

# 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	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.983.724,49	0,83%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	74.903.091,16	15,57%	923	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.645.539,97	3,25%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	87.161.024,89	18,12%	964	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.265.941,60	0,68%	1.198	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.456.400,66	0,30%	949	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	93.287.509,66	19,40%	695	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	53.300.872,55	11,08%	1.361	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.227.220,22	0,46%	362	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	49.867.999,00	10,37%	688	1,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	4.560.072,06	0,95%	76	2,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	10.710.382,14	2,23%	74	1,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	19.724.239,39	4,10%	86	1,71%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.634.544,54	0,34%	817	0,22%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVSPA FI AÇÕES	D+4	Não há	26.392.420,37	5,49%	104	4,86%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23 DU	Não há	3.179.931,34	0,66%	80	0,86%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25 du	Não há	3.189.247,66	0,66%	2.570	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15 du	Não há	3.248.538,64	0,68%	43	2,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	D+15	Não há	3.040.924,20	0,63%	30	7,61%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.291.396,20	0,68%	18.924	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVSPA II FIC MULTIMERCADO	D+2	02/01/2020	5.652.350,00	1,18%	730	2,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.306.074,37	1,10%	26.794	0,08%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

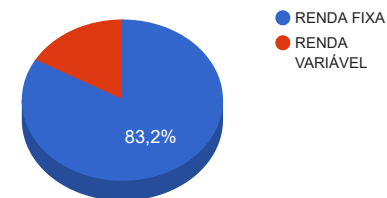
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	3.466.867,86	0,72%	955	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	2.444.475,69	0,51%		0,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>480.940.788,66</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.283,47				Artigo 6º
<b>Total</b>			<b>480.942.072,13</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2019)

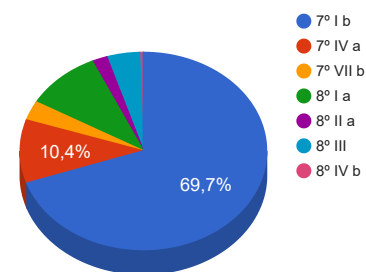
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	335.231.325,20	69,70%	15,00%	50,00%	90,00%	97.615.384,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	144.282.236,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	49.867.999,00	10,37%	5,00%	28,00%	35,00%	118.461.277,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	15.270.454,20	3,18%	1,00%	3,00%	5,00%	8.776.585,23
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	47.751.204,30	9,93%	2,00%	11,00%	15,00%	24.389.914,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	9.617.717,64	2,00%	0,00%	1,00%	5,00%	14.429.321,79
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	20.757.612,63	4,32%	1,00%	4,00%	10,00%	27.336.466,24
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.444.475,69	0,51%	0,00%	1,00%	5,00%	21.602.563,74
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	24.047.039,43
<b>Total Carteira</b>		<b>480.940.788,66</b>					

RENDA FIXA	400.371.061,87	83,25%
RENDA VARIÁVEL	80.571.010,26	16,75%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	335.231.325,20	69,70%	15,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	49.867.999,00	10,37%	5,00%	35,00%
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 "	15.270.454,20	3,18%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	47.751.204,30	9,93%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	9.617.717,64	2,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	20.757.612,63	4,32%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	2.444.475,69	0,51%	0,00%	5,00%
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>480.940.788,66</b>	<b>100,00%</b>	<b>24,00</b>	<b>215,00</b>

