

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)

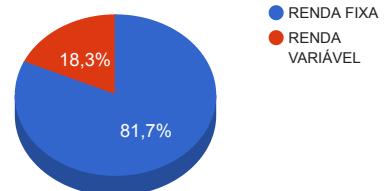
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtd. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	40.120.603,24	2,42%	342	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	28.511.538,70	1,72%	93	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	298.173.237,19	18,00%	695	3,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	16.193.389,37	0,98%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	184.332.471,86	11,13%	149	14,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	14.790.630,00	0,89%	20	21,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	25.293.186,00	1,53%	19	18,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	134.129.940,73	8,10%	876	1,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	295.502.757,61	17,84%	580	3,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	201.545,15	0,01%	670	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.611.603,18	1,00%	115	0,87%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	41.566.390,92	2,51%	654	1,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	258.008.309,59	15,58%	289	5,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	D+3	Não há	25.715.050,29	1,55%	59	7,65%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	72.655.334,19	4,39%	209	7,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	24.349.835,85	1,47%	165	0,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	57.293.226,94	3,46%	59.465	1,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	48.810.872,70	2,95%	51	5,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	26.330.167,34	1,59%	4.069	3,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	42.910.691,06	2,59%	26.794	0,66%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	4.469.970,00	0,27%		1,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>				<b>1.655.970.751,91</b>			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				103.270,91			Artigo 6º
							Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários
							Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8400

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

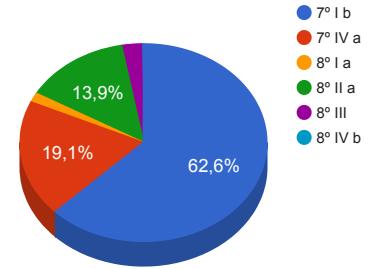
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	1.037.047.754,70	62,62%	25,00%	52,00%	80,00%	287.728.846,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	316.387.848,84	19,11%	5,00%	20,00%	40,00%	346.000.451,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	49.679.122,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	4,00%	66.238.830,08
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	25.715.050,29	1,55%	0,00%	7,00%	10,00%	139.882.024,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	229.439.437,02	13,86%	0,00%	15,00%	20,00%	101.754.713,36
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	42.910.691,06	2,59%	0,00%	2,00%	5,00%	39.887.846,54
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	1,00%	16.559.707,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.469.970,00	0,27%	0,00%	0,50%	1,00%	12.089.737,52
Total Carteira		1.655.970.751,91					

RENDA FIXA	1.353.538.874,45	81,74%
RENDA VARIÁVEL	302.535.148,37	18,27%

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 "	1.037.047.754,70	62,62%	25,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	316.387.848,84	19,10%	5,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	25.715.050,29	1,55%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	229.439.437,02	13,85%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	42.910.691,06	2,59%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	1,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.469.970,00	0,27%	0,00%	1,00%
Total	1.655.970.751,91	99,99%	30,00	174,00

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	556.024.620,57	33,57%	0,04%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	385.637.714,25	23,29%	0,08%
ITAÚ UNIBANCO	339.651.372,38	20,51%	0,02%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	210.864.184,35	12,73%	0,04%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	114.981.987,66	6,94%	0,01%
ITAÚ DTVM	48.810.872,70	2,95%	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%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,72%	30,05%	3,10%	7,66%	30,05%	49,74%	0,20%	4,094%	10,44%
IMA-B	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,01%	22,85%	2,85%	6,66%	22,85%	38,66%	0,20%	2,837%	7,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	13,85%	2,59%	5,36%	13,85%	25,93%	0,20%	1,035%	2,50%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	2,90%	2,39%	1,38%	2,90%	6,35%	0,20%	0,433%	4,13%
IPCA + 6,00% ao ano	1,64%	10,59%	3,28%	5,15%	10,59%	21,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,35%	4,18%	2,62%	1,80%	4,18%	8,60%	0,20%	0,166%	4,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	12,68%	2,51%	5,09%	12,68%	32,95%	0,20%	0,827%	2,00%
IMA-B 5	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,22%	12,90%	2,56%	5,35%	12,90%	23,79%	0,10%	1,000%	2,28%
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%
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%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	11,91%	1,19%	3,28%	11,91%	21,11%	0,40%	0,008%	2,85%
IMA Geral ex-C	0,91%	12,63%	1,90%	4,54%	12,63%	23,66%	-	-	-

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

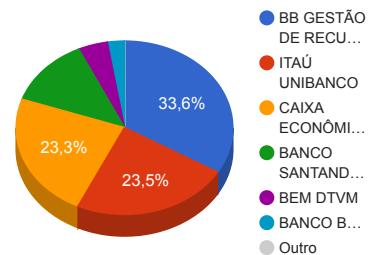
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	13,07%	1,81%	4,48%	13,07%	24,27%	0,30%	1,209%	3,22%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,37%	5,81%	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 definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

