

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

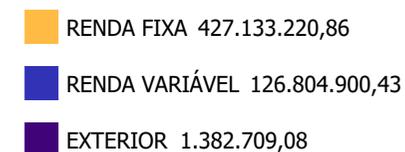
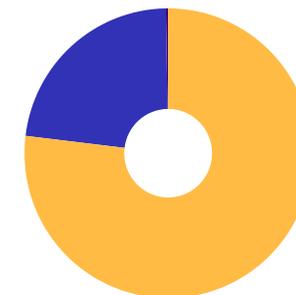
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.431.343,20	0,26%	1.225	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.291.627,92	0,23%	322	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	38.454.187,78	6,92%	899	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	105.912.489,30	19,07%	1.005	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	18.119.116,01	3,26%	1.361	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.417.891,00	0,26%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	80.705.836,70	14,53%	976	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	13.970.471,82	2,52%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	99.504.718,89	17,92%	885	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.239.197,94	0,58%	641	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	31.232.028,33	5,62%	102	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	15.385.384,41	2,77%	431	0,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	4.906.016,40	0,88%	76	2,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	11.562.911,16	2,08%	74	1,85%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.671.765,82	0,30%	1.656	0,13%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	22.958.399,55	4,13%	95	1,99%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	32.746.647,06	5,90%	116	4,25%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	18.600.913,99	3,35%	68	5,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	13.147.253,79	2,37%	2.413	1,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	17.273.487,64	3,11%	118	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.888.178,38	0,52%	15.069	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.374.411,56	0,61%	18.236	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.134.279,31	0,56%	97	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.148.283,72	1,65%	18.848	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	1.861.279,61	0,34%		0,08%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.382.709,08	0,25%	191	0,07%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			555.320.830,37				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	360.807.682,62	64,97%	30,00%	60,00%	90,00%	138.981.064,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	166.596.249,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	49.856.610,68	8,98%	1,00%	13,00%	40,00%	172.271.721,47
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.766.041,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.766.041,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	16.468.927,56	2,97%	1,00%	2,50%	5,00%	11.297.113,96
Total Renda Fixa	100,00%	427.133.220,86	76,92%	32,00%	76,50%	175,00%	



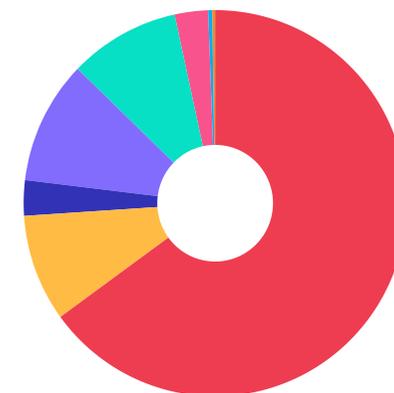
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	57.376.812,43	10,33%	5,00%	12,00%	15,00%	25.921.312,13
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	51.909.833,80	9,35%	0,00%	5,00%	10,00%	3.622.249,24
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	15.656.974,59	2,82%	1,00%	5,50%	10,00%	39.875.108,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.766.041,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.861.279,61	0,34%	0,00%	0,50%	5,00%	25.904.761,91
Total Renda Variável	35,00%	126.804.900,43	22,83%	6,00%	23,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.766.041,52
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.766.041,52
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.382.709,08	0,25%	0,00%	0,50%	5,00%	26.383.332,44
Total Exterior	10,00%	1.382.709,08	0,25%	0,00%	0,50%	15,00%	



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	490.746.295,71	88,37	0,09
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.439.767,41	8,18	0,00
VINCI PARTNERS	17.273.487,64	3,11	0,01
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.861.279,61	0,34	0,56

