

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.459.208,77	1,55%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.596.029,07	2,75%	876	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.978.103,67	2,09%	259	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	823.916,06	0,87%	342	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.596.299,37	12,28%	681	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.766.952,99	8,22%	695	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	14.462.948,53	15,31%	118	1,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	283.223,86	0,30%	314	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.396.038,97	3,60%	923	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.832.250,37	13,59%	949	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.812.059,41	2,98%	964	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	276.529,10	0,29%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.780.611,79	10,36%	273	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	912.730,27	0,97%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.129.986,54	4,37%	167	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.579,12	0,01%	115	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.844.814,45	8,31%	118	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	405.802,10	0,43%	300	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.828,31	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.834.890,49	1,94%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	787.331,49	0,83%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.323.782,56	1,40%	209	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

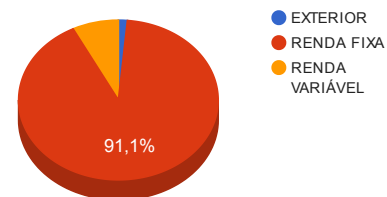
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%			Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.039.409,90	3,22%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	2.720.394,63	2,88%		7,69%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	D+4	Não há	1.362.156,91	1,44%	67	0,21%	Artigo 9º - A, Inciso III
		Total	94.438.878,74				

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

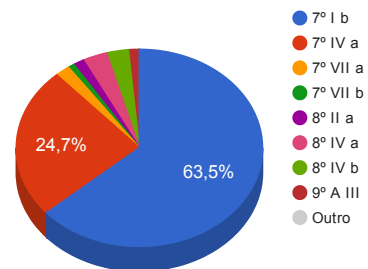
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	60.007.031,07	63,54%	15,00%	25,00%	70,00%	6.100.184,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	56.663.327,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	23.357.053,37	24,73%	10,00%	30,00%	40,00%	14.418.498,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.841.718,80	1,95%	2,00%	4,00%	5,00%	2.880.225,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	787.331,49	0,83%	0,00%	1,00%	5,00%	3.934.612,45
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.323.782,56	1,40%	2,00%	10,00%	20,00%	17.563.993,19
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	2,00%	10,00%	10,00%	9.443.887,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.039.409,90	3,22%	2,00%	5,00%	5,00%	1.682.534,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.720.394,63	2,88%	2,00%	5,00%	5,00%	2.001.549,31
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.362.156,91	1,44%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.362.156,91
Total Carteira		94.438.878,74					

EXTERIOR	1.362.156,91	1,44%
RENDA FIXA	85.993.134,73	91,06%
RENDA VARIÁVEL	7.083.587,10	7,50%

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 "	60.007.031,07	63,54%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	23.357.053,37	24,73%	10,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.841.718,80	1,95%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	787.331,49	0,83%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.323.782,56	1,40%	2,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.039.409,90	3,22%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.720.394,63	2,88%	2,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	1.362.156,91	1,44%	0,00%	0,00%
Total	94.438.878,74	100,00%	40,00	240,00

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
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	30.152.016,97	31,93%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.911.891,28	31,67%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.796.856,29	26,26%	0,00%
Foco DTVM	3.039.409,90	3,22%	-
Reditus Investimentos	2.720.394,63	2,88%	-
PETRA Capital	1.834.890,49	1,94%	0,03%
RJI CORRETORA DE VALORES	1.189.259,37	1,26%	0,07%
SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS	787.331,49	0,83%	8,35%
BRASIL PLURAL	6.828,32	0,01%	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%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	22,56%	2,79%	6,57%	22,56%	38,29%	0,30%	2,761%	6,91%
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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,99%	22,59%	2,70%	6,52%	22,59%	38,33%	0,20%	2,796%	6,96%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,98%	22,53%	2,77%	6,55%	22,53%	38,05%	0,20%	2,770%	6,90%
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%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,50%	8,62%	2,83%	4,18%	8,62%	17,28%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-9,13%	-0,53%	-7,00%	-9,13%	-15,37%	0,15%	0,037%	6,04%
IMA-B 5	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,06%	4,90%	2,14%	6,00%	4,90%	-13,89%	0,70%	4,122%	5,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,23%	12,92%	2,54%	5,35%	12,92%	23,79%	0,20%	1,036%	2,42%
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%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,35%	3,92%	0,70%	1,47%	3,92%	-7,94%	0,70%	1,165%	4,50%
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%