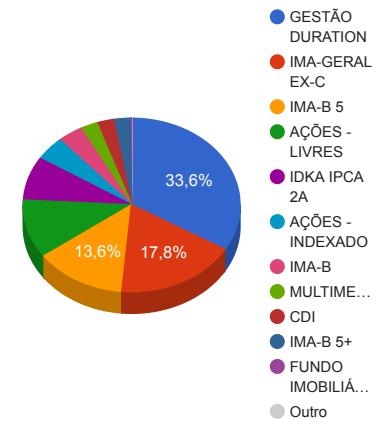
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	10,63%	35,98%	19,12%	21,76%	35,98%	43,62%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	9,96%	47,62%	34,23%	44,38%	47,62%	39,25%	1,20%	13,663%	16,78%
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10,21%	39,84%	14,53%	21,51%	39,84%	76,22%	2,50%	4,418%	12,54%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,27%	35,04%	12,81%	17,93%	35,04%	56,78%	1,50%	4,015%	11,98%
ITAÚ DYNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	1,90%	4,076%	12,62%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	7,81%	32,92%	11,38%	16,66%	32,92%	52,79%	2,00%	4,402%	10,54%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	7,19%	27,57%	9,30%	14,65%	27,57%	60,83%	1,50%	5,094%	9,13%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	6,91%	31,31%	10,39%	14,42%	31,31%	51,08%	0,50%	4,685%	12,30%
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%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	556.024.620,57	33,57%
ITAÚ UNIBANCO	388.462.245,08	23,46%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	385.637.714,25	23,29%
BANCO SANTANDER	210.864.184,35	12,73%
BEM DTVM	72.655.334,19	4,39%
BANCO BRADESCO	42.326.653,47	2,56%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	103.270,91	0,01%



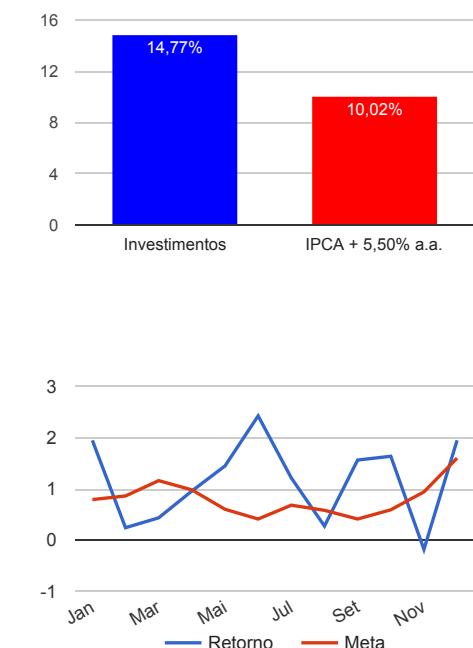
Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	556.181.546,78	33,58%
IMA-GERAL EX-C	295.502.757,61	17,84%
IMA-B 5	224.416.287,86	13,55%
AÇÕES - LIVRES	180.628.564,32	10,91%
IDKA IPCA 2A	134.129.940,73	8,10%
AÇÕES - INDEXADO	74.525.922,99	4,50%
IMA-B	61.316.531,25	3,70%
MULTIMERCADO	42.910.691,06	2,59%
CDI	41.767.936,07	2,52%
IMA-B 5+	40.120.603,24	2,42%
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.469.970,00	0,27%
DISP. FINANCEIRA	103.270,91	0,01%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.318.859.470,03	161.471.399,07	151.927.382,57	1.354.259.056,04	25.855.569,51	1,95%	0,79%	246,37%	1,19%
Fevereiro	1.354.259.056,04	152.907.674,76	143.288.887,74	1.367.150.993,59	3.273.150,53	0,24%	0,86%	27,98%	2,24%
Março	1.367.150.993,59	87.352.835,56	75.367.034,05	1.385.117.934,89	5.981.139,79	0,43%	1,16%	37,47%	2,90%
Abril	1.385.117.934,89	59.389.879,60	48.622.013,83	1.409.232.075,90	13.346.275,24	0,96%	0,98%	97,59%	1,64%
Maio	1.409.232.075,90	140.590.825,29	130.504.659,48	1.439.852.510,25	20.534.268,54	1,45%	0,60%	241,48%	2,05%
Junho	1.439.852.510,25	281.485.978,38	270.774.482,31	1.485.739.287,62	35.175.281,30	2,42%	0,41%	584,98%	2,17%
Julho	1.485.739.287,62	50.832.695,90	40.088.725,93	1.514.629.550,65	18.146.293,06	1,21%	0,68%	178,12%	1,59%
Agosto	1.514.629.550,65	35.721.341,47	25.212.860,13	1.529.289.190,42	4.151.158,43	0,27%	0,58%	47,01%	2,82%
Setembro	1.529.289.190,42	34.351.392,12	23.656.036,30	1.564.041.411,86	24.056.865,62	1,56%	0,41%	383,83%	1,54%
Outubro	1.564.041.411,86	33.510.445,32	24.443.227,33	1.598.839.262,13	25.730.632,28	1,64%	0,59%	277,06%	1,83%
Novembro	1.598.839.262,13	34.657.342,70	35.444.270,47	1.595.123.474,36	-2.928.860,00	-0,18%	0,94%	-19,53%	1,60%
Dezembro	1.595.123.474,36	97.696.253,54	68.484.870,51	1.655.970.751,91	31.635.894,52	1,95%	1,60%	121,55%	1,47%
Acumulado no ano				204.957.668,82	14,77%	10,02%	147,40%		