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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	360.807.682,62	64,97	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	49.856.610,68	8,98	1,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	16.468.927,56	2,97	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	57.376.812,43	10,33	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	51.909.833,80	9,35	1,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	15.656.974,59	2,82	1,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.861.279,61	0,34	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.382.709,08	0,25	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,01%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,51%	5,50%	10,53%	11,36%	5,50%	37,54%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,56%	5,23%	10,56%	11,28%	5,23%	36,52%	0,03%	0,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	3,47%	0,63%	0,99%	3,47%	10,19%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,82%	7,75%	3,32%	4,57%	7,75%	21,60%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,84%	6,06%	7,13%	8,09%	6,06%	30,02%	0,02%	0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	5,61%	2,89%	3,91%	5,61%	16,66%	0,01%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36%	2,42%	0,64%	1,03%	2,42%	8,27%	0,00%	0,00%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,89%	7,96%	3,70%	5,15%	7,96%	21,14%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	7,76%	2,91%	4,60%	7,76%	22,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,78%	7,59%	2,87%	3,90%	7,59%	25,32%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,01%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	-	3,66%	3,62%	-	-	0,01%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,00%	-	1,57%	1,56%	-	-	0,00%	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	9,42%	3,62%	26,47%	26,00%	3,62%	33,83%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9,07%	1,51%	25,08%	24,45%	1,51%	31,39%	0,07%	0,43%
IGC (Benchmark)	8,34%	5,19%	23,19%	24,14%	5,19%	45,71%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8,75%	2,28%	24,40%	23,92%	2,28%	36,95%	0,07%	0,43%
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	9,24%	2,75%	25,53%	24,92%	2,75%	34,60%	0,07%	0,42%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7,65%	1,18%	18,83%	18,56%	1,18%	-	0,06%	0,44%
SMLL (Benchmark)	7,52%	-0,65%	22,54%	25,33%	-0,65%	57,16%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7,60%	-3,23%	21,53%	23,20%	-3,23%	49,75%	0,06%	0,47%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,56%	2,52%	6,28%	5,81%	2,52%	16,57%	0,02%	0,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,70%	3,52%	4,23%	4,60%	3,52%	22,23%	0,01%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,08%	2,38%	21,02%	21,77%	2,38%	54,11%	0,06%	0,42%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	-0,10%	-0,04%	-0,08%	-0,10%	-0,10%	-	-

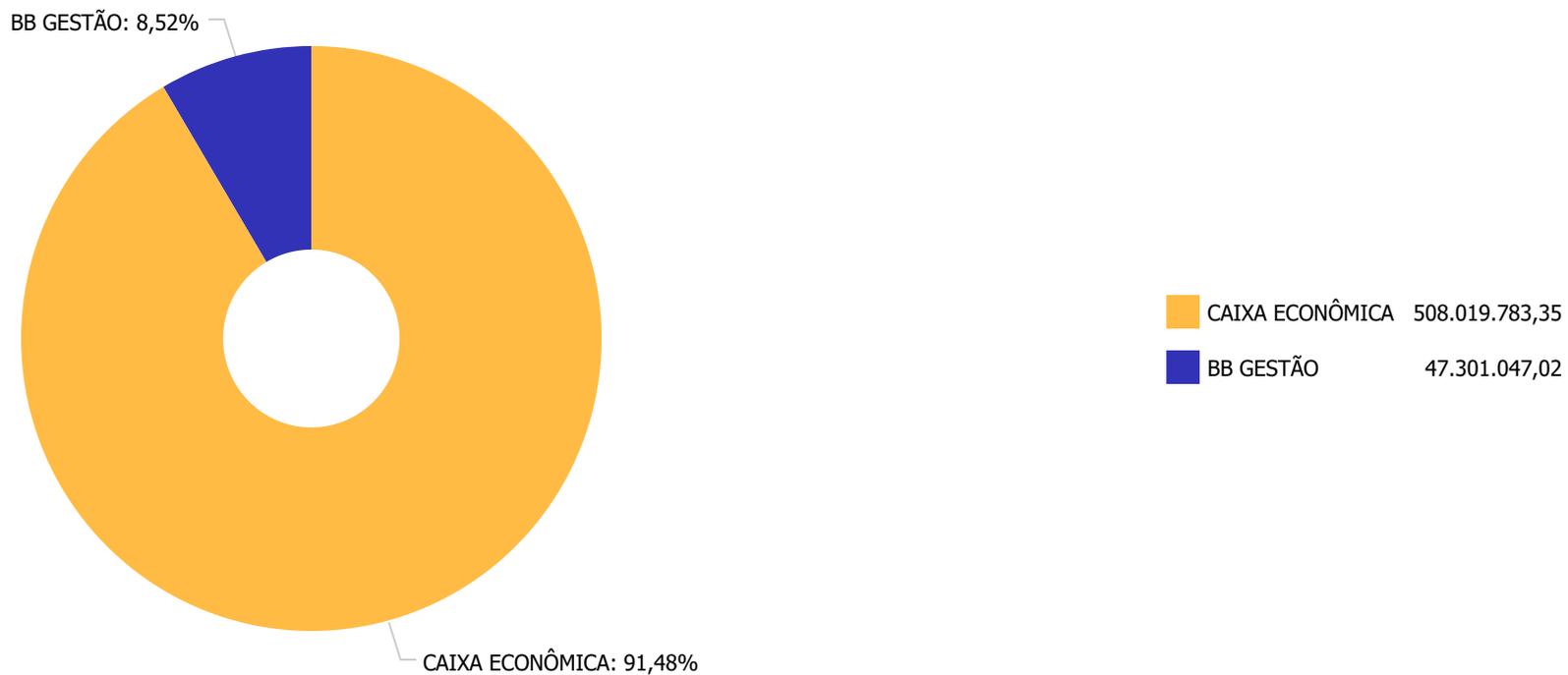
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	6,49%	2,72%	19,96%	19,14%	2,72%	-	0,05%	0,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,26%	3,04%	4,08%	4,74%	3,04%	-	0,01%	0,11%

