

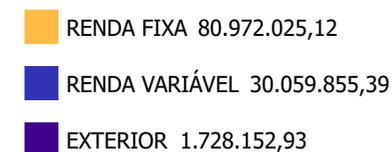
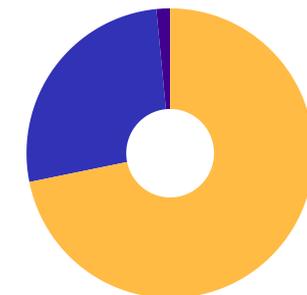
Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º trimestre e ano de 2019

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	18.262.337,40	16,20%	580	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	111.781,07	0,10%	1.198	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.278.034,89	3,79%	78	1,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	19.412.773,88	17,22%	695	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.079.386,43	0,96%	964	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	3.816.329,50	3,38%	362	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	9.400.873,24	8,34%	949	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.194.549,63	14,36%	1.361	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.972.096,99	4,41%	314	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.443.862,09	3,05%	443	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	8.152.998,16	7,23%	104	1,50%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.989.729,36	5,31%	4.665	2,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.002.498,18	6,21%	12.392	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	6.426.010,73	5,70%	955	1,29%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC M...	D+2	02/01/2020	2.258.703,88	2,00%	730	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	229.915,08	0,20%	18.924	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.728.152,93	1,53%	67	0,26%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		81.408,75	0,07%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			112.760.033,44				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			81.408,75				Artigo 6º
PL Total			112.841.442,19				

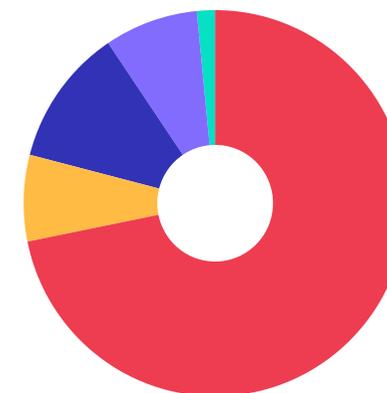
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2019)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2019			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	112.760.033,44
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	80.972.025,12	71,81%	40,00%	55,00%	100,00%	31.788.008,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	112.760.033,44
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.638.001,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	67.656.020,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	67.656.020,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	45.104.013,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	45.104.013,38
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	22.552.006,69
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	16.914.005,02
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	16.914.005,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	5.638.001,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	5.638.001,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.638.001,67
Total Renda Fixa	100,00%	80.972.025,12	71,81%	40,00%	80,00%	570,00%	



Enquadramento 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%	8.152.998,16	7,23%	0,00%	3,00%	30,00%	25.675.011,87
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	33.828.010,03
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	12.992.227,54	11,52%	0,00%	7,00%	20,00%	9.559.779,15
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	22.552.006,69
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.914.629,69	7,91%	0,00%	5,00%	10,00%	2.361.373,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.638.001,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	5.638.001,67
Total Renda Variável	30,00%	30.059.855,39	26,66%	0,00%	20,00%	120,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2019			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.728.152,93	1,53%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.728.152,93
Total Exterior	10,00%	1.728.152,93	1,53%	0,00%	0,00%	0,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2019)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	87.849.176,20	77,91	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.374.118,47	16,29	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	4.278.034,89	3,79	0,04
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	2.258.703,88	2,00	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, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	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 I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	8.684.714,61	7,70	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	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)	0,91%	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%	1,21%	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%	0,74%	0,02%
IRF-M 1+ (Benchmark)	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%	1,35%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,60%	30,37%	3,02%	7,64%	30,37%	50,45%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,56%	29,74%	2,85%	7,41%	29,74%	49,17%	4,25%	0,10%
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%	0,07%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,55%	1,33%	3,22%	6,55%	13,80%	0,07%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,88%	21,03%	2,79%	6,52%	21,03%	35,18%	2,68%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,99%	22,59%	2,70%	6,52%	22,59%	38,33%	2,80%	0,07%

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
IRF-M (Benchmark)	0,62%	12,03%	1,86%	4,72%	12,03%	24,05%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,61%	11,68%	1,81%	4,59%	11,68%	23,64%	0,93%	0,03%
IPCA (Benchmark)	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,59%	16,43%	1,80%	4,97%	16,43%	25,53%	0,93%	0,04%

