

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 | 1.764.644,47 | 11,72% | 695 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 1.609.666,18 | 10,69% | 613 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA... | D+0 | Não há | 1.337.742,46 | 8,88% | 964 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA... | D+0 | Não há | 1.203.527,38 | 7,99% | 949 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 1.021.632,06 | 6,78% | 1.361 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 1.469.776,04 | 9,76% | 923 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 3.187,26 | 0,02% | 64 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1 | Não há | 544.851,79 | 3,62% | 876 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 43.973,47 | 0,29% | 1.198 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 140.460,79 | 0,93% | 94 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 173.925,73 | 1,15% | 180 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1 | Não há | 558.325,63 | 3,71% | 289 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 82.698,57 | 0,55% | 324 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 583.980,26 | 3,88% | 167 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA... | D+3 | Não há | 699.779,30 | 4,65% | 495 | 0,22% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 592.552,93 | 3,93% | 165 | 0,02% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| ITAÚ DUNA MIS FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 370.722,26 | 2,46% | 59.465 | 0,01% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 597.405,33 | 3,97% | 2.570 | 0,12% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 733.431,13 | 4,87% | 209 | 0,08% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | D+4 | Não há | 1.267.756,45 | 8,42% | 18.924 | 0,05% | Artigo 8º, Inciso III |

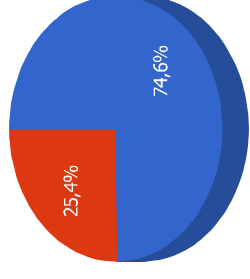
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|--|---------|----------|----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | D+4 | Não há | 259.029,62 | 1,72% | 26.794 | 0,00% | Artigo 8º, Inciso III |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 15.059.069,11 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2019)

| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2019 | | | GAP Superior |
|-----------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|--------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b' | 100,00% | 8.999.001,11 | 59,76% | 15,00% | 25,00% | 70,00% | 1.542.347,27 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 60,00% | 9.035.441,47 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a' | 40,00% | 2.239.170,28 | 14,87% | 10,00% | 30,00% | 40,00% | 3.784.457,36 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'a' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 15,00% | 2.258.860,37 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'a' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 752.953,46 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 752.953,46 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'c' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 752.953,46 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 11.238.171,39 | 74,63% | 30,00% | 70,00% | 200,00% | |

Distribuição por Segmento

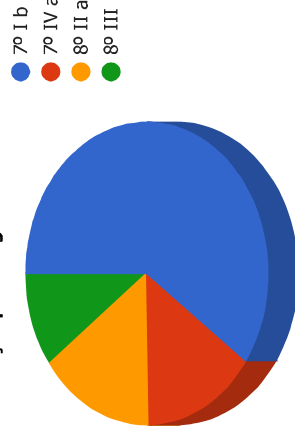


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA 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, Alinea 'a' | 20,00% | 2.294.111,65 | 15,23% | 5,00% | 10,00% | 20,00% | 717.702,17 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 1.526.786,07 | 10,14% | 7,00% | 10,00% | 10,00% | -20.879,16 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 752.953,46 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'b' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 752.953,46 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 3.820.897,72 | 25,37% | 16,00% | 30,00% | 40,00% | |

Distribuição por Artigos



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

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|--------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 9.844.452,47 | 65,37 | 0,00 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 2.198.491,44 | 14,60 | 0,00 |
| ITAÚ UNIBANCO | 1.524.788,08 | 10,13 | 0,00 |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 1.491.337,12 | 9,90 | 0,00 |

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, Alinea ' b ' | 8.999.001,11 | 59,76 | 15,00 | 70,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alinea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alinea ' a ' | 2.239.170,28 | 14,87 | 10,00 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alinea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso VIII, Alinea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso VIII, Alinea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso III, Alinea ' a ' | 2.294.111,65 | 15,23 | 5,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 1.526.786,07 | 10,14 | 7,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 2,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 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 |
|---|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 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% | 0,01% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,10% | 11,19% | 2,40% | 4,92% | 11,19% | 21,53% | 0,01% | 0,02% |