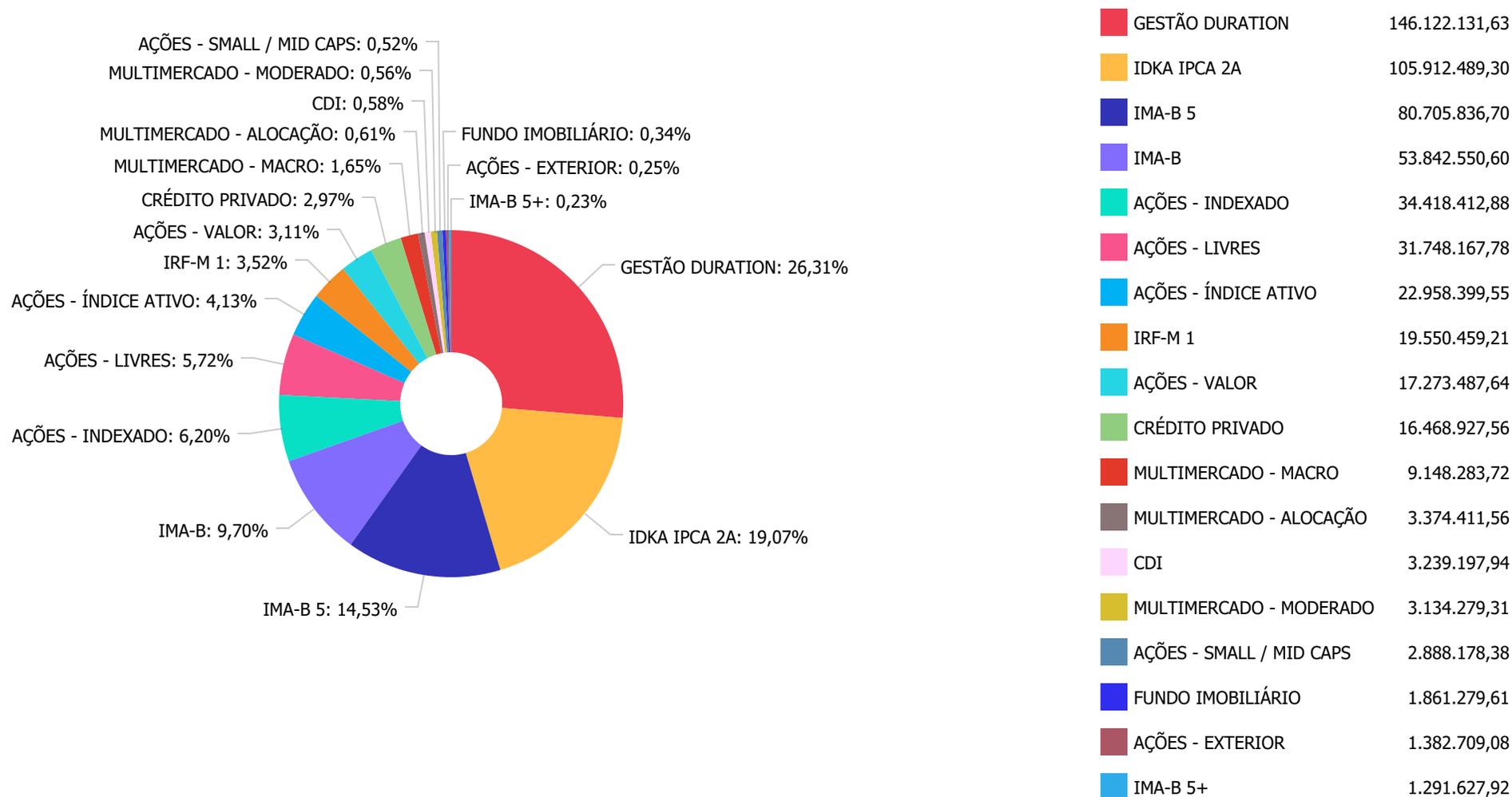
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,93%	54,01%	1,70%	16,29%	54,01%	108,94%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,69%	54,76%	1,31%	16,49%	54,76%	108,09%	0,07%	0,22%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)