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
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%	-	-	-
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%
IRF-M 1+	0,72%	14,24%	2,10%	5,44%	14,24%	28,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	13,89%	2,07%	5,34%	13,89%	27,90%	0,20%	1,348%	3,64%
CDI + 3,50% ao ano	0,66%	9,68%	2,13%	4,64%	9,68%	20,78%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4,82%	-4,16%	16,93%	39,49%	-4,16%	-71,09%	0,20%	-	51,58%
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%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,48%	1,31%	3,18%	6,48%	13,63%	0,20%	0,070%	0,39%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,25%	3,68%	0,77%	1,76%	3,68%	-15,77%	1,00%	0,037%	0,13%
Selic	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,77%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,37%	5,83%	1,16%	2,70%	5,83%	12,53%	0,20%	0,012%	0,23%

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

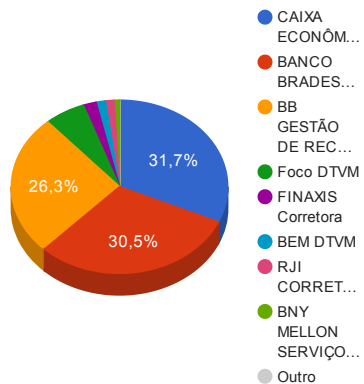
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	10,63%	35,98%	19,12%	21,76%	35,98%	43,62%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-7,70%	-23,40%	-25,00%	-7,70%	-15,30%	1,50%	0,000%	31,24%
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	7,19%	27,57%	9,30%	14,65%	27,57%	60,83%	1,50%	5,094%	9,13%
IPCA + 8,00% ao ano	1,80%	12,68%	3,78%	6,16%	12,68%	26,18%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,12%	-	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

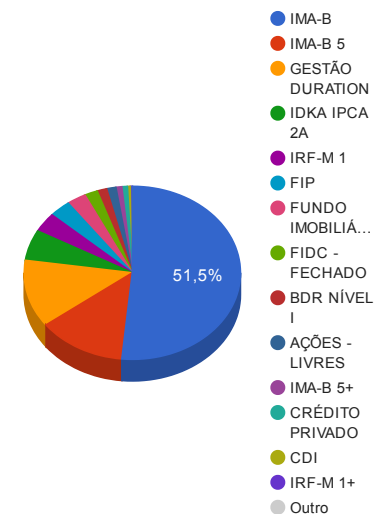
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	-1,52%	35,67%	5,85%	16,89%	35,67%	51,98%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	-1,76%	34,46%	5,54%	16,36%	34,46%	48,15%	0,70%	4,693%	15,18%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.911.891,28	31,67%
BANCO BRADESCO	28.828.234,41	30,53%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.796.856,29	26,26%
Foco DTVM	5.759.804,53	6,10%
FINAXIS Corretora	1.834.890,49	1,94%
BEM DTVM	1.323.782,56	1,40%
RJI CORRETORA DE VALORES	1.189.259,37	1,26%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	787.331,49	0,83%
GENIAL INVESTIMENTOS	6.828,31	0,01%
ÚNICA ADMINISTRADORA	0,01	0,00%



