

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	17.870.794,68	10,53%	580	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	20.620.125,56	12,15%	342	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	9.580.501,90	5,65%	695	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	18.329.272,17	10,80%	949	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	737.808,16	0,43%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.751.055,42	8,10%	613	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.863.155,15	1,10%	964	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.402.898,55	0,83%	115	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	386.541,02	0,23%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.294.595,63	0,76%	107	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.732.140,90	5,15%	876	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.787.137,50	2,23%	1.198	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.358.890,39	6,10%	681	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.158.205,33	6,58%	443	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	970.592,75	0,57%	289	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.758.028,11	1,04%	376	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	412.202,71	0,24%	654	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.934.385,56	4,68%	670	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	878,90	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.428.733,68	0,84%	817	0,19%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	3.783.615,35	2,23%	86	0,33%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	6.716.404,86	3,96%	59.465	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

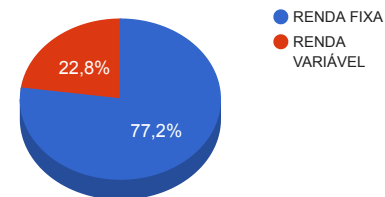
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.975.605,05	2,34%	34.677	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	156.605,24	0,09%			Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.854.230,30	3,45%	927	0,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	7.569.738,19	4,46%	165	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	555.832,54	0,33%	41	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	2.825.033,69	1,66%	730	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	2.311.667,99	1,36%	955	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.891.640,96	1,11%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
HAZ FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	758.070,30	0,45%		5,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	913.507,04	0,54%			Desenquadrado - RV
Total			169.689.895,58				

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

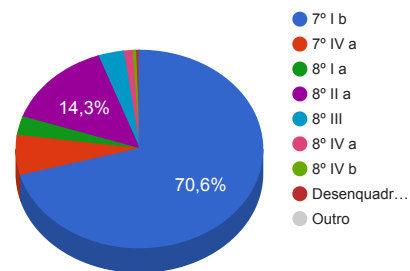
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	119.873.122,36	70,64%	0,00%	64,12%	100,00%	49.816.773,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.075.209,13	6,53%	0,00%	22,99%	40,00%	56.800.749,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	878,90	0,00%	0,00%	0,01%	5,00%	8.483.615,88
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	5.212.349,03	3,07%	0,00%	2,22%	15,00%	20.241.135,31
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	24.272.583,64	14,30%	0,00%	4,01%	15,00%	1.180.900,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.692.534,22	3,35%	0,00%	4,55%	10,00%	11.276.455,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.891.640,96	1,11%	0,00%	1,50%	5,00%	6.592.853,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	758.070,30	0,45%	0,00%	0,60%	5,00%	7.726.424,48
Desenquadrado - RV	0,00%	913.507,04	0,54%	0,00%	0,00%	0,00%	-913.507,04
Total Carteira		169.689.895,58					

RENDA FIXA	130.949.210,39	77,17%
RENDA VARIÁVEL	38.740.685,19	22,83%

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 "	119.873.122,36	70,64%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.075.209,13	6,53%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	878,90	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 "	5.212.349,03	3,07%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	24.272.583,64	14,30%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	5.692.534,22	3,35%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.891.640,96	1,11%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	758.070,30	0,45%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	913.507,04	0,54%	0,00%	0,00%
Total	169.689.895,58	100,00%	0,00	365,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	87.177.457,21	51,37%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.641.883,48	31,61%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	15.256.735,80	8,99%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	7.934.385,56	4,68%	0,00%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.891.640,96	1,11%	2,88%
BANCO J. SAFRA S/A	1.402.898,55	0,83%	0,00%
ROMA ASSET	913.507,04	0,54%	0,82%
Graphen Investimentos	758.070,30	0,45%	0,32%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	555.832,54	0,33%	0,00%
BRASIL PLURAL	878,90	0,00%	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
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%
IGC	2,54%	26,29%	6,80%	15,22%	28,11%	44,60%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2,80%	23,27%	6,44%	13,12%	25,46%	43,30%	1,00%	8,183%	11,04%
IPCA	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%	0,002	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%
Ibovespa	2,36%	22,00%	5,31%	11,28%	22,64%	44,29%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	3,09%	7,18%	3,90%	5,52%	8,72%	-	1,60%	1,241%	2,66%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,38%	31,84%	7,55%	21,58%	35,76%	63,60%	1,90%	7,006%	11,76%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1,26%	26,34%	2,51%	8,56%	31,71%	-	2,00%	8,065%	15,82%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	0,98%	-4,76%	-1,72%	-9,34%	-8,08%	-9,31%	3,00%	78,163%	9,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,90%	23,19%	2,00%	15,03%	31,41%	57,88%	2,50%	6,563%	9,78%
IMA Geral ex-C	0,91%	12,63%	1,90%	4,54%	12,63%	23,66%	-	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,35%	6,72%	1,56%	4,57%	9,07%	-	1,60%	2,455%	1,29%
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%