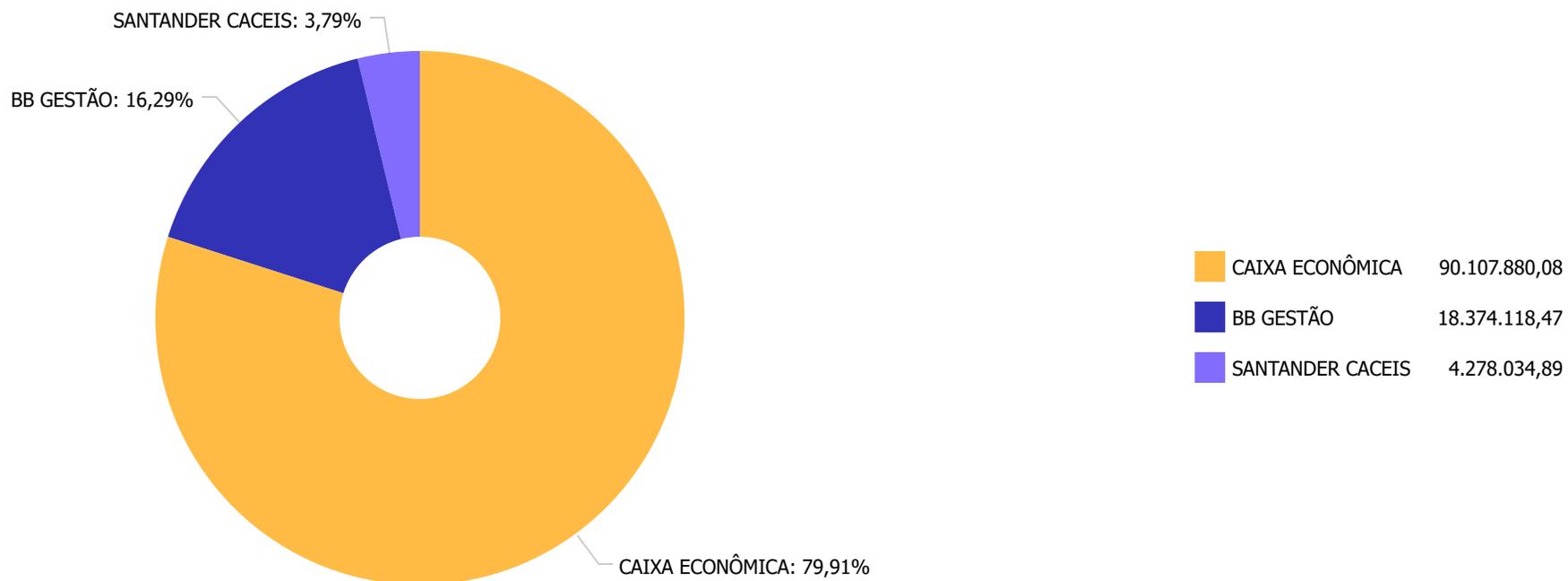
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,52%	35,67%	5,85%	16,89%	35,67%	51,98%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,76%	34,46%	5,54%	16,36%	34,46%	48,15%	4,69%	0,15%
IDIV (Benchmark)	9,99%	45,16%	14,28%	22,33%	45,16%	68,32%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	12,21%	41,75%	18,02%	24,77%	41,75%	54,70%	4,65%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6,84%	31,00%	10,36%	14,33%	31,00%	50,03%	4,64%	0,12%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,55%	54,75%	20,34%	31,86%	54,75%	62,50%	5,09%	0,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-4,63%	4,82%	0,82%	2,15%	4,82%	-	5,28%	0,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,33%	7,98%	1,53%	3,54%	7,98%	-	0,16%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,22%	13,70%	4,58%	6,93%	13,70%	22,92%	1,53%	0,03%

