

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2019



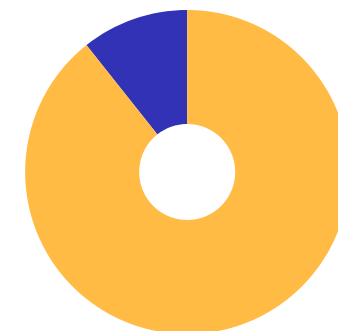
Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			5.618.419,29	4,15%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.390.338,52	16,55%	923	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	7.033.732,59	5,20%	149	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.928.632,10	6,60%	580	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.716.893,86	4,97%	964	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.652.287,09	2,70%	1.198	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	597.481,23	0,44%	165	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	6.260.671,74	4,63%	115	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	24.213.313,05	17,90%	305	0,79%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	676.549,96	0,50%	688	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	25.941.977,31	19,18%	289	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCI...	D+0	Não há	4.751.105,37	3,51%	670	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.710.853,67	2,74%	90	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	316.444,96	0,23%	114	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	2.921.061,91	2,16%	51	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.196.307,00	3,10%	59.465	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.149.917,22	4,55%	165	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	486.841,92	0,36%	26.794	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	687.597,94	0,51%		0,29%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			135.250.426,73				

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

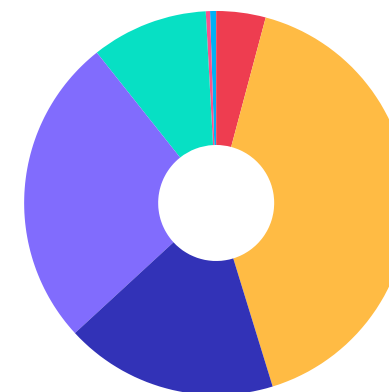
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	5.618.419,29	4,15%	0,00%	5,00%	10,00%	7.906.623,38
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	55.580.037,13	41,09%	15,00%	30,00%	70,00%	39.095.261,58
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	40.575.128,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	24.213.313,05	17,90%	5,00%	10,00%	60,00%	56.936.942,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	30,00%	40.575.128,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	35.396.931,27	26,17%	10,00%	20,00%	40,00%	18.703.239,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	20.287.564,01
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.762.521,34
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	20.287.564,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.762.521,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.762.521,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.762.521,34
Total Renda Fixa	100,00%	120.808.700,74	89,32%	30,00%	90,00%	290,00%	



RENDA FIXA 120.808.700,74
RENDA VARIÁVEL 14.441.725,99

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 I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	40.575.128,02
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	13.525.042,67
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	13.267.286,13	9,81%	0,00%	0,00%	10,00%	257.756,54
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	486.841,92	0,36%	0,00%	5,00%	10,00%	13.038.200,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.762.521,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	687.597,94	0,51%	0,00%	0,00%	5,00%	6.074.923,40
Total Renda Variável	30,00%	14.441.725,99	10,68%	0,00%	10,00%	70,00%	



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)	0,91%	12,63%	1,90%	4,54%	12,63%	23,66%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	13,07%	1,81%	4,48%	13,07%	24,27%	0,01%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,20%	11,82%	2,46%	5,25%	11,82%	22,73%	-	-
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%	-	-
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%
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%	12,86%	2,52%	5,31%	12,86%	23,77%	0,01%	0,02%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,22%	12,90%	2,56%	5,35%	12,90%	23,79%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,99%	22,47%	2,74%	6,54%	22,47%	38,31%	0,03%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	10,46%	2,42%	4,56%	10,46%	21,28%	0,01%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,33%	5,76%	1,14%	2,67%	5,76%	12,40%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,35%	5,72%	1,11%	2,62%	5,72%	12,30%	0,00%	0,00%