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
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-0,15%	-2,31%	-0,59%	-1,10%	-2,74%	-7,42%	4,00%	0,026%	0,39%
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%
120% do CDI	0,45%	7,19%	1,49%	3,37%	7,19%	15,51%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-22,11%	-84,57%	-52,28%	-70,39%	-84,57%	-94,51%	0,00%	-	-
IRF-M 1	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,55%	1,33%	3,22%	6,55%	13,80%	0,20%	0,067%	0,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	6,49%	1,31%	3,18%	6,49%	13,69%	0,10%	0,069%	0,40%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,37%	5,81%	1,10%	2,64%	5,81%	12,53%	0,20%	0,012%	0,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	5,74%	1,14%	2,65%	5,74%	12,44%	0,20%	0,013%	0,23%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	5,91%	1,20%	2,76%	5,91%	12,45%	0,20%	0,060%	0,24%

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

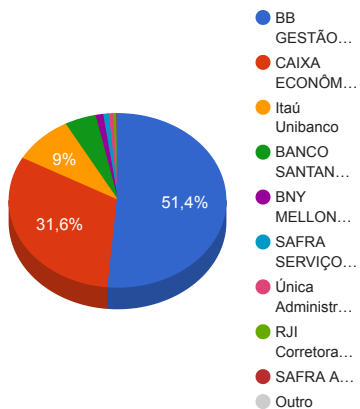
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	7,75%	38,53%	12,47%	19,53%	38,53%	54,76%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	7,56%	33,90%	11,66%	16,39%	33,90%	52,17%	1,00%	4,363%	11,99%
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10,21%	39,84%	14,53%	21,51%	39,84%	76,22%	2,50%	4,418%	12,54%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,81%	41,43%	13,36%	16,02%	41,43%	-	2,00%	4,042%	16,51%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	1,90%	4,076%	12,62%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,33%	7,98%	1,53%	3,54%	7,98%	-	1,60%	0,163%	1,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-4,63%	4,82%	0,82%	2,15%	4,82%	-	1,60%	5,284%	6,37%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	4,00%	-	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	3,00%	-	-
IBX-50	6,56%	29,15%	9,81%	13,17%	29,15%	47,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	7,09%	29,44%	10,57%	14,20%	29,44%	45,50%	0,70%	4,658%	12,51%
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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	1,20%	-	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

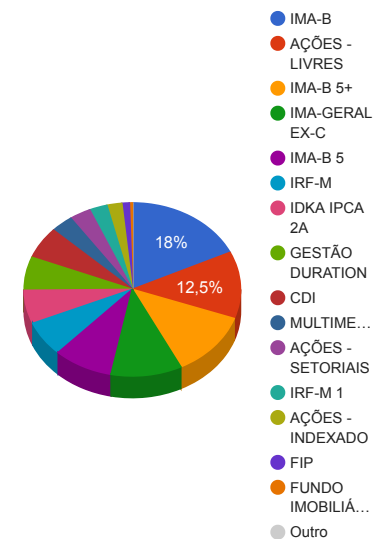
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	8,22%	28,55%	9,38%	13,11%	28,55%	50,46%	2,00%	4,166%	11,16%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	87.177.457,21	51,37%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.641.883,48	31,61%
Itaú Unibanco	15.256.735,80	8,99%
BANCO SANTANDER	7.934.385,56	4,68%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.891.640,96	1,11%
SAFRA SERVIÇOS DE ADMINISTRAÇÃO FIDUCIÁRIA LTDA	1.402.898,55	0,83%
Única Administradora	1.070.112,28	0,63%
RJI Corretora de Valores	758.070,30	0,45%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	555.832,54	0,33%
BRASIL PLURAL S.A. BANCO MÚLTIPLO	878,90	0,00%