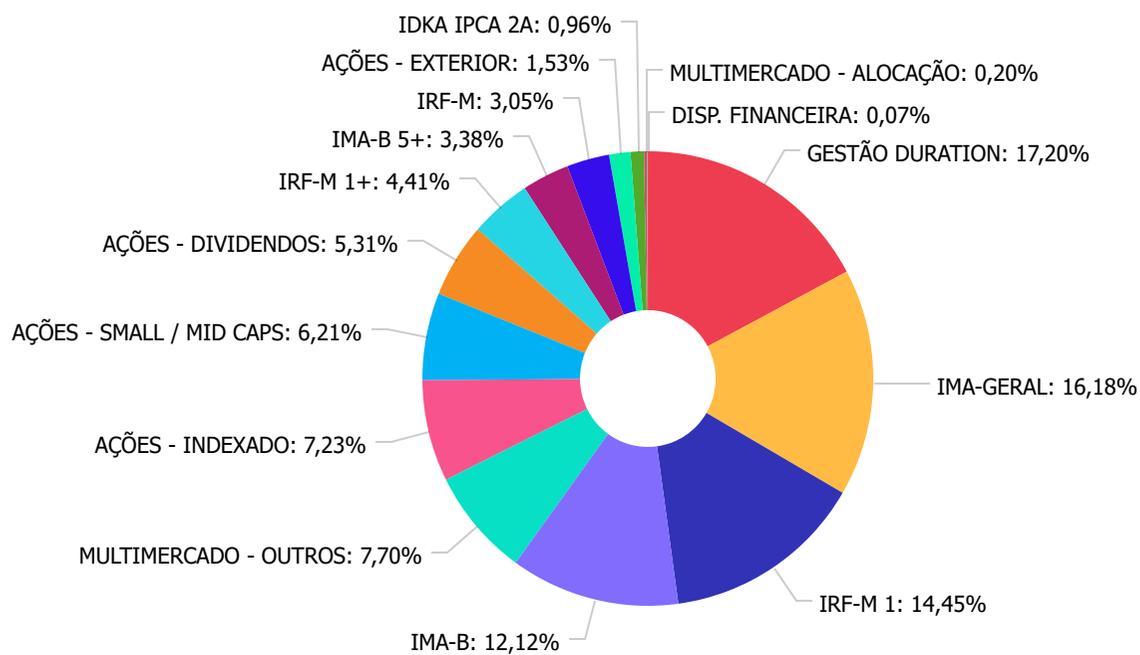
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,52%	35,67%	5,85%	16,89%	35,67%	51,98%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,76%	34,46%	5,54%	16,36%	34,46%	48,15%	4,69%	0,15%

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



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

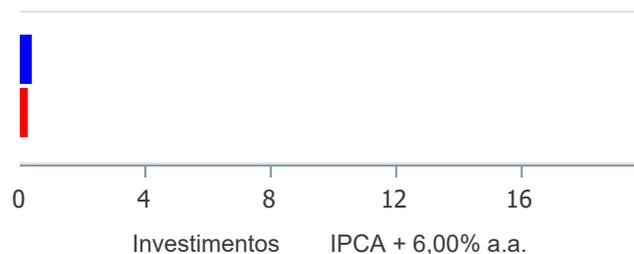


GESTÃO DURATION	19.412.773,88
IMA-GERAL	18.262.337,40
IRF-M 1	16.306.330,70
IMA-B	13.678.908,13
MULTIMERCADO - OUTROS	8.684.714,61
AÇÕES - INDEXADO	8.152.998,16
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.002.498,18
AÇÕES - DIVIDENDOS	5.989.729,36
IRF-M 1+	4.972.096,99
IMA-B 5+	3.816.329,50
IRF-M	3.443.862,09
AÇÕES - EXTERIOR	1.728.152,93
IDKA IPCA 2A	1.079.386,43
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	229.915,08
DISP. FINANCEIRA	81.408,75

