

# **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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.032.395,28	3,24%	695	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.016.603,17	1,62%	580	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	11.371.829,47	18,15%	876	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.650.643,41	20,19%	1.361	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.358.303,96	16,53%	964	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.581.026,16	2,52%	1.198	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	947.118,24	1,51%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	286.947,59	0,46%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.181.294,03	5,08%	324	0,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.101.212,86	8,14%	376	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.059.920,96	3,29%	167	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	2.326.067,51	3,71%	8	5,99%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	768.315,73	1,23%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.510.548,49	2,41%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	597.210,63	0,95%	43	0,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	382.254,14	0,61%	277	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.038.952,21	1,66%	26.794	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	1.246.107,69	1,99%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	18.187,22	0,03%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.471.084,20	3,94%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

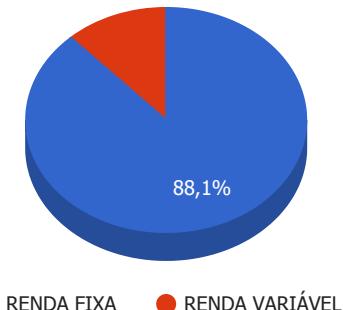
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.043.642,97	1,67%		<b>7,03%</b>	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	665.806,41	1,06%		0,30%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>62.655.472,33</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>84,59</b>				Artigo 6º
		<b>PL Total</b>	<b>62.655.556,92</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDAS FIXAS) - 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%	39.010.801,45	62,26%	15,00%	25,00%	70,00%	4.848.029,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	37.593.283,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.576.493,68	18,48%	10,00%	30,00%	40,00%	13.485.695,25
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	9.398.320,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	4.604.931,73	7,35%	2,00%	5,00%	5,00%	-1.472.158,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.132.773,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.132.773,62
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>55.192.226,86</b>	<b>88,09%</b>	<b>32,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>200,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**

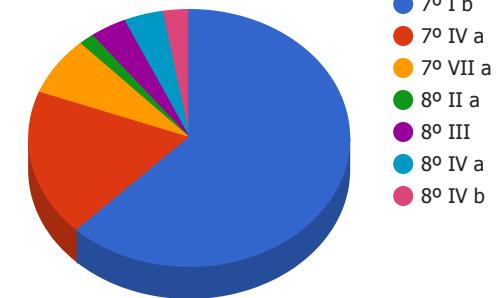


● RENDA FIXA   ● RENDA VARIÁVEL

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	979.464,77	1,56%	7,00%	10,00%	20,00%	11.551.629,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.303.247,12	3,68%	7,00%	10,00%	10,00%	3.962.300,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	2.471.084,20	3,94%	2,00%	5,00%	5,00%	661.689,42
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.709.449,38	2,73%	2,00%	5,00%	5,00%	1.423.324,24
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>7.463.245,47</b>	<b>11,91%</b>	<b>18,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.960.012,38	55,80	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.351.712,94	22,91	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	4.156.213,43	6,63	0,06
A5 CAPITAL PARTNERS	2.471.084,20	3,94	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.059.920,96	3,29	0,00
AURORA CAPITAL	1.510.548,49	2,41	2,02
RJI GESTÃO & INVESTIMENTOS	1.246.107,69	1,99	0,26
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	947.118,24	1,51	0,01
ZION INVEST	665.806,41	1,06	4,92
RJI CORRETORA DE VALORES	286.947,59	0,46	0,02

**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 "	39.010.801,45	62,26	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.576.493,68	18,48	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	4.604.931,73	7,35	2,00	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 II, Alínea " a "	979.464,77	1,56	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.303.247,12	3,68	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	2.471.084,20	3,94	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.709.449,38	2,73	2,00	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	-0,48%	13,07%	0,96%	3,34%	10,42%	21,24%	0,01%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,80%	12,68%	3,78%	6,16%	12,68%	26,18%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-2,65%	10,64%	0,38%	2,49%	8,63%	21,75%	0,00%	0,01%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,46%	11,19%	1,10%	3,86%	9,19%	19,71%	0,01%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	11,20%	1,15%	4,07%	9,20%	19,63%	0,01%	0,01%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,72%	11,64%	3,53%	5,66%	11,64%	23,86%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	5,38%	-9,88%	0,47%	1,55%	-4,93%	-22,34%	-	0,08%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,11%	0,81%	-0,43%	-1,75%	-0,07%	672,98%	-	-

IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,42%	6,55%	0,40%	1,96%	5,48%	12,56%	0,00%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,42%	6,49%	0,40%	1,94%	5,42%	12,44%	0,00%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,03%	3,92%	0,35%	1,62%	2,35%	-9,34%	0,01%	0,04%

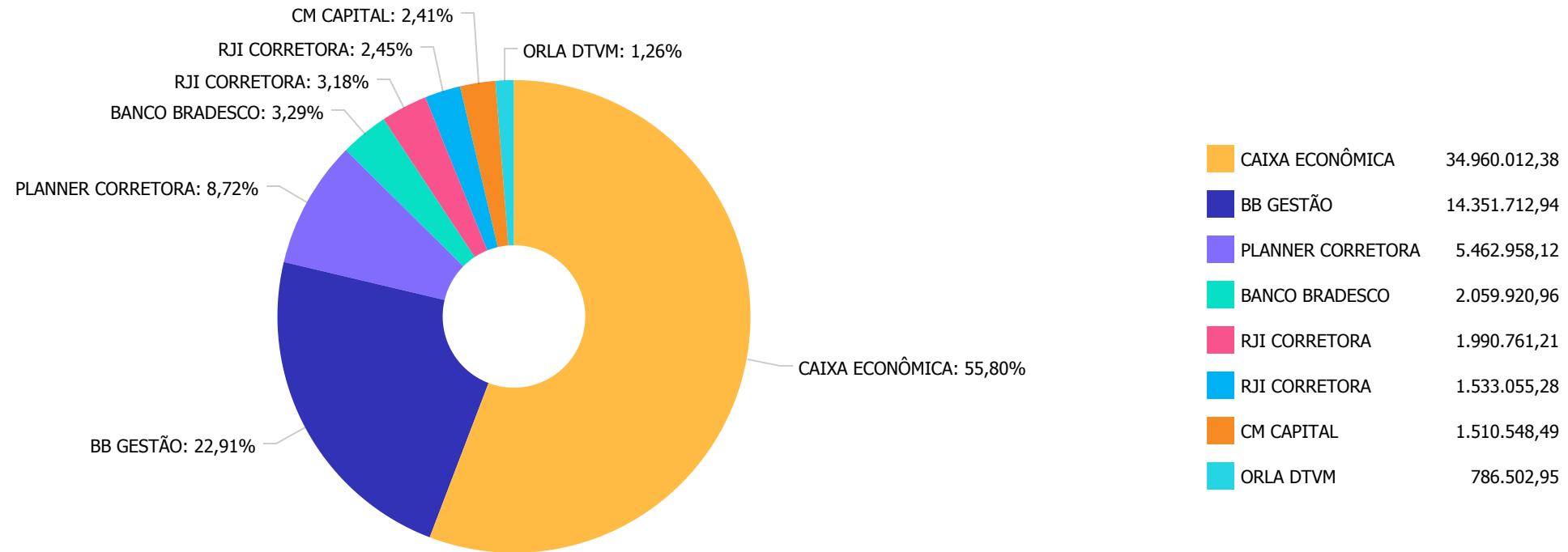
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,34%	4,90%	2,06%	3,05%	4,65%	-15,86%	0,04%	0,05%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	-0,30%	5,07%	0,31%	1,43%	4,14%	9,89%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,43%	12,43%	0,85%	3,32%	9,81%	20,43%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,81%	16,43%	0,59%	3,95%	12,61%	23,49%	0,01%	0,04%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,38%	5,91%	0,38%	1,70%	4,86%	11,32%	0,00%	0,00%