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

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)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	436.887.001,23	90,84%	0,09%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.240.132,74	7,33%	0,00%
VINCI PARTNERS	3.179.931,34	0,66%	0,01%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.444.475,69	0,51%	0,17%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	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%	29,73%	2,85%	7,41%	29,73%	49,17%	0,20%	4,249%	10,41%
IMA-B	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,99%	22,59%	2,70%	6,52%	22,59%	38,33%	0,20%	2,796%	6,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	10,46%	2,42%	4,56%	10,46%	21,28%	0,20%	0,515%	1,14%
IPCA + 6,00% ao ano	1,64%	10,59%	3,28%	5,15%	10,59%	21,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,47%	16,48%	2,64%	5,99%	16,48%	25,49%	0,20%	1,689%	3,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	13,34%	2,43%	5,23%	13,34%	33,37%	0,20%	0,897%	2,28%
IMA-B 5	1,24%	13,15%	2,62%	5,47%	13,15%	24,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,21%	12,85%	2,52%	5,31%	12,85%	23,77%	0,20%	1,015%	2,31%
IDKA IPCA 2 Anos	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%	0,20%	0,738%	1,60%
IPCA	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,10%	12,20%	2,43%	5,12%	12,20%	24,52%	0,20%	0,965%	1,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,59%	16,43%	1,80%	4,97%	16,43%	25,53%	0,002	0,931%	3,98%
IRF-M 1	0,42%	6,76%	1,38%	3,33%	6,76%	14,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,55%	1,33%	3,22%	6,55%	13,80%	0,20%	0,067%	0,39%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	6,49%	1,31%	3,18%	6,49%	13,69%	0,10%	0,069%	0,40%
CDI	0,37%	5,96%	1,24%	2,80%	5,96%	12,76%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,35%	5,72%	1,11%	2,62%	5,72%	12,30%	0,20%	0,012%	0,25%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

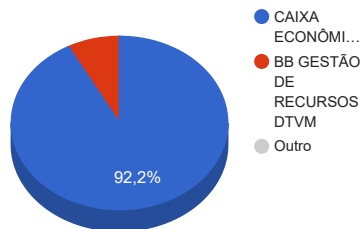
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	10,63%	35,98%	19,12%	21,76%	35,98%	43,62%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,30%	-	-
IGC	7,75%	38,53%	12,47%	19,53%	38,53%	54,76%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	7,56%	33,90%	11,66%	16,39%	33,90%	52,17%	1,00%	4,363%	11,99%
Ibovespa	6,85%	31,58%	10,41%	14,54%	31,58%	51,36%	-	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,30%	-	14,56%	23,24%	-	-	1,50%	3,966%	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	6,84%	31,00%	10,36%	14,33%	31,00%	50,03%	0,50%	4,638%	12,13%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,33%	7,98%	1,53%	3,54%	7,98%	-	1,60%	0,163%	1,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	-4,63%	4,82%	0,82%	2,15%	4,82%	-	1,60%	5,284%	6,37%
IBX-50	6,56%	29,15%	9,81%	13,17%	29,15%	47,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	7,09%	29,44%	10,57%	14,20%	29,44%	45,50%	0,70%	4,658%	12,51%
CDI	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%	1,00%	1,530%	3,39%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,09%	18,08%	3,77%	7,38%	18,08%	29,14%	0,50%	1,100%	3,47%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	12,22%	50,52%	18,18%	25,63%	50,52%	74,03%	1,72%	6,231%	16,79%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	10,74%	-	17,89%	-	-	-	2,00%	3,661%	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

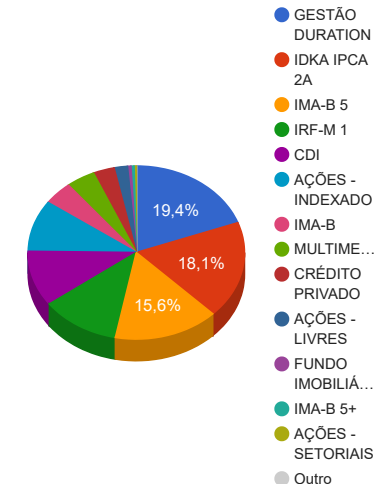
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,42%	-	-	-	-	-	1,50%	1,570%	-

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2019)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	443.256.180,23	92,16%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.684.608,43	7,84%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.283,47	0,00%