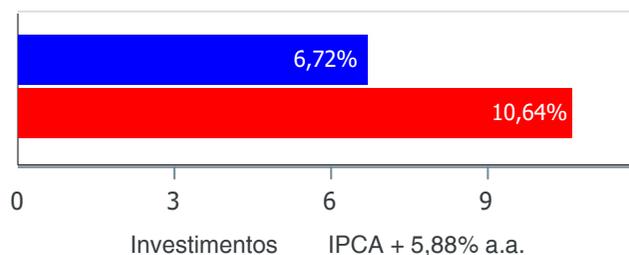
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	480.726.013,95	31.194.230,79	34.435.535,00	479.118.394,83	1.633.685,09	1.633.685,09	0,34%	0,34%	0,71%	0,71%	47,79%	1,80%
Fevereiro	479.118.394,83	47.123.300,03	42.981.918,47	478.272.443,50	-4.987.332,89	-3.353.647,80	-1,03%	-0,70%	0,66%	1,38%	-50,57%	3,34%
Março	478.272.443,50	11.262.131,93	9.530.400,00	447.969.637,61	-32.034.537,82	-35.388.185,62	-6,67%	-7,32%	0,57%	1,95%	-374,77%	14,39%
Abril	447.969.637,61	16.153.351,94	11.828.900,00	461.799.607,99	9.505.518,44	-25.882.667,18	2,10%	-5,38%	0,14%	2,10%	-255,98%	7,58%
Mai	461.799.607,99	26.415.208,16	20.544.134,69	480.300.710,11	12.630.028,65	-13.252.638,53	2,70%	-2,82%	0,07%	2,17%	-129,70%	4,19%
Junho	480.300.710,11	6.958.586,09	5.572.400,00	493.784.579,25	12.097.683,05	-1.154.955,48	2,51%	-0,38%	0,74%	2,93%	-12,95%	3,42%
Julho	493.784.579,25	11.425.233,31	5.438.100,00	513.334.591,85	13.562.879,29	12.407.923,81	2,71%	2,32%	0,88%	3,84%	60,54%	2,75%
Agosto	513.334.591,85	8.347.272,93	8.546.182,58	508.317.383,65	-4.818.298,55	7.589.625,26	-0,94%	1,36%	0,72%	4,59%	29,74%	2,72%
Setembro	508.317.383,65	7.716.520,61	4.468.506,55	505.822.370,25	-5.743.027,46	1.846.597,80	-1,12%	0,23%	1,12%	5,76%	3,92%	3,59%
Outubro	505.822.370,25	7.041.346,59	6.933.820,02	505.418.198,23	-511.698,59	1.334.899,21	-0,10%	0,12%	1,34%	7,18%	1,74%	3,20%
Novembro	505.418.198,23	32.451.480,79	23.544.400,00	532.038.634,83	17.713.355,81	19.048.255,02	3,44%	3,57%	1,35%	8,62%	41,44%	2,73%
Dezembro	532.038.634,83	11.724.075,12	4.814.500,00	555.320.830,37	16.372.620,42	35.420.875,44	3,04%	6,72%	1,86%	10,64%	63,16%	1,90%