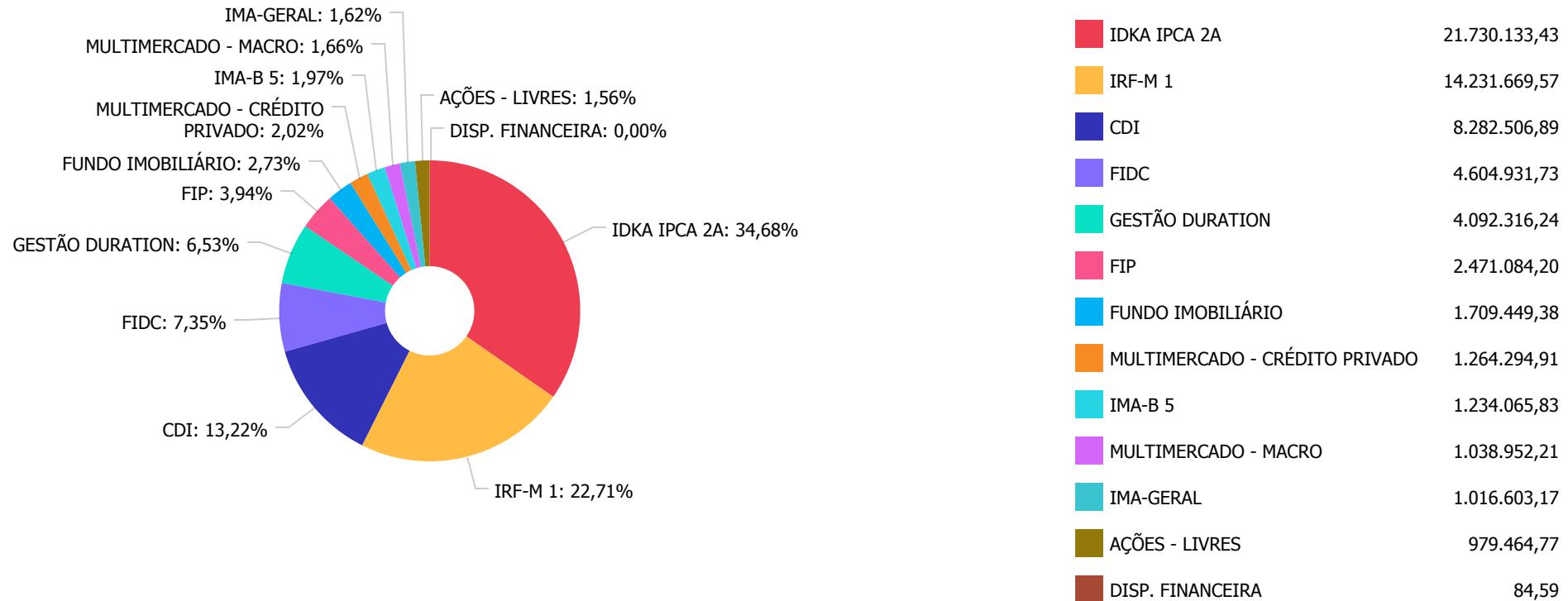
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,64%	10,59%	3,28%	5,15%	10,59%	21,56%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,04%	-10,11%	0,02%	-0,30%	-7,24%	-14,42%	0,00%	0,05%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	<b>6,85%</b>	<b>31,58%</b>	<b>10,41%</b>	<b>14,54%</b>	<b>31,58%</b>	<b>51,36%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1,40%	31,96%	8,20%	15,11%	22,65%	37,69%	0,04%	0,11%
<b>CDI (Benchmark)</b>	<b>0,37%</b>	<b>5,96%</b>	<b>1,24%</b>	<b>2,80%</b>	<b>5,96%</b>	<b>12,76%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,68%	18,08%	2,09%	5,33%	13,90%	26,36%	0,01%	0,03%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-7,25%	-0,98%	-0,87%	-3,45%	-1,79%	-94,85%	0,00%	0,03%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-1,23%	-	10,74%	17,38%	-	-	0,04%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	12,17%	-25,00%	22,86%	-17,31%	-24,12%	-37,07%	0,37%	0,45%
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-

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



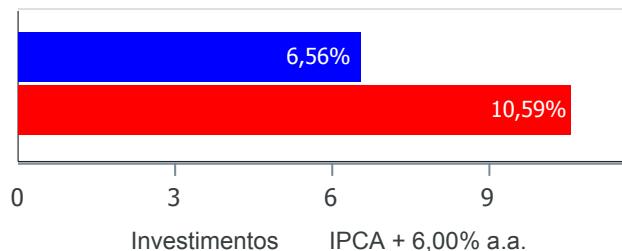
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