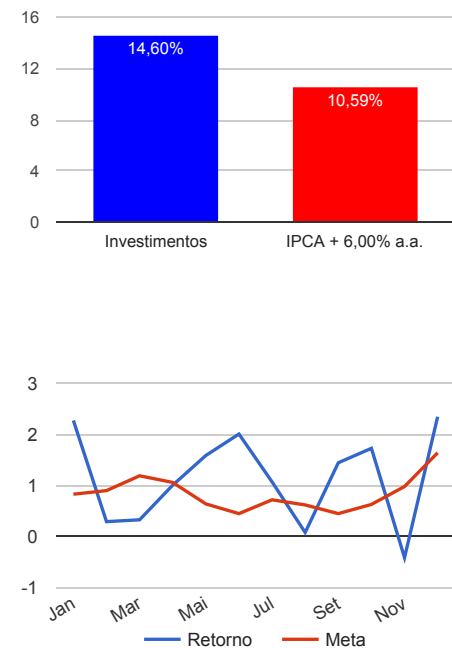
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	30.477.602,13	17,96%
AÇÕES - LIVRES	21.210.485,63	12,50%
IMA-B 5+	20.620.125,56	12,15%
IMA-GERAL EX-C	17.870.794,68	10,53%
IMA-B 5	15.045.651,05	8,87%
IRF-M	11.158.205,33	6,58%
IDKA IPCA 2A	10.595.296,05	6,24%
GESTÃO DURATION	10.551.094,65	6,22%
CDI	10.104.616,38	5,95%
MULTIMERCADO	5.692.534,22	3,35%
AÇÕES - SETORIAIS	5.404.338,73	3,18%
IRF-M 1	4.524.945,66	2,67%
AÇÕES - INDEXADO	3.783.615,35	2,23%
FIP	1.891.640,96	1,11%
FUNDO IMOBILIÁRIO	758.070,30	0,45%
FIDC - FECHADO	878,90	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	132.102.144,23	9.712.189,44	6.560.351,48	138.327.247,77	3.073.265,58	2,27%	0,83%	273,23%	1,34%
Fevereiro	138.327.247,77	6.550.453,39	6.002.000,76	139.283.275,24	407.574,84	0,29%	0,90%	32,77%	1,72%
Março	139.283.275,24	16.762.499,96	16.098.848,54	140.407.383,75	460.457,09	0,33%	1,19%	27,57%	2,65%
Abril	140.407.383,75	10.222.706,00	9.585.160,51	142.465.590,30	1.420.661,06	1,01%	1,06%	95,06%	1,35%
Mai	142.465.590,30	20.275.063,12	19.058.807,97	145.962.050,32	2.280.204,87	1,59%	0,64%	247,71%	1,87%
Junho	145.962.050,32	13.921.480,45	13.151.242,51	149.676.688,70	2.944.400,44	2,01%	0,45%	445,59%	1,75%
Julho	149.676.688,70	21.998.378,53	20.585.577,38	152.706.605,84	1.617.115,99	1,07%	0,72%	147,78%	1,35%
Agosto	152.706.605,84	10.873.360,61	9.543.323,80	154.161.927,02	125.284,37	0,08%	0,62%	13,11%	2,31%
Setembro	154.161.927,02	19.063.140,82	10.404.418,07	165.173.105,72	2.352.455,95	1,44%	0,45%	323,54%	1,60%
Outubro	165.173.105,72	13.260.961,30	12.049.943,49	169.257.864,03	2.873.740,50	1,73%	0,63%	272,52%	2,37%
Novembro	169.257.864,03	37.683.672,23	36.367.638,16	169.873.400,43	-700.497,67	-0,41%	0,98%	-42,08%	2,06%
Dezembro	169.873.400,43	19.625.986,75	23.791.851,08	169.689.895,58	3.982.359,48	2,34%	1,64%	142,74%	2,23%
Acumulado no ano					20.837.022,50	14,60%	10,59%	137,89%	