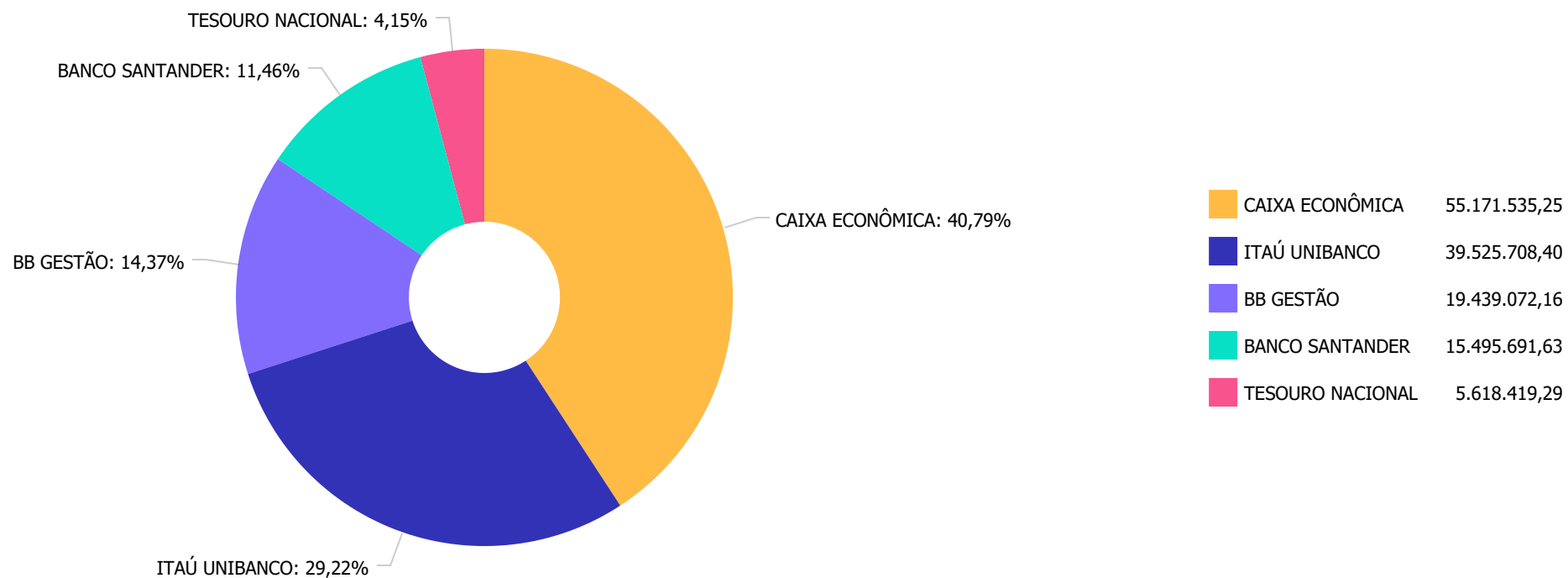
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,37%	5,81%	1,10%	2,65%	5,81%	12,53%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	13,34%	2,43%	5,23%	13,34%	33,37%	0,01%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	11,91%	1,19%	3,28%	11,91%	21,11%	0,00%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,40%	13,69%	2,35%	4,81%	13,69%	19,20%	0,00%	0,03%