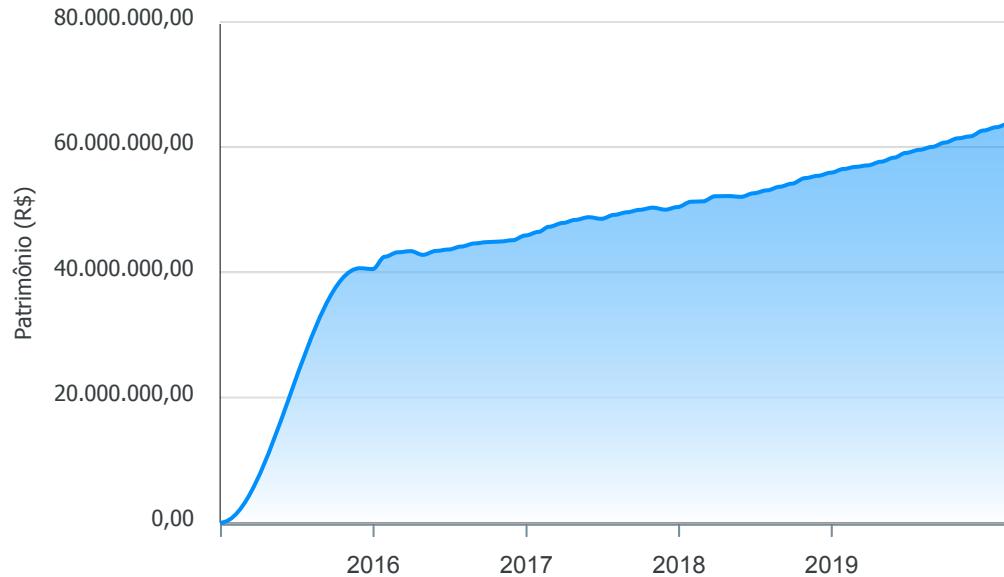
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	55.923.584,98	1.114.829,27	909.763,42	56.519.386,60	390.735,77	390.735,77	0,70%	0,70%	0,83%	0,83%	83,71%	0,75%
Fevereiro	56.519.386,60	462.397,30	258.675,66	56.849.438,45	126.330,21	517.065,98	0,22%	0,92%	0,90%	1,73%	53,06%	0,59%
Março	56.849.438,45	435.288,98	244.593,27	57.086.706,06	46.571,90	563.637,88	0,08%	1,00%	1,19%	2,95%	34,01%	0,98%
Abril	57.086.706,06	439.864,14	243.962,78	57.674.392,84	391.785,42	955.423,30	0,68%	1,69%	1,06%	4,04%	41,92%	0,59%
Maio	57.674.392,84	6.249.593,03	5.991.565,38	58.319.294,85	386.874,36	1.342.297,66	0,67%	2,37%	0,64%	4,71%	50,42%	0,69%
Junho	58.319.294,85	9.152.202,20	8.909.180,97	59.076.362,12	514.046,04	1.856.343,70	0,88%	3,27%	0,45%	5,18%	63,18%	1,47%
Julho	59.076.362,12	502.096,57	289.611,02	59.575.248,97	286.401,30	2.142.745,00	0,48%	3,77%	0,72%	5,94%	63,48%	0,85%
Agosto	59.575.248,97	2.705.734,79	2.355.241,65	60.037.971,52	112.229,41	2.254.974,41	0,19%	3,96%	0,62%	6,60%	60,10%	1,49%
Setembro	60.037.971,52	479.251,73	267.548,64	60.739.216,04	489.541,43	2.744.515,84	0,81%	4,81%	0,45%	7,07%	68,00%	0,97%
Outubro	60.739.216,04	5.031.945,97	4.817.206,45	61.397.183,20	443.227,64	3.187.743,48	0,73%	5,57%	0,63%	7,75%	71,87%	0,84%
Novembro	61.397.183,20	652.957,21	262.796,91	61.721.295,24	-66.048,26	3.121.695,22	-0,11%	5,46%	0,98%	8,80%	62,01%	0,68%
Dezembro	61.721.295,24	573.520,74	288.789,67	62.655.472,33	649.446,02	3.771.141,24	1,05%	6,56%	1,64%	10,59%	61,97%	1,01%