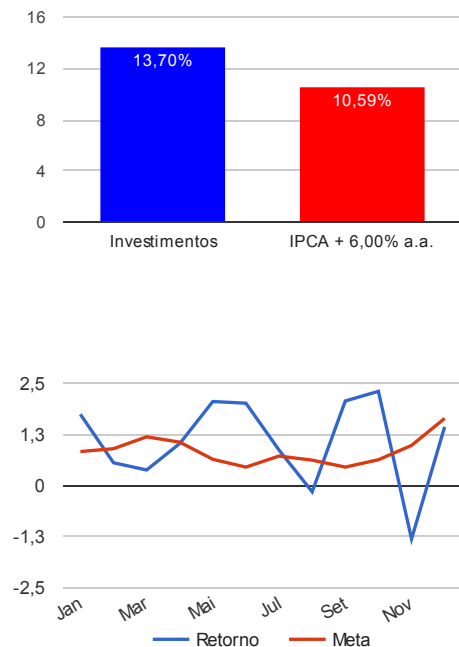
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	48.678.689,18	51,55%
IMA-B 5	12.430.112,79	13,16%
GESTÃO DURATION	11.896.939,53	12,60%
IDKA IPCA 2A	5.408.088,48	5,73%
IRF-M 1	3.437.312,44	3,64%
FIP	3.039.409,90	3,22%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.720.394,63	2,88%
FIDC - FECHADO	1.841.718,80	1,95%
BDR NÍVEL I	1.362.156,91	1,44%
AÇÕES - LIVRES	1.323.782,56	1,40%
IMA-B 5+	823.916,06	0,87%
CRÉDITO PRIVADO	787.331,49	0,83%
CDI	405.802,10	0,43%
IRF-M 1+	283.223,86	0,30%
MULTIMERCADO	0,01	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	78.828.877,72	1.233.485,47	1.621.374,10	79.813.128,50	1.372.139,41	1,74%	0,83%	209,31%	1,92%
Fevereiro	79.813.128,50	10.743.516,43	10.644.425,35	80.356.708,12	444.488,54	0,56%	0,90%	62,11%	1,51%
Março	80.356.708,12	2.401.763,05	1.537.803,44	81.528.777,96	308.110,23	0,38%	1,19%	31,78%	2,58%
Abril	81.528.777,96	2.071.482,80	1.708.070,68	82.732.328,13	840.138,05	1,03%	1,06%	96,83%	1,21%
Mai	82.732.328,13	1.741.188,91	1.680.280,94	84.493.611,71	1.700.375,61	2,05%	0,64%	320,57%	1.499.950,64%
Junho	84.493.611,71	4.824.713,34	3.348.779,30	87.698.989,88	1.729.444,13	2,01%	0,45%	446,71%	1,75%
Julho	87.698.989,88	1.585.010,81	1.737.833,64	88.304.917,52	758.750,47	0,87%	0,72%	119,46%	1,13%
Agosto	88.304.917,52	1.940.905,02	1.745.404,14	88.364.321,13	-136.097,27	-0,15%	0,62%	-24,78%	2,09%
Setembro	88.364.321,13	2.608.906,92	1.756.267,12	91.060.972,90	1.844.011,97	2,07%	0,45%	462,85%	1,59%
Outubro	91.060.972,90	1.839.636,10	1.781.573,04	93.217.497,23	2.098.461,27	2,30%	0,63%	363,38%	2,45%
Novembro	93.217.497,23	0,00	1.821.829,14	90.177.292,84	-1.218.375,25	-1,31%	0,98%	-133,93%	1,85%
Dezembro	90.177.292,84	1.222.752,92	6.240.231,76	86.452.787,15	1.292.973,15	1,43%	1,64%	87,30%	2,01%
Acumulado no ano					11.034.420,31	13,70%	10,59%	129,40%	