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,42% | 6,76% | 1,38% | 3,33% | 6,76% | 14,21% | - | - |
| ITAU SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 0,40% | 6,53% | 1,33% | 3,23% | 6,53% | 13,69% | 0,00% | 0,00% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,40% | 6,49% | 1,31% | 3,18% | 6,49% | 13,69% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,40% | 6,55% | 1,33% | 3,22% | 6,55% | 13,80% | 0,00% | 0,00% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,24% | 13,15% | 2,62% | 5,47% | 13,15% | 24,32% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,21% | 12,85% | 2,52% | 5,31% | 12,85% | 23,77% | 0,01% | 0,02% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1,19% | 12,89% | 2,54% | 5,34% | 12,89% | 23,78% | 0,01% | 0,02% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IMA-B (Benchmark) | 2,01% | 22,95% | 2,85% | 6,72% | 22,95% | 39,01% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,99% | 22,59% | 2,70% | 6,52% | 22,59% | 38,33% | 0,03% | 0,07% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| CDI (Benchmark) | 0,37% | 5,96% | 1,24% | 2,80% | 5,96% | 12,76% | - | - |
| BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA | 0,35% | 5,68% | 1,17% | 2,66% | 5,68% | 12,16% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA | 0,31% | 5,07% | 1,03% | 2,36% | 5,07% | 10,90% | 0,00% | 0,00% |

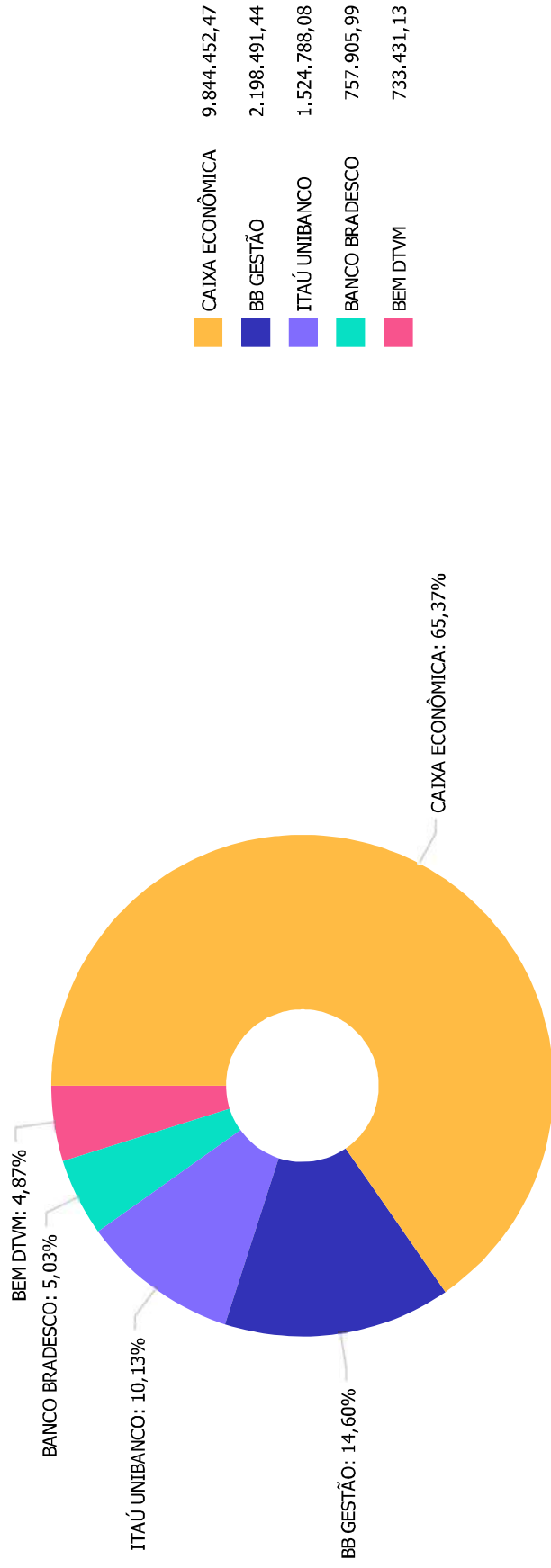
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| IPCA (Benchmark) | 1,15% | 4,31% | 1,77% | 2,03% | 4,31% | 8,21% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL - ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,34% | 11,91% | 1,19% | 3,28% | 11,91% | 21,11% | 0,00% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,59% | 16,43% | 1,80% | 4,97% | 16,43% | 25,53% | 0,01% | 0,04% |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,85% | 12,43% | 1,81% | 4,38% | 12,43% | 23,11% | 0,01% | 0,03% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,37% | 5,92% | 1,20% | 2,76% | 5,92% | 12,40% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP | 1,20% | 11,72% | 2,44% | 5,17% | 11,72% | 20,21% | 0,01% | 0,02% |

