

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º trimestre e ano de 2019

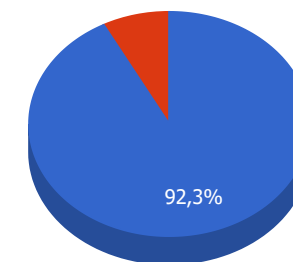
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	28.017.511,11	16,12%	362	1,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.148.422,83	4,69%	695	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.357.850,55	1,36%	681	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	18.961.446,52	10,91%	314	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	28.425,75	0,02%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.818.693,28	2,77%	1.361	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	644.413,71	0,37%	708	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	30.388.033,34	17,48%	964	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	33.008.389,01	18,99%	342	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	45,82	0,00%	27.274	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.103.102,13	2,94%	94	1,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	23.754.285,76	13,66%	11	22,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.170.556,08	2,97%	688	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	4.278.457,54	2,46%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	Não se ...	Não se aplica	4.096.682,58	2,36%		3,24%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1801	90 dias	5.076.158,31	2,92%	10	5,24%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			173.852.474,32				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			996.694,99				Artigo 6º
PL Total			174.849.169,31				

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, Alínea " b "	100,00%	126.373.186,10	72,69%	15,00%	25,00%	80,00%	12.708.793,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	104.311.484,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	34.027.989,79	19,57%	10,00%	30,00%	40,00%	35.512.999,94
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	26.077.871,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	8.692.623,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.692.623,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.692.623,72
Total Renda Fixa	100,00%	160.401.175,89	92,26%	27,00%	70,00%	210,00%	

Distribuição por Segmento

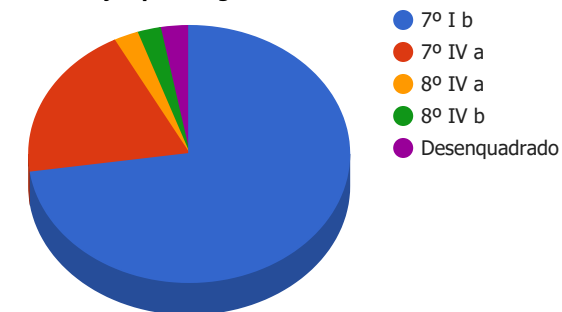


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

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, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	34.770.494,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	17.385.247,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.278.457,54	2,46%	2,00%	5,00%	5,00%	4.414.166,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	4.096.682,58	2,36%	2,00%	5,00%	5,00%	4.595.941,14
Desenquadrado - RV	0,00%	5.076.158,31	2,92%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.076.158,31
Total Renda Variável	30,00%	13.451.298,43	7,74%	18,00%	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	100.607.811,11	57,87	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.039.079,02	20,73	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	28.830.444,07	16,58	1,59
FOCO DTVM	4.278.457,54	2,46	-
REDITUS INVESTIMENTOS	4.096.682,58	2,36	-

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	126.373.186,10	72,69	15,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	34.027.989,79	19,57	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.278.457,54	2,46	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	4.096.682,58	2,36	2,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	0,89%	3,86%	6,15%	12,56%	26,08%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Selic (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

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)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	0,89%	3,86%	6,15%	12,56%	26,08%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

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
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Selic (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	0,89%	3,86%	6,15%	12,56%	26,08%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Selic (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