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	94.068.096,09	3.999.840,37	3.523.385,24	96.173.379,33	1.628.828,11	1.628.828,11	1,72%	1,72%	0,83%	0,83%	207,16%	1,15%
Fevereiro	96.173.379,33	19.021.010,82	19.088.614,69	96.405.274,98	299.499,52	1.928.327,63	0,31%	2,04%	0,90%	1,73%	117,58%	1,43%
Março	96.405.274,98	10.421.973,44	9.036.000,00	98.401.298,73	610.050,31	2.538.377,94	0,62%	2,68%	1,19%	2,95%	90,75%	2,75%
Abril	98.401.298,73	1.808.180,95	1.100.100,00	99.967.714,51	858.334,83	3.396.712,77	0,87%	3,57%	1,06%	4,04%	88,26%	1,53%
Mai	99.967.714,51	14.221.435,99	13.143.600,00	102.629.401,61	1.583.851,11	4.980.563,88	1,57%	5,19%	0,64%	4,71%	110,25%	2,26%
Junho	102.629.401,61	2.266.488,24	2.015.944,89	105.285.758,05	2.405.813,09	7.386.376,97	2,34%	7,65%	0,45%	5,18%	147,72%	2,04%
Julho	105.285.758,05	6.974.626,59	6.352.672,17	107.369.341,34	1.461.628,87	8.848.005,84	1,38%	9,13%	0,72%	5,94%	153,79%	1,59%
Agosto	107.369.341,34	3.825.934,36	4.132.600,00	107.229.424,45	166.748,75	9.014.754,59	0,16%	9,30%	0,62%	6,60%	141,03%	3,10%
Setembro	107.229.424,45	1.660.930,66	1.324.384,14	109.537.128,50	1.971.157,53	10.985.912,12	1,83%	11,31%	0,45%	7,07%	159,86%	1,88%
Outubro	109.537.128,50	852.528,11	1.119.200,00	111.262.768,87	1.992.312,26	12.978.224,38	1,82%	13,33%	0,63%	7,75%	171,98%	2,33%
Novembro	111.262.768,87	533.520,11	1.178.500,00	110.644.792,38	27.003,40	13.005.227,78	0,02%	13,36%	0,98%	8,80%	151,75%	2,03%
Dezembro	110.644.792,38	971.488,91	1.466.000,00	112.760.033,44	2.609.752,15	15.614.979,93	2,36%	16,03%	1,64%	10,59%	151,39%	2,03%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1

IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade 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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.721.207,46	0,00	0,00	3.816.329,50	95.122,04	2,56%	2,56%	4,25%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.217.399,38	0,00	0,00	9.400.873,24	183.473,86	1,99%	1,99%	2,80%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	4.198.965,28	0,00	0,00	4.278.034,89	79.069,61	1,88%	1,88%	2,68%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.067.646,66	0,00	0,00	1.079.386,43	11.739,77	1,10%	1,10%	0,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.088.900,77	0,00	0,00	18.262.337,40	173.436,63	0,96%	0,96%	1,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.937.533,90	0,00	0,00	4.972.096,99	34.563,09	0,70%	0,70%	1,35%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.422.960,95	0,00	0,00	3.443.862,09	20.901,14	0,61%	0,61%	0,93%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	19.298.259,12	0,00	0,00	19.412.773,88	114.514,76	0,59%	0,59%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.660.916,53	0,00	532.000,00	16.194.549,63	65.633,10	0,39%	0,40%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	159.367,17	885.339,27	934.000,00	111.781,07	1.074,63	0,10%	0,40%	0,07%
Total Renda Fixa	80.773.157,22	885.339,27	1.466.000,00	80.972.025,12	779.528,63	0,97%		1,31%

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6.145.334,38	86.149,64	0,00	7.002.498,18	771.014,16	12,37%	12,55%	5,09%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.337.819,12	0,00	0,00	5.989.729,36	651.910,24	12,21%	12,21%	4,65%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	7.631.066,06	0,00	0,00	8.152.998,16	521.932,10	6,84%	6,84%	4,64%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	224.919,69	0,00	0,00	229.915,08	4.995,39	2,22%	2,22%	1,53%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	6.405.096,78	0,00	0,00	6.426.010,73	20.913,95	0,33%	0,33%	0,16%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	2.368.295,39	0,00	0,00	2.258.703,88	-109.591,51	-4,63%	-4,63%	5,28%
Total Renda Variável	28.112.531,42	86.149,64	0,00	30.059.855,39	1.861.174,33	6,60%		3,81%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.759.103,74	0,00	0,00	1.728.152,93	-30.950,81	-1,76%	-1,76%	4,69%
Total Exterior	1.759.103,74	0,00	0,00	1.728.152,93	-30.950,81	-1,76%		4,69%