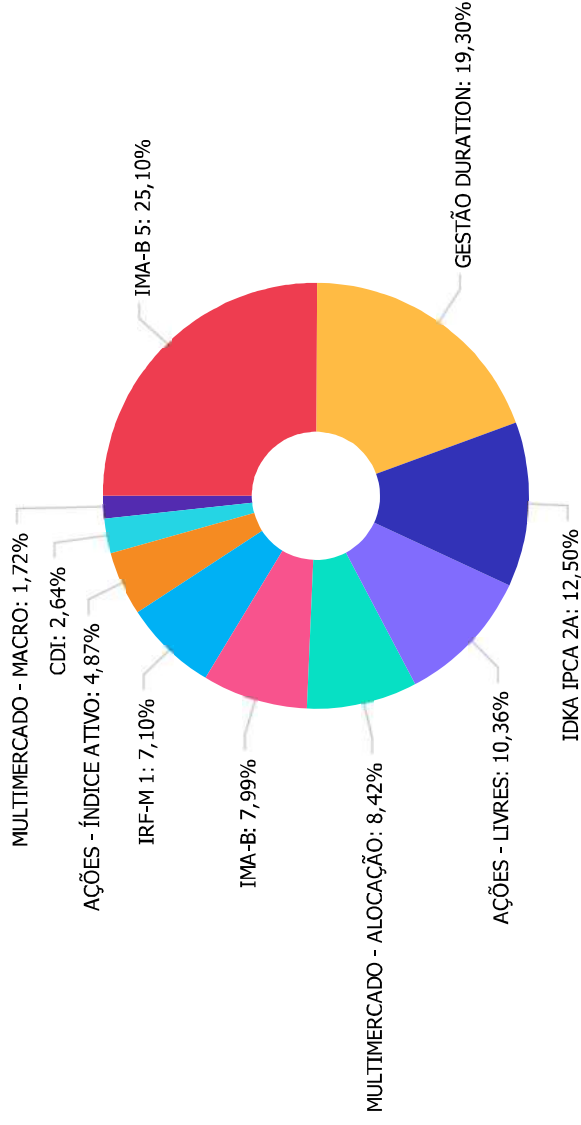
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| Ibovespa (Benchmark) | 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% | 0,04% | 0,13% |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 7,19% | 27,57% | 9,30% | 14,65% | 27,57% | 60,83% | 0,05% | 0,09% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 8,13% | 45,27% | 12,81% | 22,94% | 45,27% | 77,92% | 0,04% | 0,13% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 9,30% | - | 14,56% | 23,24% | - | - | 0,04% | - |
| CDI (Benchmark) | 0,37% | 5,96% | 1,24% | 2,80% | 5,96% | 12,76% | - | - |
| CAIXA RY 30 FI MULTIMERCADO LP | 2,22% | 13,70% | 4,58% | 6,93% | 13,70% | 22,92% | 0,02% | 0,03% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 2,09% | 18,08% | 3,77% | 7,38% | 18,08% | 29,14% | 0,01% | 0,03% |

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



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

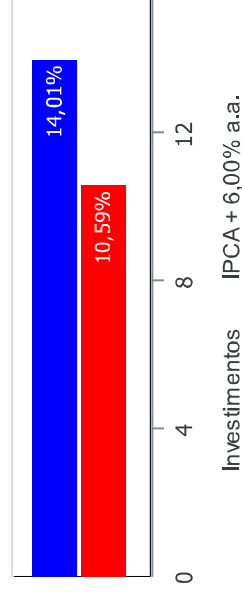


| | |
|-------------------------|--------------|
| IMA-B 5 | 3.779.221,52 |
| GESTÃO DURATION | 2.906.950,36 |
| IDKA IPCA 2A | 1.882.594,25 |
| AÇÕES - LIVRES | 1.560.680,52 |
| MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO | 1.267.756,45 |
| IMB-B | 1.203.527,38 |
| IRF-M 1 | 1.068.792,79 |
| AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 733.431,13 |
| CDI | 397.085,09 |
| MULTIMERCADO - MACRO | 259.029,62 |