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(%)	
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.514,52	0,00	0,00	6.828,31	313,79	4,82%	-	-	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	802.088,91	0,00	0,00	823.916,06	21.827,15	2,72%	4,09%	2,72%	
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	894.314,74	0,00	0,00	912.730,27	18.415,53	2,06%	4,12%	2,06%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.587.805,56	0,00	0,00	9.780.611,79	192.806,23	2,01%	2,76%	2,01%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.449,48	0,00	0,00	6.579,12	129,64	2,01%	2,84%	2,01%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.371.756,56	0,00	0,00	11.596.299,37	224.542,81	1,97%	2,77%	1,97%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	14.492.539,78	1.987.695,47	2.293.225,01	14.462.948,53	275.938,29	1,67%	2,77%	1,98%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.991.488,00	1.987.695,48	1.376.319,02	12.832.250,37	229.385,91	1,64%	2,80%	1,99%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.749.575,15	0,00	0,00	7.844.814,45	95.239,30	1,23%	1,04%	1,23%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.355.567,76	0,00	0,00	3.396.038,97	40.471,21	1,21%	1,01%	1,21%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.566.447,65	0,00	0,00	2.596.029,07	29.581,42	1,15%	0,75%	1,15%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.762.938,77	0,00	987.464,98	2.812.059,41	36.585,62	0,97%	0,74%	1,10%	
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.095.294,27	0,00	0,00	4.129.986,54	34.692,27	0,85%	1,09%	0,85%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	281.255,05	0,00	0,00	283.223,86	1.968,81	0,70%	1,35%	0,70%	
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.721.136,21	0,00	0,00	7.766.952,99	45.816,78	0,59%	0,93%	0,59%	
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.040.738,04	0,00	70.558,98	1.978.103,67	7.924,61	0,39%	0,07%	0,40%	
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	404.319,27	0,00	0,00	405.802,10	1.482,83	0,37%	0,01%	0,37%	
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	275.566,10	0,00	0,00	276.529,10	963,00	0,35%	1,17%	0,35%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.308.537,97	0,00	855.264,87	1.459.208,77	5.935,67	0,26%	0,07%	0,40%	
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	785.387,32	0,00	0,00	787.331,49	1.944,17	0,25%	0,04%	0,25%	
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	798.761,95	0,00	798.516,86	0,00	-245,09	-0,03%	0,99%	0,54%	
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.837.699,18	0,00	0,00	1.834.890,49	-2.808,69	-0,15%	0,04%	-0,16%	
Total Renda Fixa						1.262.911,26	1,45%	1,98%	

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(%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.234.941,58	0,00	0,00	1.323.782,56	88.840,98	7,19%	5,09%	7,19%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.639.075,48	0,00	0,00	2.720.394,63	81.319,15	3,08%	0,00%	0,00%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.040.251,47	0,00	0,00	3.039.409,90	-841,57	-0,03%	-	-
Total Renda Variável					169.318,56	2,45%	1,67%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.386.552,81	0,00	0,00	1.362.156,91	-24.395,90	-1,76%	4,69%	-1,76%
				Total Exterior	-24.395,90	-1,76%	4,69%	

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	15.295.198,96	1.987.695,47	3.231.874,18	14.462.948,53	411.928,28	2,42%	2,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.826.075,50	1.987.695,48	2.314.968,19	12.832.250,37	333.447,58	2,28%	2,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.282.743,10	0,00	0,00	11.596.299,37	313.556,27	2,78%	2,78%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.514.749,74	0,00	0,00	9.780.611,79	265.862,05	2,79%	2,79%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.650.694,87	0,00	0,00	7.844.814,45	194.119,58	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.629.836,37	0,00	0,00	7.766.952,99	137.116,62	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.760.981,23	0,00	1.033.963,50	2.812.059,41	85.041,68	2,27%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.312.607,88	0,00	0,00	3.396.038,97	83.431,09	2,52%	2,52%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.056.640,53	0,00	0,00	4.129.986,54	73.346,01	1,81%	1,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.529.780,09	0,00	0,00	2.596.029,07	66.248,98	2,62%	2,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.274.262,63	919.818,05	1.766.179,44	1.459.208,77	31.307,53	1,05%	1,33%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	799.135,25	0,00	0,00	823.916,06	24.780,81	3,10%	3,10%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.151.685,42	919.818,05	117.057,50	1.978.103,67	23.657,70	1,15%	1,31%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	893.633,59	0,00	0,00	912.730,27	19.096,68	2,14%	2,14%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.691.315,92	0,00	1.709.431,43	0,00	18.115,51	1,05%	1,75%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	781.343,89	0,00	0,00	787.331,49	5.987,60	0,77%	0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	277.493,58	0,00	0,00	283.223,86	5.730,28	2,07%	2,07%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	401.136,26	0,00	0,00	405.802,10	4.665,84	1,16%	1,16%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	274.595,36	0,00	0,00	276.529,10	1.933,74	0,70%	0,70%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.839,66	0,00	0,00	6.828,31	988,65	16,93%	16,93%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.396,60	0,00	0,00	6.579,12	182,52	2,85%	2,85%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.844.610,15	0,00	0,00	1.834.890,49	-9.719,66	-0,53%	-0,53%
Total Renda Fixa					2.090.825,34	2,40%	