Investimentos x Meta Atuarial



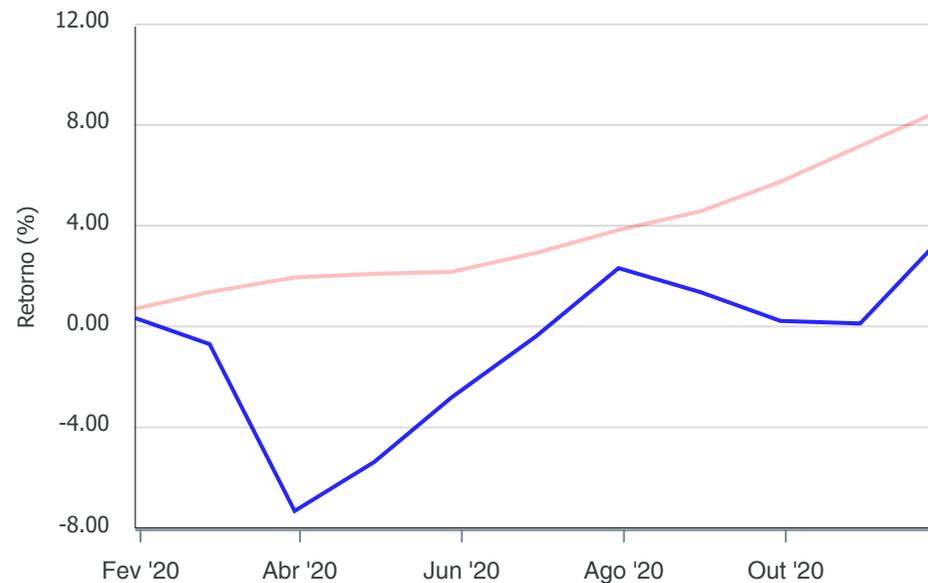
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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/2020