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

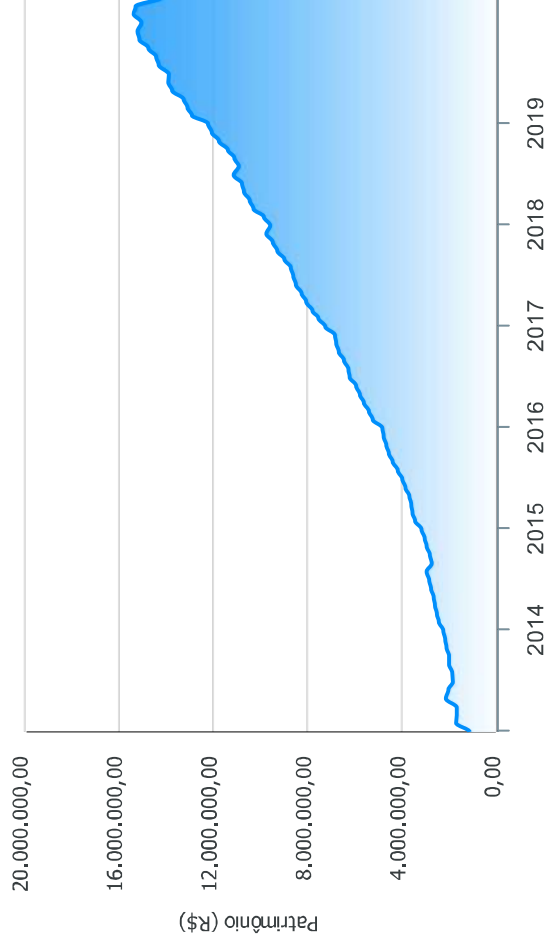
| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 12.234.935,04 | 1.929.722,44 | 1.533.481,70 | 12.911.894,59 | 280.718,81 | 280.718,81 | 2,22% | 2,22% | 0,83% | 0,83% | 267,24% | 1,34% |
| Fevereiro | 12.911.894,59 | 484.541,14 | 325.593,95 | 13.105.829,50 | 34.987,72 | 315.706,53 | 0,27% | 2,50% | 0,90% | 1,73% | 143,90% | 1,81% |
| Março | 13.105.829,50 | 2.107.892,14 | 2.003.639,84 | 13.265.549,28 | 55.467,48 | 371.174,01 | 0,42% | 2,93% | 1,19% | 2,95% | 99,24% | 2,70% |
| Abril | 13.265.549,28 | 1.680.294,81 | 1.336.279,74 | 13.739.276,07 | 129.711,72 | 500.885,73 | 0,95% | 3,91% | 1,06% | 4,04% | 96,73% | 1,40% |
| Mai | 13.739.276,07 | 1.193.778,93 | 1.132.355,41 | 13.916.068,31 | 115.368,72 | 616.254,45 | 0,84% | 4,78% | 0,64% | 4,71% | 101,48% | 1,71% |
| Junho | 13.916.068,31 | 404.796,64 | 692.551,75 | 13.897.993,74 | 269.680,54 | 885.934,99 | 1,94% | 6,81% | 0,45% | 5,18% | 131,46% | 1,80% |
| Julho | 13.897.993,74 | 627.508,86 | 374.510,88 | 14.306.279,06 | 155.287,34 | 1.041.222,33 | 1,10% | 7,98% | 0,72% | 5,94% | 134,33% | 1,30% |
| Agosto | 14.306.279,06 | 629.373,22 | 542.332,63 | 14.429.028,93 | 35.709,28 | 1.076.931,61 | 0,25% | 8,25% | 0,62% | 6,60% | 125,00% | 2,51% |
| Setembro | 14.429.028,93 | 275.242,56 | 173.144,80 | 14.752.876,88 | 221.750,19 | 1.298.681,80 | 1,53% | 9,90% | 0,45% | 7,07% | 139,95% | 1,50% |
| Outubro | 14.752.876,88 | 396.451,20 | 251.088,17 | 15.145.066,50 | 246.826,59 | 1.545.508,39 | 1,66% | 11,72% | 0,63% | 7,75% | 151,18% | 1,79% |
| Novembro | 15.145.066,50 | 239.547,78 | 155.051,39 | 15.214.482,56 | -15.080,33 | 1.530.428,06 | -0,10% | 11,61% | 0,98% | 8,80% | 131,87% | 1,68% |
| Dezembro | 15.214.482,56 | 474.400,52 | 957.801,65 | 15.059.069,11 | 327.987,68 | 1.858.415,74 | 2,16% | 14,01% | 1,64% | 10,59% | 132,34% | 1,55% |