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 (%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.211.100,79	0,00	0,00	1.323.782,56	112.681,77	9,30%	9,30%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.648.129,96	0,00	0,00	2.720.394,63	72.264,67	2,73%	-23,40%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.041.974,59	0,00	0,00	3.039.409,90	-2.564,69	-0,08%	-
				Total Renda Variável	182.381,75	3,10%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.290.697,78	0,00	0,00	1.362.156,91	71.459,13	5,54%	5,54%
				Total Exterior	71.459,13	5,54%	

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 (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.455.539,98	0,00	0,00	11.596.299,37	2.140.759,39	22,64%	22,64%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.148.290,79	12.688.178,41	3.231.874,18	14.462.948,53	1.858.353,51	20,34%	22,53%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.233.099,34	12.047.598,42	4.023.038,87	12.832.250,37	1.574.591,48	20,04%	22,59%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.347.253,61	0,00	9.780.611,79	1.433.358,18	17,17%	22,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.670.769,51	0,00	0,00	7.766.952,99	1.096.183,48	16,43%	16,43%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	6.947.026,04	0,00	0,00	7.844.814,45	897.788,41	12,92%	12,92%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.673.279,43	0,00	0,00	4.129.986,54	456.707,11	12,43%	12,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.876.816,20	0,00	1.465.355,22	2.812.059,41	400.598,43	11,03%	11,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	799.760,38	2.240.392,92	0,00	3.396.038,97	355.885,67	12,96%	12,85%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.250.728,72	919.818,05	8.023.413,51	1.459.208,77	312.075,51	6,13%	6,55%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.334.501,22	0,00	0,00	2.596.029,07	261.527,85	11,20%	11,20%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.101.060,78	919.818,05	7.291.867,32	1.978.103,67	249.092,16	6,14%	6,48%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.343.963,29	0,00	2.587.564,99	0,00	243.601,70	10,78%	11,60%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	633.529,95	0,00	0,00	823.916,06	190.386,11	30,05%	30,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.053.896,69	0,00	840.140,47	283.223,86	69.467,64	13,12%	13,89%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	870.062,12	0,00	0,00	912.730,27	42.668,15	4,90%	4,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.655.505,58	0,00	4.695.300,51	0,00	39.794,93	0,85%	6,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.623.919,58	0,00	3.651.953,10	0,00	28.033,52	0,77%	5,74%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	759.378,66	0,00	0,00	787.331,49	27.952,83	3,68%	3,68%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	383.437,27	0,00	0,00	405.802,10	22.364,83	5,83%	5,83%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.224.951,97	0,00	2.240.392,72	0,00	15.440,75	0,69%	5,66%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	266.098,62	0,00	0,00	276.529,10	10.430,48	3,92%	3,92%

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5.355,21	0,00	0,00	6.579,12	1.223,91	22,85%	22,85%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.124,99	0,00	0,00	6.828,31	-296,68	-4,16%	-4,16%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.019.239,65	0,00	0,00	1.834.890,49	-184.349,16	-9,13%	-9,13%
Total Renda Fixa					11.543.640,19	14,99%	

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 (%)
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.037.722,01	0,00	0,00	1.323.782,56	286.060,55	27,57%	27,57%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	935.173,09	0,00	962.655,16	0,00	27.482,07	2,94%	6,14%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.049.663,66	0,00	0,00	3.039.409,90	-10.253,76	-0,34%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.083.767,94	0,00	0,00	2.720.394,63	-363.373,31	-11,78%	-7,70%
Total Renda Variável					-60.084,45	3,63%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.013.064,88	0,00	0,00	1.362.156,91	349.092,03	34,46%	34,46%
				Total Exterior	349.092,03	34,46%	