Investimentos x Meta Atuarial

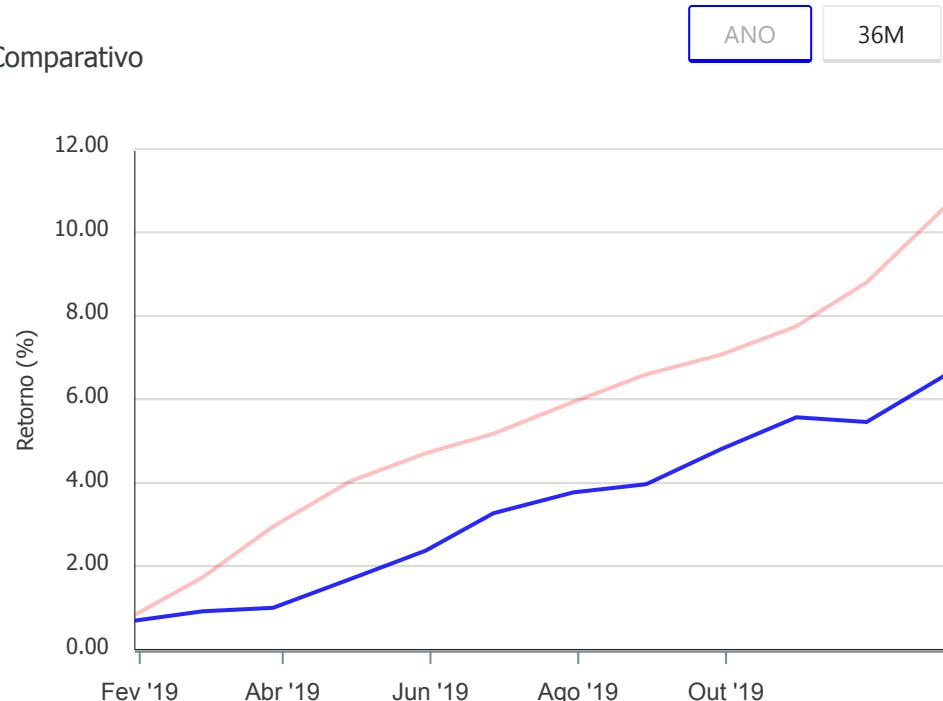


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos      Meta Atuarial       CDI       IMA-B       IMA-B 5  
 IMA-B 5+       IMA Geral       IRF-M       IRF-M 1       IRF-M 1+  
 Ibovespa       IBX       SMML       IDIV

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	928.008,89	0,00	0,00	947.118,24	19.109,35	2,06%	2,06%	4,12%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.295.664,14	0,00	0,00	2.326.067,51	30.403,37	1,32%	0,38%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.242.248,94	0,00	0,00	11.371.829,47	129.580,53	1,15%	1,15%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.245.643,64	0,00	0,00	10.358.303,96	112.660,32	1,10%	1,10%	0,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.006.948,53	0,00	0,00	1.016.603,17	9.654,64	0,96%	0,96%	1,21%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.042.617,43	0,00	0,00	2.059.920,96	17.303,53	0,85%	0,85%	1,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.020.406,31	0,00	0,00	2.032.395,28	11.988,97	0,59%	0,59%	0,93%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.503.500,80	0,00	0,00	1.510.548,49	7.047,69	0,47%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.599.939,69	0,00	0,00	12.650.643,41	50.703,72	0,40%	0,40%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.574.768,15	0,00	0,00	1.581.026,16	6.258,01	0,40%	0,40%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.082.116,04	0,00	0,00	5.101.212,86	19.096,82	0,38%	0,38%	0,06%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	285.948,32	0,00	0,00	286.947,59	999,27	0,35%	0,35%	1,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.887.507,36	573.520,74	288.789,67	3.181.294,03	9.055,60	0,26%	0,31%	0,01%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	771.624,61	0,00	0,00	768.315,73	-3.308,88	-0,43%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>54.486.942,85</b>	<b>573.520,74</b>	<b>288.789,67</b>	<b>55.192.226,86</b>	<b>420.552,94</b>	<b>0,77%</b>		<b>0,51%</b>

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 - ...	541.935,45	0,00	0,00	665.806,41	123.870,96	22,86%	22,86%	37,24%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	539.279,41	0,00	0,00	597.210,63	57.931,22	10,74%	10,74%	3,66%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	353.296,36	0,00	0,00	382.254,14	28.957,78	8,20%	8,20%	4,17%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.017.690,83	0,00	0,00	1.038.952,21	21.261,38	2,09%	2,09%	1,10%
HAZ FII - ATCR11	1.042.764,26	0,00	0,00	1.043.642,97	878,71	0,08%	0,00%	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.245.874,29	0,00	0,00	1.246.107,69	233,40	0,02%	0,02%	0,43%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.475.165,70	0,00	0,00	2.471.084,20	-4.081,50	-0,16%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.346,09	0,00	0,00	18.187,22	-158,87	-0,87%	-0,87%	0,03%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.234.352,39</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>7.463.245,47</b>	<b>228.893,08</b>	<b>3,16%</b>		<b>7,66%</b>