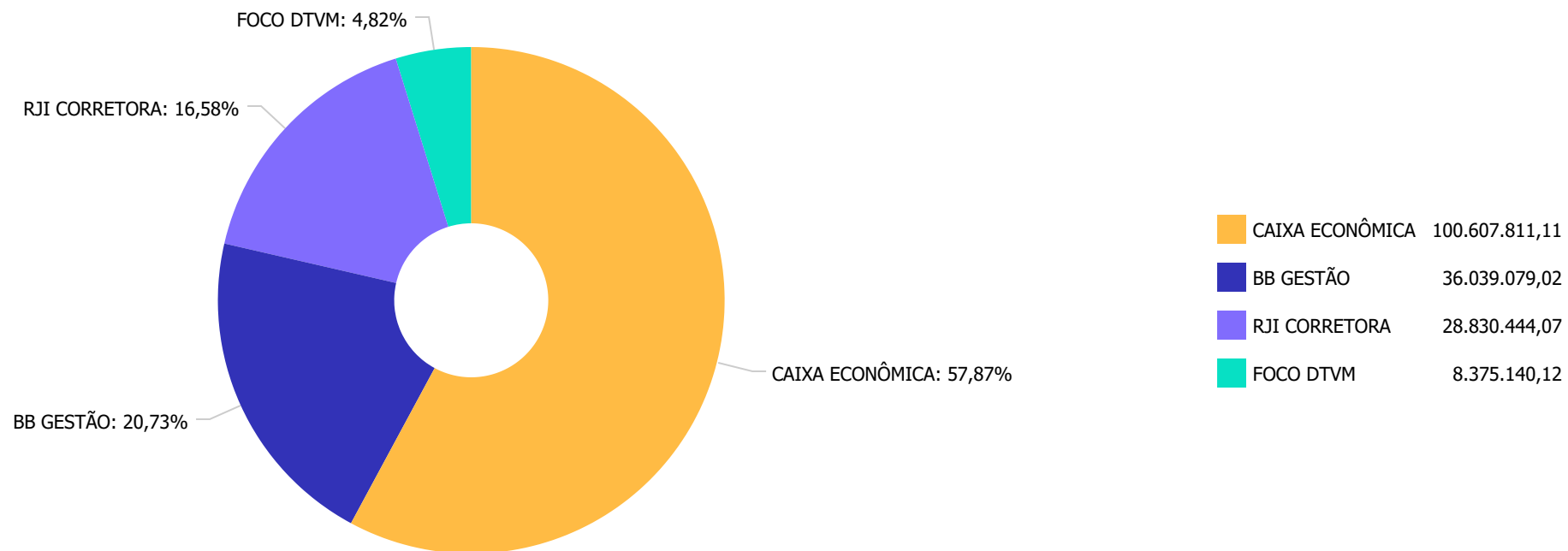
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

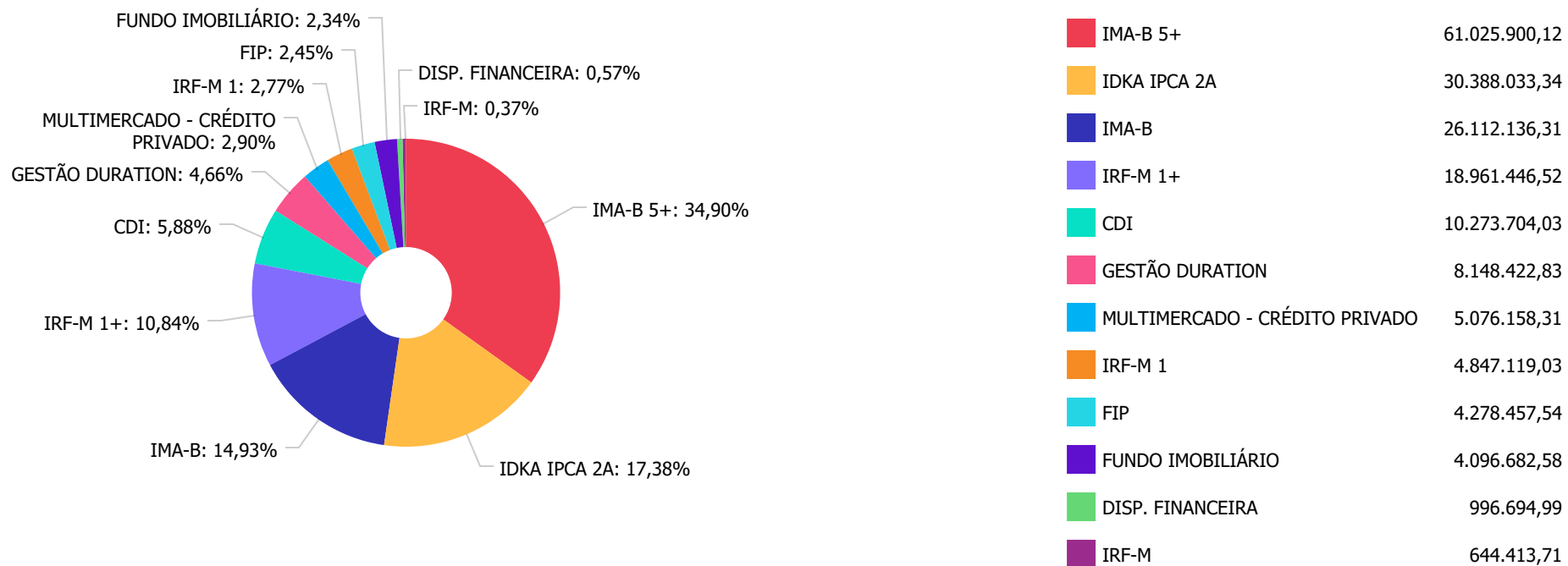
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	11,91%	0,69%	2,31%	9,32%	19,34%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00%	16,43%	0,09%	3,82%	13,17%	24,28%	0,01%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00%	12,43%	-0,10%	3,42%	10,27%	21,38%	0,01%	0,03%