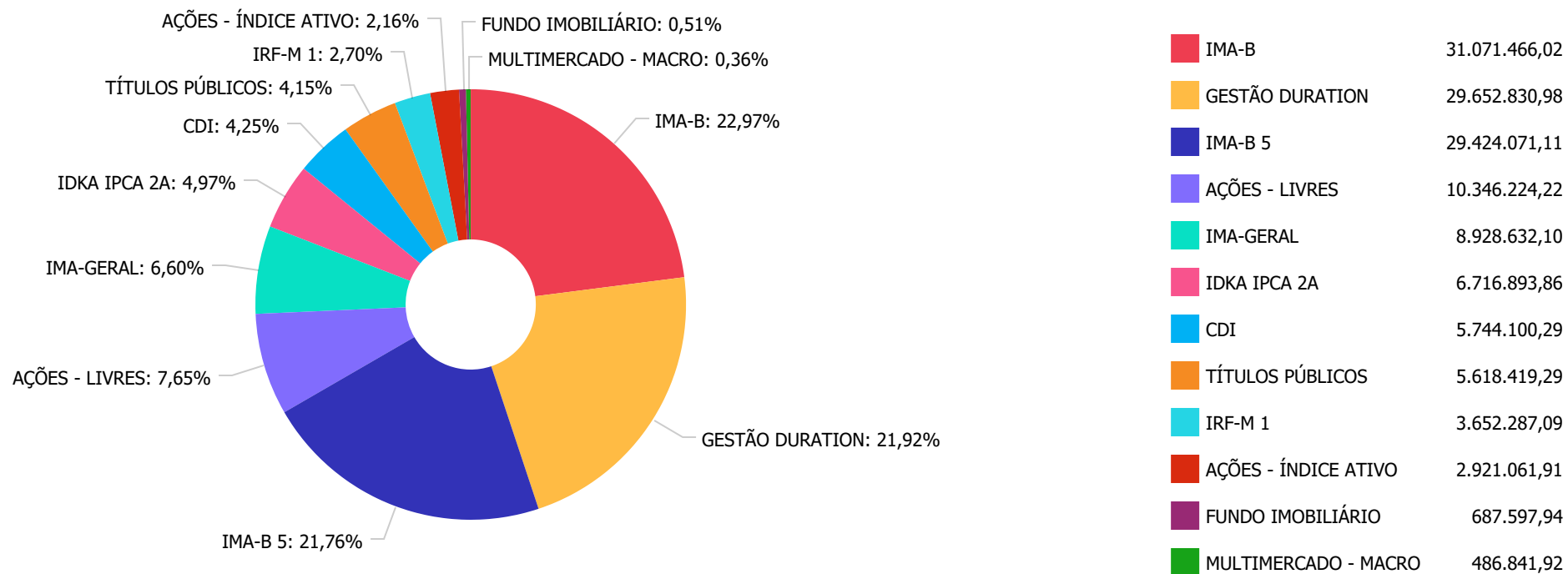
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,27%	35,04%	12,81%	17,93%	35,04%	56,78%	0,04%	0,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10,21%	39,84%	14,53%	21,51%	39,84%	76,22%	0,04%	0,13%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	0,04%	0,13%
CDI (Benchmark)	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%	0,01%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	9,96%	47,62%	34,23%	44,38%	47,62%	39,25%	0,14%	0,17%

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



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



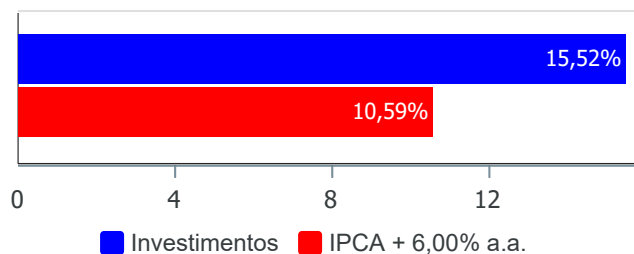
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2019)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/07/2005	1.450	1.422,157732	3.874,771927	2.062.128,71	5.618.419,29	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