Investimentos x Meta Atuarial

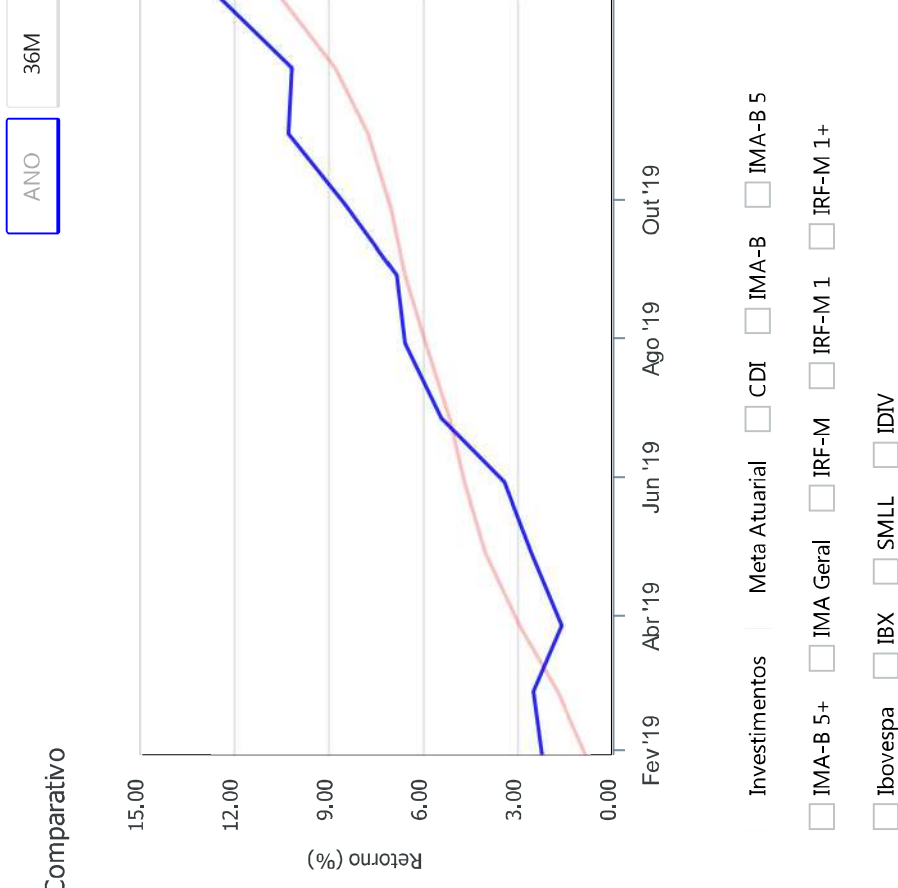


Gráficos Ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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 |
|---|----------------------|-------------------|-------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.180.038,51 | 0,00 | 0,00 | 1.203.527,38 | 23.488,87 | 1,99% | 1,99% | 2,80% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.452.260,45 | 0,00 | 0,00 | 1.469.776,04 | 17.515,59 | 1,21% | 1,21% | 1,01% |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L... | 691.493,51 | 0,00 | 0,00 | 699.779,30 | 8.285,79 | 1,20% | 1,20% | 1,01% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 538.643,28 | 0,00 | 0,00 | 544.851,79 | 6.208,51 | 1,15% | 1,15% | 0,75% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.323.192,73 | 0,00 | 0,00 | 1.337.742,46 | 14.549,73 | 1,10% | 1,10% | 0,74% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 2.086.745,98 | 175.277,90 | 674.589,89 | 1.609.666,18 | 22.232,19 | 0,98% | 1,19% | 1,00% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 579.074,77 | 0,00 | 0,00 | 583.980,26 | 4.905,49 | 0,85% | 0,85% | 1,09% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 1.754.234,94 | 0,00 | 0,00 | 1.764.644,47 | 10.409,53 | 0,59% | 0,59% | 0,93% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.017.537,40 | 0,00 | 0,00 | 1.021.632,06 | 4.094,66 | 0,40% | 0,40% | 0,07% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 43.799,42 | 0,00 | 0,00 | 43.973,47 | 174,05 | 0,40% | 0,40% | 0,07% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 139.937,43 | 0,00 | 0,00 | 140.460,79 | 523,36 | 0,37% | 0,37% | 0,05% |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA | 173.313,98 | 0,00 | 0,00 | 173.925,73 | 611,75 | 0,35% | 0,35% | 0,01% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 556.413,01 | 0,00 | 0,00 | 558.325,63 | 1.912,62 | 0,34% | 0,34% | 0,01% |
| ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 182.670,42 | 0,00 | 180.000,00 | 3.187,26 | 516,84 | 0,28% | 0,40% | 0,07% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 14.749,63 | 170.943,63 | 103.211,76 | 82.698,57 | 217,07 | 0,12% | 0,31% | 0,01% |
| Total Renda Fixa | 11.734.105,46 | 346.221,53 | 957.801,65 | 11.238.171,39 | 115.646,05 | 0,96% | | 0,97% |