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



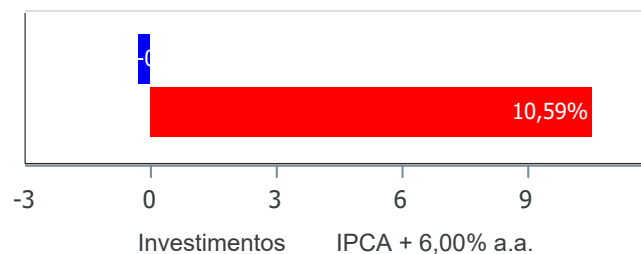
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

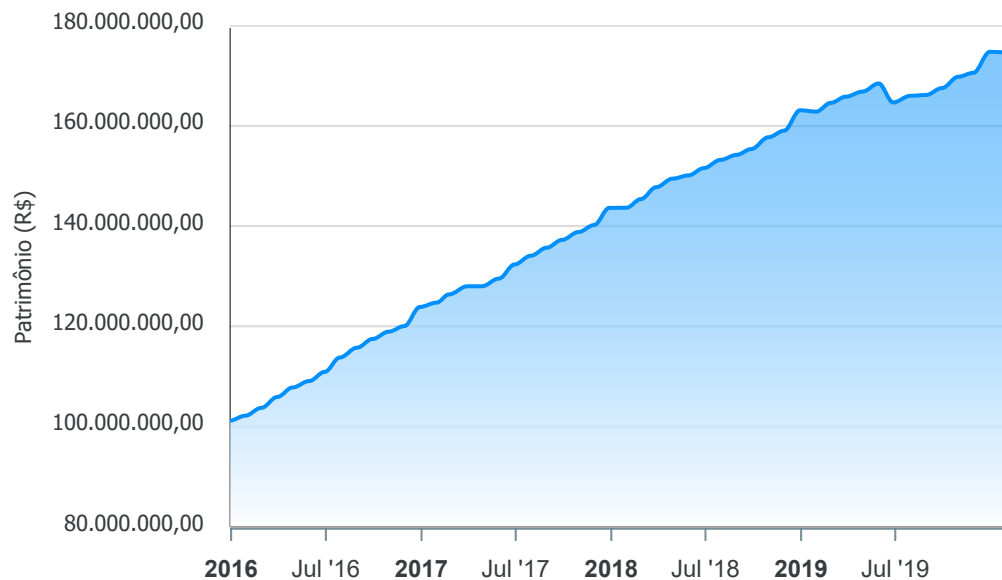
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	163.157.262,13	0,00	683.400,00	162.752.567,82	278.705,69	278.705,69	0,17%	0,17%	0,83%	0,83%	20,54%	0,43%
Fevereiro	162.752.567,82	1.087.050,00	105.000,00	164.646.943,89	912.326,07	1.191.031,76	0,56%	0,73%	0,90%	1,73%	42,03%	0,56%
Março	164.646.943,89	854.175,56	152.000,00	165.820.330,11	471.210,66	1.662.242,42	0,28%	1,02%	1,19%	2,95%	34,45%	1,02%
Abril	165.820.330,11	858.083,74	114.000,00	166.834.863,67	270.449,82	1.932.692,24	0,16%	1,18%	1,06%	4,04%	29,21%	1,17%
Mai	166.834.863,67	1.030.378,80	250.000,00	168.489.449,88	874.207,41	2.806.899,65	0,52%	1,71%	0,64%	4,71%	36,29%	1,69%
Junho	168.489.449,88	3.661.049,75	1.569.980,19	164.659.819,61	-5.920.699,83	-3.113.800,18	-3,47%	-1,82%	0,45%	5,18%	-35,20%	4,47%
Julho	164.659.819,61	1.535.378,80	808.500,00	166.055.155,75	668.457,34	-2.445.342,84	0,40%	-1,43%	0,72%	5,94%	-24,00%	1,65%
Agosto	166.055.155,75	23.336.070,05	22.545.692,18	166.195.693,93	-649.839,69	-3.095.182,53	-0,39%	-1,81%	0,62%	6,60%	-27,43%	2,24%
Setembro	166.195.693,93	26.771.665,65	25.967.653,96	167.593.457,17	593.751,55	-2.501.430,98	0,36%	-1,46%	0,45%	7,07%	-20,65%	24,45%
Outubro	167.593.457,17	1.748.131,60	931.000,24	169.851.612,08	1.441.023,55	-1.060.407,43	0,86%	-0,62%	0,63%	7,75%	-7,96%	1,38%
Novembro	169.851.612,08	1.647.667,07	880.000,00	170.568.190,98	-51.088,17	-1.111.495,60	-0,03%	-0,65%	0,98%	8,80%	-7,35%	0,42%
Dezembro	170.568.190,98	86.464.641,94	83.825.518,16	173.852.474,32	645.159,56	-466.336,04	0,37%	-0,28%	1,64%	10,59%	-2,62%	2,99%