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.057.729,89	0,00	0,00	40.120.603,24	1.062.873,35	2,72%	4,09%	2,72%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	16.284.275,98	0,00	0,00	16.611.603,18	327.327,20	2,01%	2,84%	2,01%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.956.874,00	0,00	0,00	25.293.186,00	336.312,00	1,35%	0,17%	1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.176.564,43	0,00	0,00	28.511.538,70	334.974,27	1,19%	1,03%	1,19%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	197.020.228,01	0,00	15.000.000,00	184.332.471,86	2.312.243,85	1,17%	1,00%	1,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.018.204,96	0,00	0,00	16.193.389,37	175.184,41	1,09%	0,83%	1,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	117.703.106,33	15.003.352,56	0,00	134.129.940,73	1.423.481,84	1,07%	0,75%	1,15%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	292.696.380,58	0,00	0,00	295.502.757,61	2.806.377,03	0,96%	1,21%	0,96%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.676.500,00	0,00	0,00	14.790.630,00	114.130,00	0,78%	0,43%	0,78%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	287.002.547,01	9.453.000,00	0,00	298.173.237,19	1.717.690,18	0,58%	0,93%	0,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	257.124.464,49	0,00	0,00	258.008.309,59	883.845,10	0,34%	0,01%	0,34%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.888.513,71	0,00	3.700.000,00	201.545,15	13.031,44	0,34%	0,01%	0,37%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	28.218.191,12	62.972.963,81	49.714.352,56	41.566.390,92	89.588,55	0,10%	0,01%	0,35%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.512,07	0,00	7.517,95	0,00	5,88	0,08%	0,01%	0,31%
Total Renda Fixa					11.597.065,10	0,86%	0,88%	

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4.065.000,00	0,00	63.000,00	4.469.970,00	467.970,00	11,51%	13,66%	9,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	22.094.653,58	0,00	0,00	24.349.835,85	2.255.182,27	10,21%	4,42%	10,21%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	45.081.644,21	0,00	0,00	48.810.872,70	3.729.228,49	8,27%	4,01%	8,27%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	52.985.559,16	0,00	0,00	57.293.226,94	4.307.667,78	8,13%	4,08%	8,13%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	24.422.171,03	0,00	0,00	26.330.167,34	1.907.996,31	7,81%	4,40%	7,81%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	67.779.328,62	0,00	0,00	72.655.334,19	4.876.005,57	7,19%	5,09%	7,19%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	24.053.395,59	0,00	0,00	25.715.050,29	1.661.654,70	6,91%	4,68%	6,91%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	31.810.629,59	10.266.937,17	0,00	42.910.691,06	833.124,30	1,98%	1,10%	2,09%
Total Renda Variável					20.038.829,42	7,09%	4,14%	

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	290.246.611,22	0,00	0,00	295.502.757,61	5.256.146,39	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	264.700.784,07	28.529.289,05	0,00	298.173.237,19	4.943.164,07	1,78%	1,80%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	194.440.790,47	0,00	15.000.000,00	184.332.471,86	4.891.681,39	2,52%	2,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	116.328.495,05	15.003.352,56	307.000,00	134.129.940,73	3.105.093,12	2,53%	2,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	254.965.313,72	0,00	0,00	258.008.309,59	3.042.995,87	1,19%	1,19%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.913.901,53	0,00	0,00	40.120.603,24	1.206.701,71	3,10%	3,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.792.753,66	0,00	0,00	28.511.538,70	718.785,04	2,59%	2,59%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.646.518,00	0,00	0,00	25.293.186,00	646.668,00	2,62%	2,62%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	16.150.767,93	0,00	0,00	16.611.603,18	460.835,25	2,85%	2,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.796.310,10	0,00	0,00	16.193.389,37	397.079,27	2,51%	2,51%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.445.030,00	0,00	0,00	14.790.630,00	345.600,00	2,39%	2,39%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	27.247.826,08	112.064.462,78	98.011.850,36	41.566.390,92	265.952,42	0,44%	1,14%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.012.887,92	0,00	14.935.000,00	201.545,15	123.657,23	1,07%	1,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.458,51	0,00	7.517,95	0,00	59,44	0,80%	1,03%
Total Renda Fixa					25.404.419,20	1,93%	

