,05%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.106.055,74	0,00	0,00	3.314.019,31	207.963,57	6,70%	4,14%	6,70%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.791.011,38	0,00	78.817,73	2.825.466,54	113.272,89	4,06%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.239.041,42	0,00	0,00	6.369.386,16	130.344,74	2,09%	1,10%	2,09%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.626.906,96	0,00	0,00	6.683.142,98	56.236,02	0,85%	0,61%	0,85%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.174.992,26	0,00	0,00	3.169.756,75	-5.235,51	-0,16%	-	-
Total Renda Variável					2.983.015,14	6,08%	3,11%	

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 (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.431.713,74	78.817,73	45.000,00	16.881.941,76	416.410,29	2,53%	2,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.674.024,65	1.612.883,23	3.801.436,33	12.834.058,65	348.587,10	2,34%	2,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.795.442,44	0,00	0,00	15.061.332,94	265.890,50	1,80%	1,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.227.580,85	0,00	0,00	8.456.231,76	228.650,91	2,78%	2,78%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.550.731,95	0,00	4.000.000,00	8.765.201,17	214.469,22	1,71%	1,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.759.638,39	0,00	0,00	10.888.054,05	128.415,66	1,19%	1,19%
INFINITY LÔTUS FI RENDA FIXA LP	11.508.486,67	0,00	0,00	11.634.616,18	126.129,51	1,10%	1,10%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	6.686.199,84	0,00	0,00	6.803.210,87	117.011,03	1,75%	1,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.096.407,70	0,00	0,00	3.176.509,48	80.101,78	2,59%	2,59%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.028.066,84	0,00	0,00	6.106.959,08	78.892,24	1,31%	1,31%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	5.863.716,55	0,00	0,00	5.912.113,91	48.397,36	0,83%	0,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.208.495,39	2.130.000,00	2.391.098,83	1.977.249,79	29.853,23	1,30%	2,40%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,00	4.000.000,00	0,00	4.027.490,15	27.490,15	0,69%	3,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	128.566,31	3.092.458,40	2.183.013,57	1.039.168,41	1.157,27	0,13%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.171,29	2.385.491,58	75.217,26	2.334.593,56	147,95	0,22%	0,97%
BBIF MASTER FIDC LP	198.883,94	0,00	0,00	195.784,39	-3.099,55	-1,56%	-1,56%
Total Renda Fixa					2.108.504,65	1,85%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.039.017,18	0,00	0,00	8.840.371,56	801.354,38	9,97%	9,97%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.006.973,41	0,00	0,00	3.761.082,61	754.109,20	25,08%	25,08%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.622.432,10	0,00	0,00	4.293.177,71	670.745,61	18,52%	18,52%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.848.441,56	0,00	0,00	3.282.094,17	433.652,61	15,22%	15,22%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	3.213.691,79	0,00	0,00	3.576.032,21	362.340,42	11,27%	11,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.563.228,13	0,00	0,00	2.905.623,45	342.395,32	13,36%	13,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.613.538,08	0,00	0,00	2.948.345,35	334.807,27	12,81%	12,81%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.010.506,32	0,00	0,00	3.314.019,31	303.512,99	10,08%	10,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.138.252,37	0,00	0,00	6.369.386,16	231.133,79	3,77%	3,77%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.371.220,23	433.497,54	78.817,73	2.825.466,54	99.566,50	3,55%	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.587.382,80	0,00	0,00	6.683.142,98	95.760,18	1,45%	1,45%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.185.741,63	0,00	0,00	3.169.756,75	-15.984,88	-0,50%	-
Total Renda Variável					4.413.393,39	9,27%	

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	7.056.909,05	6.047.784,05	0,00	15.061.332,94	1.956.639,84	16,80%	16,43%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	15.304.694,75	45.000,00	16.881.941,76	1.622.247,01	11,17%	12,89%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.423.320,62	3.000.000,00	4.000.000,00	8.765.201,17	1.341.880,55	12,31%	12,43%
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	10.738.665,58	6.593.379,18	11.593.021,73	6.803.210,87	1.064.187,84	10,43%	11,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	15.919.435,50	4.141.436,33	12.834.058,65	1.056.059,48	7,77%	12,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.766.164,53	4.157.073,75	12.668.098,83	1.977.249,79	722.110,34	9,09%	11,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	10.183.973,00	0,00	10.888.054,05	704.081,05	6,91%	11,91%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	10.952.546,73	0,00	0,00	11.634.616,18	682.069,45	6,23%	6,23%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.663.432,06	3.000.000,00	0,00	6.106.959,08	443.527,02	8,75%	8,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.803.840,78	2.585.443,95	7.829.836,21	0,00	440.551,48	6,52%	11,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.900.271,48	0,00	152.308,87	3.176.509,48	428.546,87	15,22%	15,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.040.646,21	0,00	8.456.231,76	415.585,55	5,17%	22,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	6.797.581,87	3.000.000,00	10.172.974,71	0,00	375.392,84	4,57%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.071.474,34	3.715.000,00	25.110.833,42	0,00	324.359,08	1,96%	6,55%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	14.588.732,73	1.237.757,72	15.987.223,63	0,00	160.733,18	3,00%	5,83%
BTG PACTUAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO NTN-B	2.621.939,40	0,00	2.740.192,40	0,00	118.253,00	4,51%	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,00	4.000.000,00	0,00	4.027.490,15	27.490,15	0,69%	23,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.456.343,58	0,00	3.480.586,95	0,00	24.243,37	0,70%	5,74%
BBIF MASTER FIDC LP	186.980,37	0,00	0,00	195.784,39	8.804,02	4,71%	4,71%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	46.665,94	12.048.796,09	11.063.399,11	1.039.168,41	7.105,49	0,61%	5,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	682.958,30	0,00	687.493,44	0,00	4.535,14	0,68%	5,72%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	448.315,44	12.159.297,69	10.276.258,21	2.334.593,56	3.238,64	1,08%	4,82%

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 (%)
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	6.582.200,85	0,00	498.855,11	5.912.113,91	-171.231,83	-2,59%	-9,88%
			Total Renda Fixa		11.760.409,56	10,40%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.349.343,08	0,00	0,00	8.840.371,56	2.491.028,48	39,23%	39,23%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.236.141,03	0,00	0,00	3.761.082,61	1.524.941,58	68,20%	68,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.845.352,20	0,00	0,00	4.293.177,71	1.447.825,51	50,88%	50,88%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.335.312,35	0,00	0,00	3.314.019,31	978.706,96	41,91%	41,91%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.334.265,34	0,00	0,00	3.282.094,17	947.828,83	40,61%	40,61%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.666.756,01	0,00	0,00	3.576.032,21	909.276,20	34,10%	34,10%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.948.345,35	448.345,35	17,93%	45,27%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.269.727,56	0,00	0,00	6.683.142,98	413.415,42	6,59%	6,59%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.905.623,45	405.623,45	16,22%	41,43%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.369.386,16	369.386,16	6,16%	18,08%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.420.664,96	1.313.497,54	78.817,73	2.825.466,54	170.121,77	9,30%	-
SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.979.123,66	0,00	3.047.784,05	0,00	68.660,39	2,30%	0,61%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.233.455,25	0,00	0,00	3.169.756,75	-63.698,50	-1,97%	-
Total Renda Variável					10.111.461,60	27,76%	