Investimentos x Meta Atuarial



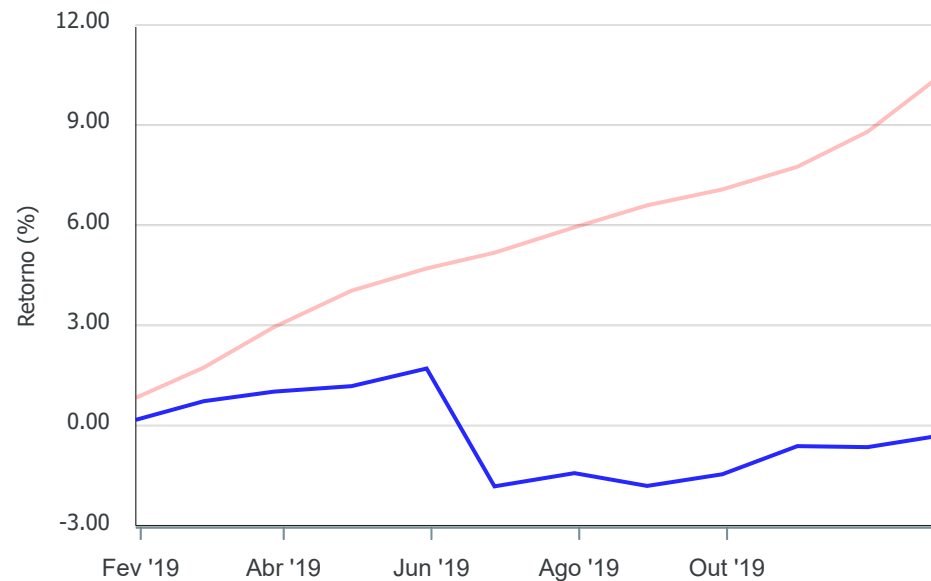
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	30.057.523,05	0,00	0,00	30.388.033,34	330.510,29	1,10%	1,10%	0,74%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	34.460.749,22	4.027.000,00	30.549.775,36	8.148.422,83	210.448,97	0,55%	0,59%	0,93%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.153.056,72	0,00	7.153.056,77	28.425,75	28.425,80	0,40%	0,40%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	28.442.251,01	0,00	23.733.775,04	4.818.693,28	110.217,31	0,39%	0,40%	0,07%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.004.013,44	0,00	923.215,90	5.103.102,13	22.304,59	0,37%	0,37%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.523.306,00	0,00	21.442.508,46	5.170.556,08	89.758,54	0,34%	0,35%	0,01%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	23.186,63	0,00	23.186,63	45,82	45,82	0,20%	0,21%	0,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	207.829,79	2.145.917,02	0,00	2.357.850,55	4.103,74	0,17%	1,97%	2,77%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	117.240,77	526.464,97	0,00	644.413,71	707,97	0,11%	0,60%	0,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	28.000.000,00	0,00	28.017.511,11	17.511,11	0,06%	2,56%	4,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	36.186,81	18.921.352,08	0,00	18.961.446,52	3.907,63	0,02%	0,70%	1,35%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	160.123,72	32.843.907,87	0,00	33.008.389,01	4.357,42	0,01%	2,72%	4,09%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	23.841.673,78	0,00	0,00	23.754.285,76	-87.388,02	-0,37%	-0,37%	7,53%
Total Renda Fixa	157.027.140,94	86.464.641,94	83.825.518,16	160.401.175,89	734.911,17	0,46%		3,09%