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.073.858,05	0,00	0,00	20.620.125,56	546.267,51	2,72%	4,09%	2,72%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.372.496,80	0,00	0,00	1.402.898,55	30.401,75	2,22%	3,12%	2,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.971.545,61	0,00	0,00	18.329.272,17	357.726,56	1,99%	2,80%	1,99%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.579.871,77	0,00	423.284,18	10.358.890,39	202.302,80	1,91%	2,77%	1,97%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.588.762,25	0,00	0,00	13.751.055,42	162.293,17	1,19%	1,00%	1,19%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.632.639,28	0,00	0,00	8.732.140,90	99.501,62	1,15%	0,75%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.842.890,86	0,00	0,00	1.863.155,15	20.264,29	1,10%	0,74%	1,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.949.114,23	0,00	2.268.708,11	17.870.794,68	190.388,56	0,95%	1,21%	0,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	383.028,14	0,00	0,00	386.541,02	3.512,88	0,92%	0,52%	0,92%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.284.545,04	0,00	0,00	1.294.595,63	10.050,59	0,78%	0,43%	0,78%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.090.485,07	0,00	0,00	11.158.205,33	67.720,26	0,61%	0,93%	0,61%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.234.813,71	434.520,23	6.159.237,66	9.580.501,90	70.405,62	0,45%	0,93%	0,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	734.851,03	0,00	0,00	737.808,16	2.957,13	0,40%	0,07%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.772.147,25	0,00	0,00	3.787.137,50	14.990,25	0,40%	0,07%	0,40%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	311.899,08	1.514.054,94	70.000,00	1.758.028,11	2.074,09	0,11%	0,06%	0,38%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.870.838,78	1.371.312,92	2.833.528,78	412.202,71	3.579,79	0,11%	0,01%	0,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.966.220,38	0,00	3.000.000,00	970.592,75	4.372,37	0,11%	0,01%	0,34%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.650.386,67	13.306.098,66	9.037.092,35	7.934.385,56	14.992,58	0,09%	0,01%	0,37%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	1.128,45	0,00	0,00	878,90	-249,55	-22,11%	-	-
Total Renda Fixa					1.803.552,27	1,32%	1,78%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6.868.659,99	0,00	0,00	7.569.738,19	701.078,20	10,21%	4,42%	10,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.380.304,95	0,00	0,00	5.854.230,30	473.925,35	8,81%	4,04%	8,81%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3.673.654,68	0,00	0,00	3.975.605,05	301.950,37	8,22%	4,17%	8,22%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.328.366,09	0,00	0,00	1.428.733,68	100.367,59	7,56%	4,36%	7,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.263.103,81	3.000.000,00	0,00	6.716.404,86	453.301,05	7,24%	4,08%	8,13%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.533.234,49	0,00	0,00	3.783.615,35	250.380,86	7,09%	4,66%	7,09%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	541.596,80	0,00	0,00	555.832,54	14.235,74	2,63%	3,42%	2,63%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	900.459,84	0,00	0,00	913.507,04	13.047,20	1,45%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.304.144,49	0,00	0,00	2.311.667,99	7.523,50	0,33%	0,16%	0,33%
HAZ FII - ATCR11	757.432,03	0,00	0,00	758.070,30	638,27	0,08%	-	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.892.162,73	0,00	0,00	1.891.640,96	-521,77	-0,03%	0,03%	-0,03%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	156.654,77	0,00	0,00	156.605,24	-49,53	-0,03%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.962.103,31	0,00	0,00	2.825.033,69	-137.069,62	-4,63%	5,28%	-4,63%
Total Renda Variável					2.178.807,21	5,96%	3,85%	

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+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.212.180,22	15.000.000,00	0,00	20.620.125,56	407.945,34	5,51%	3,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.367.963,26	1.674.000,00	5.568.708,11	17.870.794,68	397.539,53	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.954.127,90	6.000.000,00	0,00	18.329.272,17	375.144,27	3,20%	2,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.410.822,88	0,00	0,00	13.751.055,42	340.232,54	2,54%	2,54%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.092.725,19	1.430.000,00	423.284,18	10.358.890,39	259.449,38	2,92%	2,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.612.977,64	0,00	15.000.000,00	1.863.155,15	250.177,51	2,50%	2,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.509.302,31	0,00	0,00	8.732.140,90	222.838,59	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.959.481,93	0,00	0,00	11.158.205,33	198.723,40	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	9.175.313,07	6.390.406,35	6.159.237,66	9.580.501,90	174.020,14	1,59%	1,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.904.854,67	0,00	7.000.000,00	970.592,75	65.738,08	0,89%	1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.680.900,10	0,00	6.000.000,00	737.808,16	56.908,06	1,21%	1,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.738.225,14	0,00	0,00	3.787.137,50	48.912,36	1,31%	1,31%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.360.500,80	0,00	0,00	1.402.898,55	42.397,75	3,12%	3,12%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.264.163,72	0,00	0,00	1.294.595,63	30.431,91	2,41%	2,41%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.864.058,92	22.691.453,39	18.649.829,67	7.934.385,56	28.702,92	0,25%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	685.218,36	11.697.493,42	11.985.662,76	412.202,71	15.153,69	0,31%	1,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	377.422,95	0,00	0,00	386.541,02	9.118,07	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.588.452,89	1.587.267,12	1.422.710,35	1.758.028,11	5.018,45	0,56%	1,20%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	1.841,78	0,00	0,00	878,90	-962,88	-52,28%	-52,28%
Total Renda Fixa					2.927.489,11	2,18%	