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 |
|--|---------------------|-------------------|-------------|---------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 537.673,11 | 0,00 | 0,00 | 592.552,93 | 54.879,82 | 10,21% | 10,21% | 4,42% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 421.704,93 | 128.178,99 | 0,00 | 597.405,33 | 47.521,41 | 8,64% | 9,30% | 3,97% |
| ITAÚ DUNA MIS FIC AÇÕES | 342.849,01 | 0,00 | 0,00 | 370.722,26 | 27.873,25 | 8,13% | 8,13% | 4,08% |
| BRDESCO SELECTION FIAÇÕES | 684.209,49 | 0,00 | 0,00 | 733.431,13 | 49.221,64 | 7,19% | 7,19% | 5,09% |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | 1.240.211,79 | 0,00 | 0,00 | 1.267.756,45 | 27.544,66 | 2,22% | 2,22% | 1,53% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 253.728,77 | 0,00 | 0,00 | 259.029,62 | 5.300,85 | 2,09% | 2,09% | 1,10% |
| Total Renda Variável | 3.480.377,10 | 128.178,99 | 0,00 | 3.820.897,72 | 212.341,63 | 5,88% | | 3,26% |

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.952.224,37 | 282.955,71 | 674.589,89 | 1.609.666,18 | 49.075,99 | 2,20% | 2,54% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA... | 1.433.667,79 | 0,00 | 0,00 | 1.469.776,04 | 36.108,25 | 2,52% | 2,52% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.171.874,17 | 0,00 | 0,00 | 1.203.527,38 | 31.653,21 | 2,70% | 2,70% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.306.378,63 | 0,00 | 0,00 | 1.337.742,46 | 31.363,83 | 2,40% | 2,40% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 1.733.491,70 | 0,00 | 0,00 | 1.764.644,47 | 31.152,77 | 1,80% | 1,80% |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L... | 683.109,39 | 0,00 | 0,00 | 699.779,30 | 16.669,91 | 2,44% | 2,44% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 530.947,53 | 0,00 | 0,00 | 544.851,79 | 13.904,26 | 2,62% | 2,62% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.008.230,54 | 0,00 | 0,00 | 1.021.632,06 | 13.401,52 | 1,33% | 1,33% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 573.609,13 | 0,00 | 0,00 | 583.980,26 | 10.371,13 | 1,81% | 1,81% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 551.740,64 | 0,00 | 0,00 | 558.325,63 | 6.584,99 | 1,19% | 1,19% |
| ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 158.874,41 | 170.000,00 | 328.000,00 | 3.187,26 | 2.312,85 | 0,70% | 1,33% |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA | 171.912,17 | 0,00 | 0,00 | 173.925,73 | 2.013,56 | 1,17% | 1,17% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 238.585,49 | 0,00 | 100.000,00 | 140.460,79 | 1.875,30 | 0,79% | 1,20% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA | 94.641,97 | 248.787,83 | 261.351,32 | 82.698,57 | 620,09 | 0,18% | 1,03% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 43.405,54 | 0,00 | 0,00 | 43.973,47 | 567,93 | 1,31% | 1,31% |
| | | | Total Renda Fixa | | 247.675,59 | 2,00% | |