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...	1.200.810,84	0,00	0,00	1.291.627,92	90.817,08	7,56%	7,56%	3,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	36.678.770,37	0,00	0,00	38.454.187,78	1.775.417,41	4,84%	4,84%	2,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	13.899.485,04	1.103.404,86	0,00	15.385.384,41	382.494,51	2,55%	2,70%	1,09%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.349.007,74	0,00	0,00	11.562.911,16	213.903,42	1,88%	1,88%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	79.263.405,01	0,00	0,00	80.705.836,70	1.442.431,69	1,82%	1,82%	0,74%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.820.272,15	0,00	0,00	4.906.016,40	85.744,25	1,78%	1,78%	0,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	104.190.570,29	0,00	0,00	105.912.489,30	1.721.919,01	1,65%	1,65%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	98.207.725,73	0,00	0,00	99.504.718,89	1.296.993,16	1,32%	1,32%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	13.803.200,98	0,00	0,00	13.970.471,82	167.270,84	1,21%	1,21%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.400.988,47	0,00	0,00	1.417.891,00	16.902,53	1,21%	1,21%	0,64%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	30.922.111,30	0,00	0,00	31.232.028,33	309.917,03	1,00%	1,00%	0,37%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.227.491,70	0,00	0,00	3.239.197,94	11.706,24	0,36%	0,36%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.426.877,87	0,00	100,00	1.431.343,20	4.565,33	0,32%	0,31%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.264.303,00	10.620.670,26	4.800.000,00	18.119.116,01	34.142,75	0,15%	0,28%	0,10%
Total Renda Fixa	412.655.020,49	11.724.075,12	4.800.100,00	427.133.220,86	7.554.225,25	1,80%		0,76%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	29.976.204,12	0,00	0,00	32.746.647,06	2.770.442,94	9,24%	9,24%	7,04%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	15.835.913,74	0,00	0,00	17.273.487,64	1.437.573,90	9,08%	9,08%	5,56%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	21.049.492,27	0,00	0,00	22.958.399,55	1.908.907,28	9,07%	9,07%	7,10%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.537.276,15	0,00	0,00	1.671.765,82	134.489,67	8,75%	8,75%	6,71%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	12.213.506,75	0,00	0,00	13.147.253,79	933.747,04	7,65%	7,65%	5,83%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.684.192,05	0,00	0,00	2.888.178,38	203.986,33	7,60%	7,60%	6,40%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	17.467.672,24	0,00	0,00	18.600.913,99	1.133.241,75	6,49%	6,49%	5,37%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.290.161,34	0,00	0,00	3.374.411,56	84.250,22	2,56%	2,56%	1,80%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.995.310,53	0,00	0,00	9.148.283,72	152.973,19	1,70%	1,70%	0,93%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.094.518,74	0,00	0,00	3.134.279,31	39.760,57	1,28%	1,26%	1,39%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.866.181,21	0,00	14.400,00	1.861.279,61	9.498,40	0,51%	0,00%	-
Total Renda Variável	118.010.429,14	0,00	14.400,00	126.804.900,43	8.808.871,29	7,46%		5,72%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE RIO BRANCO
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Dezembro / 2020)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.373.185,20	0,00	0,00	1.382.709,08	9.523,88	0,69%	0,69%	7,07%
Total Renda Variável	1.373.185,20	0,00	0,00	1.382.709,08	9.523,88	0,69%		7,07%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

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...	84.013.205,34	18.981.659,88	0,00	105.912.489,30	2.917.624,08	2,83%	3,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	78.114.018,83	0,00	0,00	80.705.836,70	2.591.817,87	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	35.894.175,65	0,00	0,00	38.454.187,78	2.560.012,13	7,13%	7,13%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	97.514.121,19	0,00	0,00	99.504.718,89	1.990.597,70	2,04%	2,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.573.519,61	3.301.836,48	0,00	15.385.384,41	510.028,32	3,43%	3,66%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	30.750.539,81	0,00	0,00	31.232.028,33	481.488,52	1,57%	1,57%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.150.848,35	0,00	0,00	11.562.911,16	412.062,81	3,70%	3,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	20.895.367,37	0,00	20.000.000,00	1.291.627,92	396.260,55	1,90%	10,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	13.575.910,25	0,00	0,00	13.970.471,82	394.561,57	2,91%	2,91%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.768.948,06	0,00	0,00	4.906.016,40	137.068,34	2,87%	2,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.414.491,18	25.386.161,40	11.740.000,00	18.119.116,01	58.463,43	0,20%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.378.016,61	0,00	0,00	1.417.891,00	39.874,39	2,89%	2,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.218.632,76	0,00	0,00	3.239.197,94	20.565,18	0,64%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.406.299,27	16.166,50	100,00	1.431.343,20	8.977,43	0,63%	0,63%
Total Renda Fixa					12.519.402,32	3,02%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	26.087.149,42	0,00	0,00	32.746.647,06	6.659.497,64	25,53%	25,53%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	18.354.615,57	0,00	0,00	22.958.399,55	4.603.783,98	25,08%	25,08%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	15.505.878,37	0,00	0,00	18.600.913,99	3.095.035,62	19,96%	19,96%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	14.273.368,50	0,00	0,00	17.273.487,64	3.000.119,14	21,02%	21,02%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	11.064.196,31	0,00	0,00	13.147.253,79	2.083.057,48	18,83%	18,83%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.376.517,37	0,00	0,00	2.888.178,38	511.661,01	21,53%	21,53%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.269.527,70	3.531.078,24	0,00	9.148.283,72	347.677,78	3,95%	4,23%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.343.860,35	0,00	0,00	1.671.765,82	327.905,47	24,40%	24,40%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.175.047,45	0,00	0,00	3.374.411,56	199.364,11	6,28%	6,28%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.010.527,46	0,00	0,00	3.134.279,31	123.751,85	4,11%	4,08%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.812.881,13	0,00	45.300,00	1.861.279,61	93.698,48	5,17%	-0,04%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	3.515.917,83	0,00	3.507.320,02	0,00	-8.597,81	-0,24%	-
				Total Renda Variável	21.036.954,75	19,24%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.364.788,51	0,00	0,00	1.382.709,08	17.920,57	1,31%	1,31%
				Total Exterior	17.920,57	1,31%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