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
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.071.909,65	0,00	0,00	5.076.158,31	4.248,66	0,08%	0,08%	2,03%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.279.642,18	0,00	0,00	4.278.457,54	-1.184,64	-0,03%	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.189.498,21	0,00	0,00	4.096.682,58	-92.815,63	-2,22%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	13.541.050,04	0,00	0,00	13.451.298,43	-89.751,61	-0,66%		1,12%

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	29.675.575,12	0,00	0,00	30.388.033,34	712.458,22	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	30.698.520,58	7.422.798,67	30.549.775,36	8.148.422,83	576.878,94	1,51%	1,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	29.956.043,95	0,00	25.519.775,04	4.818.693,28	382.424,37	1,28%	1,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	26.323.485,65	0,00	21.442.508,46	5.170.556,08	289.578,89	1,10%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.088.730,84	0,00	7.153.056,77	28.425,75	92.751,68	1,31%	1,31%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.955.183,18	0,00	923.215,90	5.103.102,13	71.134,85	1,19%	1,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	28.000.000,00	0,00	28.017.511,11	17.511,11	0,06%	2,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	206.202,99	2.145.917,02	0,00	2.357.850,55	5.730,54	0,24%	2,78%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	159.534,07	32.843.907,87	0,00	33.008.389,01	4.947,07	0,01%	3,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	35.702,85	18.921.352,08	0,00	18.961.446,52	4.391,59	0,02%	2,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	115.848,69	526.464,97	0,00	644.413,71	2.100,05	0,33%	1,81%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	23.068,06	0,00	23.186,63	45,82	164,39	0,71%	0,72%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	25.000,00	0,00	25.000,24	0,00	0,24	0,00%	0,18%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	23.771.090,96	0,00	0,00	23.754.285,76	-16.805,20	-0,07%	-0,57%
Total Renda Fixa					2.143.266,74	1,35%	

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
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.079.378,59	0,00	0,00	5.076.158,31	-3.220,28	-0,06%	-0,21%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.282.067,74	0,00	0,00	4.278.457,54	-3.610,20	-0,08%	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.198.023,90	0,00	0,00	4.096.682,58	-101.341,32	-2,41%	0,00%
				Total Renda Variável	-108.171,80	-0,80%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	72.323.367,27	4.663.688,10	76.215.866,28	4.818.693,28	4.047.504,19	5,26%	6,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	25.177.669,68	0,00	21.442.508,46	5.170.556,08	1.435.394,86	5,70%	5,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.345.311,02	22.661.066,61	0,00	30.388.033,34	1.381.655,71	4,76%	11,19%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	37.713.978,94	30.549.775,36	8.148.422,83	984.219,25	2,61%	16,43%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.743.650,12	0,00	7.153.056,77	28.425,75	437.832,40	6,49%	6,49%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.719.173,65	0,00	953.215,90	5.103.102,13	337.144,38	5,89%	5,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	172.809,09	2.145.917,02	0,00	2.357.850,55	39.124,44	1,69%	22,64%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	126.473,72	32.843.907,87	0,00	33.008.389,01	38.007,42	0,12%	30,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	28.000.000,00	0,00	28.017.511,11	17.511,11	0,06%	29,73%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	105.511,52	526.464,97	0,00	644.413,71	12.437,22	1,97%	11,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	31.996,30	18.921.352,08	0,00	18.961.446,52	8.098,14	0,04%	13,89%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,00	23.000,00	23.186,63	45,82	232,45	1,01%	3,83%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.494.917,37	1.495.135,33	0,00	217,96	0,01%	0,98%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	31.401.150,71	0,00	0,00	23.754.285,76	-7.646.864,95	-24,35%	-24,35%
				Total Renda Fixa	1.092.514,58	0,69%	

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
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.292.891,36	0,00	0,00	4.278.457,54	-14.433,82	-0,34%	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.833.144,19	0,00	0,00	4.096.682,58	-736.461,61	-15,24%	0,00%
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.884.113,50	0,00	0,00	5.076.158,31	-807.955,19	-13,73%	-13,73%
				Total Renda Variável	-1.558.850,62	-10,39%	