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.976.741,02	0,00	1.058.000,00	18.262.337,40	343.596,38	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	19.070.063,70	0,00	0,00	19.412.773,88	342.710,18	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	9.153.626,88	0,00	0,00	9.400.873,24	247.246,36	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.508.528,13	0,00	532.000,00	16.194.549,63	218.021,50	1,32%	1,33%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	4.162.064,86	0,00	0,00	4.278.034,89	115.970,03	2,79%	2,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.710.448,21	0,00	0,00	3.816.329,50	105.881,29	2,85%	2,85%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.871.499,90	0,00	0,00	4.972.096,99	100.597,09	2,07%	2,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.382.528,21	0,00	0,00	3.443.862,09	61.333,88	1,81%	1,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.054.079,83	0,00	0,00	1.079.386,43	25.306,60	2,40%	2,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	94.200,24	2.185.285,35	2.173.700,00	111.781,07	5.995,48	0,26%	1,31%
				Total Renda Fixa	1.566.658,79	1,88%	

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
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.747.379,56	86.149,64	0,00	7.002.498,18	1.168.968,98	20,04%	20,34%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.075.306,73	0,00	0,00	5.989.729,36	914.422,63	18,02%	18,02%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	7.304.017,87	86.102,14	0,00	8.152.998,16	762.878,15	10,32%	10,36%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	6.329.020,65	0,00	0,00	6.426.010,73	96.990,08	1,53%	1,53%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.637.493,56	0,00	0,00	1.728.152,93	90.659,37	5,54%	5,54%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	2.240.276,13	0,00	0,00	2.258.703,88	18.427,75	0,82%	0,82%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	219.853,02	0,00	0,00	229.915,08	10.062,06	4,58%	4,58%
				Total Renda Variável	3.062.409,02	10,66%	

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.640.055,08	8.562.065,44	0,00	19.412.773,88	2.210.653,36	12,85%	16,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	17.493.526,78	1.058.000,00	18.262.337,40	1.826.810,62	10,44%	13,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	35.183.026,26	140.358,12	20.532.000,00	16.194.549,63	1.403.165,25	3,97%	6,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	803.242,97	7.605.491,96	0,00	9.400.873,24	992.138,31	11,80%	22,59%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	507.157,04	3.105.279,81	0,00	4.278.034,89	665.598,04	18,43%	21,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.512.124,55	0,00	7.000.000,00	1.079.386,43	567.261,88	7,55%	11,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	518.786,39	4.000.000,00	0,00	4.972.096,99	453.310,60	10,03%	13,89%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.083.613,89	0,00	0,00	3.443.862,09	360.248,20	11,68%	11,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	3.569.944,89	0,00	3.816.329,50	246.384,61	6,90%	29,73%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	11.557.995,74	10.522.809,98	22.124.084,81	111.781,07	155.060,16	0,70%	6,49%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.935.318,63	0,00	2.024.213,37	0,00	88.894,74	4,59%	22,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.525.506,02	0,00	1.569.944,89	0,00	44.438,87	2,91%	5,72%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	456.704,08	0,00	477.576,16	0,00	20.872,08	4,57%	22,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.723.432,35	0,00	1.739.736,05	0,00	16.303,70	0,95%	5,74%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	967.827,68	0,00	983.467,00	0,00	15.639,32	1,62%	11,79%
BNB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	3.093.297,02	0,00	3.105.279,81	0,00	11.982,79	0,39%	5,61%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	427.915,09	0,00	435.437,40	0,00	7.522,31	1,76%	11,20%
				Total Renda Fixa	9.086.284,84	6,84%	

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.027.819,45	2.629.200,71	0,00	7.002.498,18	2.345.478,02	50,36%	54,75%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.842.181,15	2.500.000,00	0,00	5.989.729,36	1.647.548,21	37,94%	41,75%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	1.492.586,78	5.290.903,14	0,00	8.152.998,16	1.369.508,24	20,19%	31,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	5.951.117,77	0,00	0,00	6.426.010,73	474.892,96	7,98%	7,98%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.474.512,64	0,00	1.200.589,47	1.728.152,93	454.229,76	18,36%	34,46%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	2.154.930,62	0,00	0,00	2.258.703,88	103.773,26	4,82%	4,82%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,00	564.962,00	632.029,81	0,00	67.067,81	11,87%	29,50%
CAIXA IBOVESPA FIC AÇÕES	188.944,89	355.042,03	598.642,36	0,00	54.655,44	10,05%	26,39%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	218.373,69	0,00	229.915,08	11.541,39	5,29%	13,70%
				Total Renda Variável	6.528.695,09	25,85%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.