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...	87.161.024,89	18.981.659,88	7.000.000,00	105.912.489,30	6.769.804,53	6,38%	8,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	93.287.509,66	0,00	0,00	99.504.718,89	6.217.209,23	6,66%	6,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	74.903.091,16	0,00	0,00	80.705.836,70	5.802.745,54	7,75%	7,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.456.400,66	35.000.000,00	0,00	38.454.187,78	1.997.787,12	5,48%	6,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	15.645.539,97	0,00	2.783.788,39	13.970.471,82	1.108.720,24	7,09%	7,76%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.710.382,14	0,00	0,00	11.562.911,16	852.529,02	7,96%	7,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	53.300.872,55	49.651.578,85	85.432.640,52	18.119.116,01	599.305,13	0,58%	3,63%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	30.690.447,52	0,00	31.232.028,33	541.580,81	1,76%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	14.989.634,16	0,00	15.385.384,41	395.750,25	2,64%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	49.867.999,00	0,00	47.000.000,00	3.239.197,94	371.198,94	0,74%	2,42%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.560.072,06	0,00	0,00	4.906.016,40	345.944,34	7,59%	7,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.983.724,49	0,00	2.699.412,66	1.417.891,00	133.579,17	3,35%	5,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.265.941,60	2.048.649,86	4.000.100,00	1.431.343,20	116.851,74	2,20%	3,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.227.220,22	20.000.000,00	20.000.000,00	1.291.627,92	-935.592,30	-4,21%	5,23%
Total Renda Fixa					24.317.413,76	6,04%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	26.392.420,37	3.738.561,43	0,00	32.746.647,06	2.615.665,26	8,68%	2,75%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3.248.538,64	12.886.373,98	0,00	18.600.913,99	2.466.001,37	15,28%	2,72%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.179.931,34	12.079.303,55	0,00	17.273.487,64	2.014.252,75	13,20%	2,38%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.189.247,66	8.000.000,00	0,00	13.147.253,79	1.958.006,13	17,50%	1,18%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	19.724.239,39	2.000.000,00	0,00	22.958.399,55	1.234.160,16	5,68%	1,51%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.306.074,37	3.531.078,24	0,00	9.148.283,72	311.131,11	3,52%	3,52%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.040.924,20	0,00	0,00	3.134.279,31	93.355,11	3,07%	3,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.291.396,20	0,00	0,00	3.374.411,56	83.015,36	2,52%	2,52%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	3.466.867,86	0,00	3.507.320,02	0,00	40.452,16	1,17%	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.634.544,54	0,00	0,00	1.671.765,82	37.221,28	2,28%	2,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	5.652.350,00	0,00	5.655.135,00	0,00	2.785,00	0,05%	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.229.700,98	214.774,71	560.400,72	1.861.279,61	-22.795,36	-0,93%	-0,09%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	3.000.676,11	0,00	2.888.178,38	-112.497,73	-3,75%	-3,23%
Total Renda Variável					10.720.752,60	9,24%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.382.709,08	382.709,08	38,27%	54,76%
				Total Exterior	382.709,08	38,27%	