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 |
|--|----------------|------------|-----------------------------|--------------|-------------------|--------------|------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 436.352,66 | 79.941,40 | 0,00 | 592.552,93 | 76.258,87 | 14,77% | 14,53% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 202.302,23 | 328.714,56 | 0,00 | 597.405,33 | 66.388,54 | 12,50% | 14,56% |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 671.000,69 | 0,00 | 0,00 | 733.431,13 | 62.430,44 | 9,30% | 9,30% |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP | 1.212.274,05 | 0,00 | 0,00 | 1.267.756,45 | 55.482,40 | 4,58% | 4,58% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 328.623,89 | 0,00 | 0,00 | 370.722,26 | 42.098,37 | 12,81% | 12,81% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 249.629,89 | 0,00 | 0,00 | 259.029,62 | 9.399,73 | 3,77% | 3,77% |
| | | | Total Renda Variável | | 312.058,35 | 8,89% | |

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 (%) | (%) Insttit |
|---|----------------|-------------------------|--------------|--------------|---------------------|--------------|-------------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.679.207,22 | 0,00 | 720.230,99 | 1.203.527,38 | 244.551,15 | 14,56% | 22,59% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 1.392.203,48 | 135.537,32 | 0,00 | 1.764.644,47 | 236.903,67 | 15,51% | 16,43% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.425.889,26 | 748.877,45 | 774.589,89 | 1.609.666,18 | 209.489,36 | 9,63% | 12,89% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 0,00 | 1.325.673,57 | 0,00 | 1.469.776,04 | 144.102,47 | 10,87% | 12,85% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.203.133,65 | 0,00 | 0,00 | 1.337.742,46 | 134.608,81 | 11,19% | 11,19% |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L... | 1.114.795,55 | 0,00 | 500.000,00 | 699.779,30 | 84.983,75 | 7,62% | 11,72% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.741.518,62 | 0,00 | 800.000,00 | 1.021.632,06 | 80.113,44 | 4,60% | 6,55% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 724.016,42 | 0,00 | 250.000,00 | 544.851,79 | 70.835,37 | 9,78% | 11,20% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 0,00 | 523.510,46 | 0,00 | 568.325,63 | 34.815,17 | 6,65% | 11,91% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,00 | 550.000,00 | 0,00 | 583.980,26 | 33.980,26 | 6,18% | 12,43% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 324.236,40 | 0,00 | 200.000,00 | 140.460,79 | 16.224,39 | 5,00% | 5,92% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA ... | 207.376,29 | 762.143,91 | 984.012,05 | 0,00 | 14.491,85 | 1,49% | - |
| ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 0,00 | 2.150.579,66 | 2.159.026,06 | 3.187,26 | 11.633,66 | 0,54% | 6,53% |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA | 164.663,63 | 0,00 | 81,00 | 173.925,73 | 9.343,10 | 5,67% | 5,68% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 258.005,10 | 1.210.956,23 | 1.392.990,02 | 82.698,57 | 6.727,26 | 0,46% | 5,07% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 41.292,55 | 0,00 | 0,00 | 43.973,47 | 2.680,92 | 6,49% | 6,49% |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP | 0,00 | 400.000,00 | 400.288,34 | 0,00 | 288,34 | 0,07% | 5,81% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 638.383,87 | 552.608,51 | 0,00 | -85.775,36 | -13,44% | 4,82% |
| | | Total Renda Fixa | | | 1.249.997,61 | 6,68% | |

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 RV 30 FI MULTIMERCADO LP | 1.231.743,19 | 0,00 | 120.000,00 | 1.267.756,45 | 156.013,26 | 12,67% | 13,70% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 357.385,97 | 79.941,40 | 0,00 | 592.552,93 | 155.225,56 | 35,49% | 39,84% |
| BRADESCO SELECTION FIAÇÕES | 0,00 | 624.086,05 | 0,00 | 733.431,13 | 109.345,08 | 17,52% | 27,57% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 0,00 | 296.399,82 | 0,00 | 370.722,26 | 74.322,44 | 25,08% | 45,27% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 0,00 | 528.714,56 | 0,00 | 597.405,33 | 68.690,77 | 12,99% | - |
| BRADESCO VALUATION IBOVSPA FIC AÇÕES | 369.467,71 | 225.538,97 | 624.005,05 | 0,00 | 28.998,37 | 4,87% | 30,69% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 0,00 | 243.206,97 | 0,00 | 259.029,62 | 15.822,65 | 6,51% | 18,08% |
| | | | Total Renda Variável | | 608.418,13 | 18,94% | |