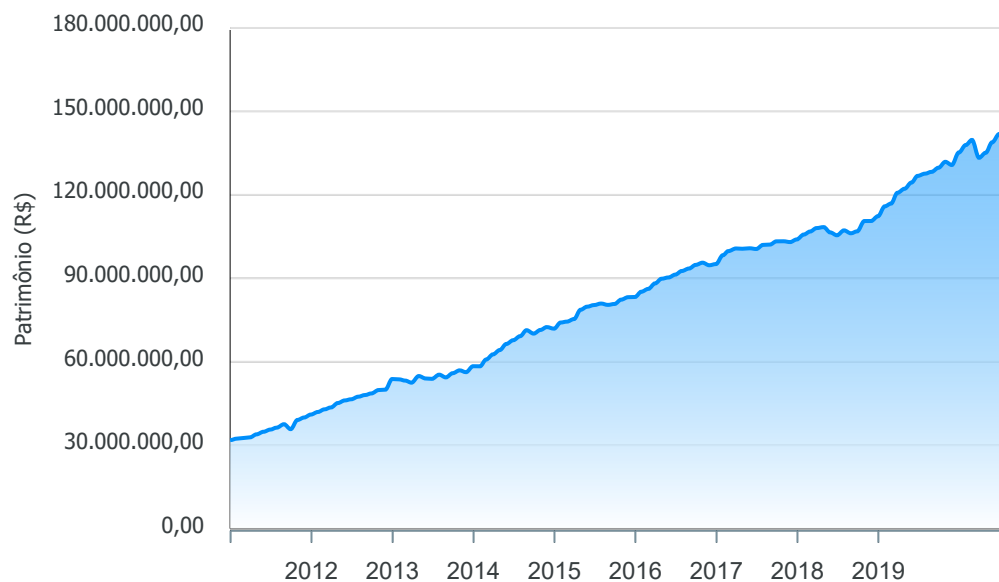
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	112.327.301,49	5.419.592,81	4.757.418,82	115.890.251,62	2.900.776,14	2.900.776,14	2,57%	2,57%	0,83%	0,83%	308,71%	1,34%
Fevereiro	115.890.251,62	5.701.381,61	5.151.318,47	116.877.706,38	437.391,62	3.338.167,76	0,38%	2,95%	0,90%	1,73%	170,22%	1,52%
Março	116.877.706,38	3.400.000,00	153.850,02	120.750.577,15	626.720,79	3.964.888,55	0,52%	3,49%	1,19%	2,95%	118,34%	2,26%
Abril	120.750.577,15	1.790.900,00	1.523.850,00	122.203.470,62	1.185.843,47	5.150.732,02	0,98%	4,50%	1,06%	4,04%	111,49%	1,04%
Mai	122.203.470,62	20.856.676,65	20.872.577,54	124.430.457,54	2.242.887,81	7.393.619,83	1,84%	6,42%	0,64%	4,71%	136,45%	1,51%
Junho	124.430.457,54	933.850,00	1.358.734,14	126.830.826,42	2.825.253,02	10.218.872,85	2,27%	8,84%	0,45%	5,18%	170,70%	1,70%
Julho	126.830.826,42	715.090,46	1.383.850,02	127.629.152,92	1.467.086,06	11.685.958,91	1,16%	10,10%	0,72%	5,94%	170,00%	1,15%
Agosto	127.629.152,92	2.180.505,93	1.733.888,22	128.279.551,30	203.780,67	11.889.739,58	0,16%	10,27%	0,62%	6,60%	155,71%	2,04%
Setembro	128.279.551,30	606.396,16	1.103.850,03	129.757.623,42	1.975.525,99	13.865.265,57	1,54%	11,97%	0,45%	7,07%	169,24%	1,34%
Outubro	129.757.623,42	1.619.167,54	1.620.000,01	131.886.755,02	2.129.964,07	15.995.229,64	1,64%	13,81%	0,63%	7,75%	178,14%	1,44%
Novembro	131.886.755,02	936.009,07	1.624.400,00	130.748.059,98	-450.304,11	15.544.925,53	-0,34%	13,42%	0,98%	8,80%	152,45%	1,37%
Dezembro	130.748.059,98	4.269.699,69	2.224.835,52	135.250.426,73	2.457.502,58	18.002.428,11	1,85%	15,52%	1,64%	10,59%	146,54%	1,43%