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 (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6.609.274,43	0,00	0,00	7.569.738,19	960.463,76	14,53%	14,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.164.374,55	0,00	0,00	5.854.230,30	689.855,75	13,36%	13,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.016.580,57	4.100.000,00	0,00	6.716.404,86	599.824,29	12,28%	12,81%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	3.421.882,87	0,00	0,00	3.783.615,35	361.732,48	10,57%	10,57%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3.634.591,63	0,00	0,00	3.975.605,05	341.013,42	9,38%	9,38%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.279.544,93	0,00	0,00	1.428.733,68	149.188,75	11,66%	11,66%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	511.037,70	0,00	0,00	555.832,54	44.794,84	8,77%	8,77%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.276.777,16	0,00	0,00	2.311.667,99	34.890,83	1,53%	1,53%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	888.377,54	0,00	0,00	913.507,04	25.129,50	2,83%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.801.985,50	0,00	0,00	2.825.033,69	23.048,19	0,82%	0,82%
HAZ FII - ATCR11	757.674,72	0,00	0,00	758.070,30	395,58	0,05%	0,00%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	157.122,84	0,00	0,00	156.605,24	-517,60	-0,33%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.893.347,55	0,00	0,00	1.891.640,96	-1.706,59	-0,09%	-
Total Renda Variável					3.228.113,20	9,38%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.018.227,19	6.034.139,12	34.122,83	18.329.272,17	2.311.028,69	23,18%	22,59%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.611.480,37	1.440.211,53	423.284,18	10.358.890,39	1.730.482,67	22,81%	22,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.319.779,81	11.474.000,00	5.568.708,11	17.870.794,68	1.645.722,98	12,43%	13,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.181.086,03	0,00	0,00	13.751.055,42	1.569.969,39	12,89%	12,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.412.314,83	0,00	15.114.123,89	1.863.155,15	1.564.964,21	11,29%	11,19%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.667.123,62	15.570.000,00	0,00	20.620.125,56	1.383.001,94	32,86%	30,05%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.990.991,53	0,00	0,00	11.158.205,33	1.167.213,80	11,68%	11,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.852.451,97	0,00	0,00	8.732.140,90	879.688,93	11,20%	11,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	7.481.926,76	7.000.000,00	970.592,75	488.665,99	6,59%	11,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.406.706,49	0,00	8.056.025,13	737.808,16	387.126,80	6,31%	6,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.353.992,96	58.864.710,64	65.120.219,76	412.202,71	313.718,87	3,08%	5,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	5.166.456,84	2.000.000,00	7.473.846,58	0,00	307.389,74	4,29%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	15.461.017,06	6.159.237,66	9.580.501,90	278.722,50	2,64%	16,43%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1.136.518,08	0,00	0,00	1.402.898,55	266.380,47	23,44%	23,44%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.477.722,85	8.066.077,84	13.018.315,51	1.758.028,11	232.542,93	4,21%	5,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.554.982,02	0,00	1.000.000,00	3.787.137,50	232.155,48	6,39%	6,49%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.364.952,42	57.219.507,85	50.833.274,29	7.934.385,56	183.199,58	1,90%	5,81%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.257.523,69	0,00	68.280,21	1.294.595,63	105.352,15	8,65%	2,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	369.540,48	0,00	20.402,91	386.541,02	37.403,45	10,45%	10,46%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	5.697,60	0,00	0,00	878,90	-4.818,70	-84,57%	-84,57%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	2.779.845,05	0,00	2.739.322,69	0,00	-40.522,36	-1,46%	10,39%
Total Renda Fixa					15.039.389,51	12,74%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.534.023,49	2.000.000,00	0,00	7.569.738,19	2.035.714,70	40,14%	39,84%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.854.230,30	854.230,30	18,71%	41,43%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.130.308,88	1.000.000,00	0,00	3.975.605,05	845.296,17	27,00%	28,55%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	6.100.000,00	0,00	6.716.404,86	616.404,86	13,21%	45,27%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	995.566,10	2.238.301,80	0,00	3.783.615,35	549.747,45	27,05%	29,44%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.067.012,12	0,00	0,00	1.428.733,68	361.721,56	33,90%	33,90%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	886.946,36	0,00	570.000,00	555.832,54	238.886,18	33,05%	31,99%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	2.140.831,86	0,00	0,00	2.311.667,99	170.836,13	7,98%	7,98%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	2.695.241,12	0,00	0,00	2.825.033,69	129.792,57	4,82%	4,82%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.872.953,41	0,00	0,00	1.891.640,96	18.687,55	1,00%	-
HAZ FII - ATCR11	749.092,11	0,00	0,00	758.070,30	8.978,19	1,20%	0,00%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	160.605,20	0,00	0,00	156.605,24	-3.999,96	-2,49%	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	942.169,75	0,00	0,00	913.507,04	-28.662,71	-3,04%	-
Total Renda Variável					5.797.632,99	22,38%	