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.081.627,74	0,00	0,00	11.371.829,47	290.201,73	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.115.449,85	0,00	0,00	10.358.303,96	242.854,11	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.484.694,84	0,00	0,00	12.650.643,41	165.948,57	1,33%	1,33%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.262.337,51	0,00	0,00	2.326.067,51	63.730,00	2,82%	1,75%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.538.337,55	0,00	3.500.000,00	5.101.212,86	62.875,31	0,74%	1,20%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.023.338,03	0,00	0,00	2.059.920,96	36.582,93	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.032.395,28	32.395,28	1,62%	1,80%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.262.383,13	1.758.423,92	868.793,03	3.181.294,03	29.280,01	0,73%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.559.609,34	0,00	1.000.000,00	1.581.026,16	21.416,82	0,84%	1,31%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	927.302,04	0,00	0,00	947.118,24	19.816,20	2,14%	2,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.603,17	16.603,17	1,66%	1,81%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.498.182,94	0,00	0,00	1.510.548,49	12.365,55	0,83%	0,83%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	284.941,02	0,00	0,00	286.947,59	2.006,57	0,70%	0,70%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	774.784,83	0,00	0,00	768.315,73	-6.469,10	-0,83%	-0,83%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>989.607,15</b>	<b>1,66%</b>	

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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	597.210,63	97.210,63	19,44%	17,89%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	341.534,67	0,00	0,00	382.254,14	40.719,47	11,92%	11,92%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.038.952,21	38.952,21	3,90%	3,77%
HAZ FII - ATCR11	1.043.098,36	0,00	0,00	1.043.642,97	544,61	0,05%	0,00%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.677,78	0,00	0,00	18.187,22	-490,56	-2,63%	-2,63%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.249.693,33	0,00	0,00	1.246.107,69	-3.585,64	-0,29%	-0,29%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.483.545,71	0,00	0,00	2.471.084,20	-12.461,51	-0,50%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	789.677,37	0,00	0,00	665.806,41	-123.870,96	-15,69%	-15,69%
				Total Renda Variável	37.018,25	0,50%	

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.007.057,53	0,00	5.000.000,00	11.371.829,47	1.364.771,94	9,09%	11,20%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.793.463,30	0,00	3.000.000,00	12.650.643,41	857.180,11	5,79%	6,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.612.415,71	8.061.910,19	0,00	10.358.303,96	683.978,06	7,07%	11,19%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.158.683,88	0,00	3.500.000,00	5.101.212,86	442.528,98	5,42%	5,91%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.080.623,30	0,00	0,00	2.326.067,51	245.444,21	11,80%	10,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.435.007,09	0,00	1.000.000,00	1.581.026,16	146.019,07	6,00%	6,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	10.166.739,62	7.071.827,20	3.181.294,03	86.381,61	0,85%	5,07%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.059.920,96	59.920,96	3,00%	12,43%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	902.842,53	0,00	0,00	947.118,24	44.275,71	4,90%	4,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.032.395,28	32.395,28	1,62%	16,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.603,17	16.603,17	1,66%	13,07%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.057.700,73	2.432.022,25	4.500.640,98	0,00	10.918,00	0,24%	0,98%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	276.124,14	0,00	0,00	286.947,59	10.823,45	3,92%	3,92%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	277.392,28	0,00	284.500,52	0,00	7.108,24	2,56%	5,74%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	762.170,33	0,00	0,00	768.315,73	6.145,40	0,81%	0,81%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.025,12	319.531,81	354.509,35	0,00	952,42	0,27%	4,82%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.681.756,09	0,00	127.457,77	1.510.548,49	<b>-43.749,83</b>	<b>-2,60%</b>	<b>-9,88%</b>
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.971.696,78</b>	<b>7,75%</b>	

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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	597.210,63	97.210,63	19,44%	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,00	319.478,06	0,00	382.254,14	62.776,08	19,65%	31,96%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.038.952,21	38.952,21	3,90%	18,08%
HAZ FII - ATCR11	1.031.282,60	0,00	0,00	1.043.642,97	12.360,37	1,20%	0,00%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.366,51	0,00	0,00	18.187,22	-179,29	-0,98%	-0,98%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.520.742,38	0,00	0,00	2.471.084,20	-49.658,18	-1,97%	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.386.189,58	0,00	0,00	1.246.107,69	-140.081,89	-10,11%	-10,11%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	887.741,88	0,00	0,00	665.806,41	-221.935,47	-25,00%	-25,00%
				Total Renda Variável	-200.555,54	-2,62%	