Investimentos x Meta Atuarial



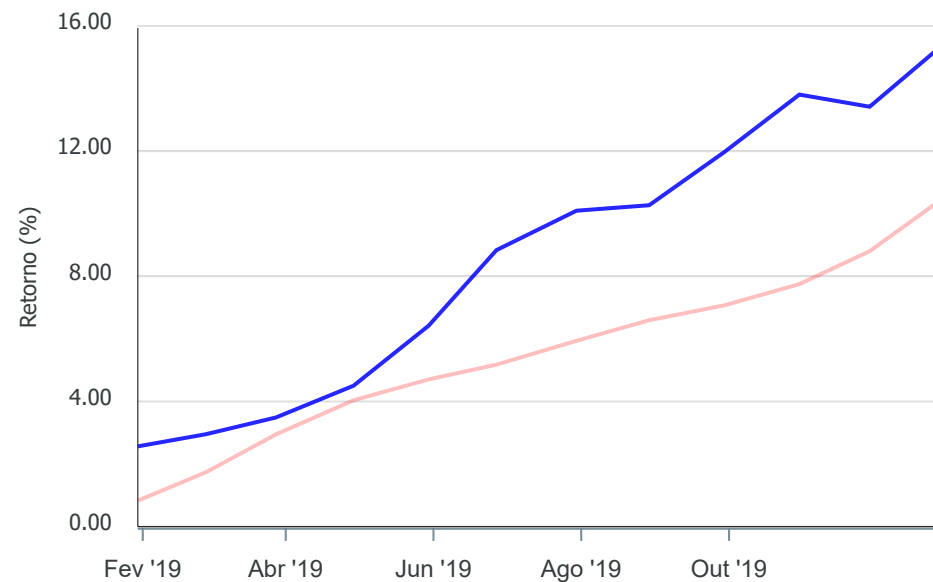
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	23.740.464,53	0,00	0,00	24.213.313,05	472.848,52	1,99%	1,99%	2,79%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.534.879,13	0,00	0,00	5.618.419,29	83.540,16	1,51%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.949.201,72	0,00	0,00	7.033.732,59	84.530,87	1,22%	1,22%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.123.508,72	0,00	0,00	22.390.338,52	266.829,80	1,21%	1,21%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	6.191.097,62	0,00	0,00	6.260.671,74	69.574,12	1,12%	1,12%	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.643.838,70	0,00	0,00	6.716.893,86	73.055,16	1,10%	1,10%	0,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.843.837,26	0,00	0,00	8.928.632,10	84.794,84	0,96%	0,96%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	592.051,33	0,00	0,00	597.481,23	5.429,90	0,92%	0,92%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.637.830,60	0,00	0,00	3.652.287,09	14.456,49	0,40%	0,40%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	669.781,69	4.400,00	0,00	676.549,96	2.368,27	0,35%	0,35%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	25.853.109,30	0,00	0,00	25.941.977,31	88.868,01	0,34%	0,34%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	6.682.714,98	0,00	1.953.285,48	4.751.105,37	21.675,87	0,32%	0,37%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	574.950,01	0,00	260.000,04	316.444,96	1.494,99	0,26%	0,33%	0,07%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	581.985,61	3.122.485,78	0,00	3.710.853,67	6.382,28	0,17%	0,40%	0,11%
Total Renda Fixa	118.619.251,20	3.126.885,78	2.213.285,52	120.808.700,74	1.275.849,28	1,07%		1,04%

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	629.924,16	0,00	11.550,00	687.597,94	69.223,78	10,99%	9,96%	13,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5.580.337,03	0,00	0,00	6.149.917,22	569.580,19	10,21%	10,21%	4,42%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.697.888,12	0,00	0,00	2.921.061,91	223.173,79	8,27%	8,27%	4,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.220.659,47	662.813,91	0,00	4.196.307,00	312.833,62	8,06%	8,13%	4,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	480.000,00	0,00	486.841,92	6.841,92	1,43%	2,09%	1,10%
Total Renda Variável	12.128.808,78	1.142.813,91	11.550,00	14.441.725,99	1.181.653,30	8,91%		4,57%