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	50.787.140,87	0,00	0,00	57.293.226,94	6.506.086,07	12,81%	12,81%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	66.470.835,27	0,00	0,00	72.655.334,19	6.184.498,92	9,30%	9,30%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	43.267.225,96	0,00	0,00	48.810.872,70	5.543.646,74	12,81%	12,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	21.260.279,18	0,00	0,00	24.349.835,85	3.089.556,67	14,53%	14,53%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	23.639.899,33	0,00	0,00	26.330.167,34	2.690.268,01	11,38%	11,38%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	23.293.780,55	0,00	0,00	25.715.050,29	2.421.269,74	10,39%	10,39%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	31.296.742,44	10.266.937,17	0,00	42.910.691,06	1.347.011,45	3,65%	3,77%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.330.060,00	0,00	111.000,00	4.469.970,00	1.250.910,00	37,84%	34,23%
Total Renda Variável						29.033.247,60	10,75%

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	115.347.332,51	161.199.380,97	15.000.000,00	295.502.757,61	33.956.044,13	12,78%	13,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	205.853.691,00	76.591.007,87	50.000.000,00	258.008.309,59	25.563.610,72	11,62%	11,91%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	176.402.174,84	235.082,37	15.000.000,00	184.332.471,86	22.695.214,65	12,85%	12,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	279.156.857,26	0,00	298.173.237,19	19.016.379,93	10,05%	16,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	100.387.951,10	22.171.352,56	500.000,00	134.129.940,73	12.070.637,07	11,08%	11,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	195.629.688,40	1.824.279,25	206.704.079,58	0,00	9.250.111,93	4,70%	11,19%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	36.515.826,55	0,00	40.120.603,24	3.604.776,69	12,25%	30,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.360.099,22	0,00	1.393.533,64	28.511.538,70	3.544.973,12	13,86%	13,85%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.278.850,00	0,00	1.368.694,51	25.293.186,00	2.383.030,51	10,15%	4,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	24.617.115,91	50.000.000,00	76.508.292,63	0,00	1.891.176,72	4,39%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.146.640,93	0,00	815.346,99	16.193.389,37	1.862.095,43	12,68%	12,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	15.098.017,25	0,00	16.611.603,18	1.513.585,93	10,03%	22,85%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	39.911.337,10	353.972.399,66	353.759.665,36	41.566.390,92	1.442.319,52	2,51%	5,74%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.373.490,00	0,00	778.169,18	14.790.630,00	1.195.309,18	8,59%	2,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	207.083.342,98	0,00	208.056.604,96	0,00	973.261,98	2,68%	6,49%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.437.460,08	348.513,85	18.410.106,37	201.545,15	825.677,59	5,77%	5,81%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	47.417.388,21	0,00	48.098.017,24	0,00	680.629,03	2,60%	6,48%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7.456.711,89	0,00	7.813.656,79	0,00	356.944,90	4,79%	16,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.179.697,75	0,00	10.498.430,41	0,00	318.732,66	3,13%	-
CASAN SANEAMENTO FIDC SÊNIOR	5.379.379,20	0,00	5.679.477,41	0,00	300.098,21	5,92%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	269.029,01	0,00	281.154,71	0,00	12.125,70	4,51%	5,72%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	13.447.000,00	13.449.738,97	0,00	2.738,97	0,04%	4,82%

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,00	3.400.000,00	3.400.981,90	0,00	981,90	3,03%	5,07%
Total Renda Fixa					143.460.456,47	12,10%	

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	42.920.000,00	0,00	57.293.226,94	14.373.226,94	32,86%	45,27%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	25.493.994,14	33.000.000,00	0,00	72.655.334,19	14.161.340,05	28,24%	27,57%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	40.000.000,00	0,00	48.810.872,70	8.810.872,70	22,03%	35,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	17.412.809,31	0,00	0,00	24.349.835,85	6.937.026,54	39,84%	39,84%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	19.809.380,42	0,00	0,00	26.330.167,34	6.520.786,92	32,92%	32,92%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	19.583.826,03	0,00	0,00	25.715.050,29	6.131.224,26	31,31%	31,31%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	40.088.346,12	0,00	42.910.691,06	2.822.344,94	11,62%	18,08%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.028.080,00	0,00	298.500,00	4.469.970,00	1.740.390,00	60,86%	47,62%
Total Renda Variável					61.497.212,35	32,98%	