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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	23.568.330,91	0,00	0,00	24.213.313,05	644.982,14	2,74%	2,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.840.271,06	0,00	0,00	22.390.338,52	550.067,46	2,52%	2,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.827.568,25	1.813.420,08	0,00	25.941.977,31	300.988,98	1,17%	1,19%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.858.221,06	0,00	0,00	7.033.732,59	175.511,53	2,56%	2,56%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.457.522,73	0,00	0,00	5.618.419,29	160.896,56	2,95%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.769.817,35	0,00	0,00	8.928.632,10	158.814,75	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.559.413,90	0,00	0,00	6.716.893,86	157.479,96	2,40%	2,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	6.111.962,82	0,00	0,00	6.260.671,74	148.708,92	2,43%	2,43%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	9.617.750,50	0,00	4.953.285,48	4.751.105,37	86.640,35	0,90%	1,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.605.116,38	0,00	0,00	3.652.287,09	47.170,71	1,31%	1,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	583.387,32	0,00	0,00	597.481,23	14.093,91	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	656.517,77	12.650,00	0,00	676.549,96	7.382,19	1,10%	1,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	657.777,36	151.897,46	500.000,05	316.444,96	6.770,19	0,84%	1,14%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	3.704.094,85	0,00	3.710.853,67	6.758,82	0,18%	2,35%
				Total Renda Fixa	2.466.266,47	2,08%	

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	5.369.603,22	0,00	0,00	6.149.917,22	780.314,00	14,53%	14,53%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.087.031,43	662.813,91	0,00	4.196.307,00	446.461,66	11,91%	12,81%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.589.305,19	0,00	0,00	2.921.061,91	331.756,72	12,81%	12,81%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	598.026,17	0,00	15.950,00	687.597,94	105.521,77	17,65%	34,23%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	480.000,00	0,00	486.841,92	6.841,92	1,43%	3,77%
				Total Renda Variável	1.670.896,07	13,08%	

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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	19.771.645,43	0,00	0,00	24.213.313,05	4.441.667,62	22,46%	22,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.839.951,68	0,00	0,00	22.390.338,52	2.550.386,84	12,85%	12,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.196.698,16	22.499.462,23	1.400.000,00	25.941.977,31	1.645.816,92	6,40%	11,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.740.628,90	171.342,05	0,00	8.928.632,10	1.016.661,15	12,85%	13,07%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.025.324,98	0,00	274.544,95	5.618.419,29	867.639,26	17,27%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA ...	18.503.917,37	0,00	19.348.727,53	0,00	844.810,16	4,57%	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.230.202,05	0,00	0,00	7.033.732,59	803.530,54	12,90%	12,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	5.816.256,79	0,00	308.092,40	6.260.671,74	752.507,35	12,94%	13,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.041.014,11	0,00	0,00	6.716.893,86	675.879,75	11,19%	11,19%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	10.267.525,31	11.084.646,87	17.265.588,43	4.751.105,37	664.521,62	3,11%	5,81%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	3.461.619,66	0,00	3.652.287,09	190.667,43	5,51%	6,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.148.631,79	0,00	3.293.332,27	0,00	144.700,48	4,60%	22,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	571.203,30	0,00	31.537,04	597.481,23	57.814,97	10,12%	10,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,00	1.801.997,02	1.540.000,17	316.444,96	54.448,11	3,02%	5,76%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	457.491,42	184.798,79	0,00	676.549,96	34.259,75	5,33%	5,72%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	3.704.094,85	0,00	3.710.853,67	6.758,82	0,18%	13,69%
				Total Renda Fixa	14.752.070,77	9,87%	

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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.971.725,69	1.479.330,66	0,00	6.149.917,22	1.698.860,87	38,17%	39,84%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.163.076,06	0,00	0,00	2.921.061,91	757.985,85	35,04%	35,04%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	3.561.977,79	0,00	4.196.307,00	634.329,21	17,81%	45,27%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	582.008,45	0,00	46.750,00	687.597,94	152.339,49	26,17%	47,62%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	480.000,00	0,00	486.841,92	6.841,92	1,43%	18,08%
				Total Renda Variável	3.250.357,34	29,04%	