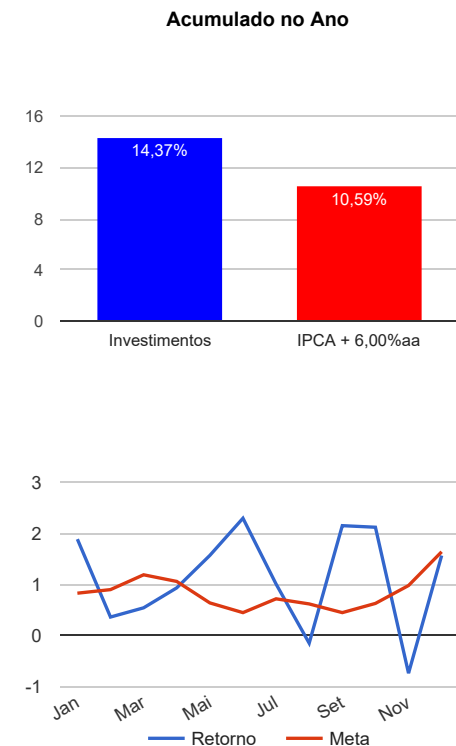


Sub-segmento	Valor	%
GESTÃO DURATION	93.287.509,66	19,40%
IDKA IPCA 2A	87.161.024,89	18,12%
IMA-B 5	74.903.091,16	15,57%
IRF-M 1	56.566.814,15	11,76%
CDI	49.867.999,00	10,37%
AÇÕES - INDEXADO	46.116.659,76	9,59%
IMA-B	21.085.665,12	4,38%
MULTIMERCADO	20.757.612,63	4,32%
CRÉDITO PRIVADO	15.270.454,20	3,18%
AÇÕES - LIVRES	9.617.717,64	2,00%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.444.475,69	0,51%
IMA-B 5+	2.227.220,22	0,46%
AÇÕES - SETORIAIS	1.634.544,54	0,34%
DISP. FINANCEIRA	1.283,47	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	389.532.929,62	58.367.638,88	53.792.246,74	401.544.963,80	7.436.642,04	1,89%	0,83%	226,90%	1,19%
Fevereiro	401.544.963,80	23.042.199,51	21.631.720,60	404.420.435,99	1.464.993,28	0,36%	0,90%	40,60%	1,66%
Março	404.420.435,99	4.412.933,34	3.043.627,51	407.996.984,75	2.207.242,93	0,54%	1,19%	45,57%	2,53%
Abril	407.996.984,75	8.549.454,06	5.129.100,00	415.261.525,93	3.844.187,12	0,93%	1,06%	88,19%	1,39%
Mai	415.261.525,93	20.321.082,78	18.142.980,00	423.988.964,20	6.549.335,49	1,57%	0,64%	244,89%	1,76%
Junho	423.988.964,20	45.064.216,91	43.206.000,00	435.624.895,69	9.777.714,58	2,30%	0,45%	509,85%	2,09%
Julho	435.624.895,69	13.861.849,71	11.823.695,15	442.078.386,06	4.415.335,81	1,01%	0,72%	139,30%	1,46%
Agosto	442.078.386,06	5.563.459,70	4.123.183,97	442.864.075,25	-654.586,54	-0,15%	0,62%	-23,78%	2,53%
Setembro	442.864.075,25	4.490.117,74	3.279.400,00	453.627.311,89	9.552.518,90	2,15%	0,45%	481,71%	1,69%
Outubro	453.627.311,89	6.114.499,75	3.293.400,00	466.125.528,64	9.677.117,00	2,12%	0,63%	334,52%	1,98%
Novembro	466.125.528,64	5.941.091,62	3.316.400,00	465.304.354,95	-3.445.865,31	-0,74%	0,98%	-75,33%	1,65%
Dezembro	465.304.354,95	111.022.815,03	102.802.962,45	480.940.788,66	7.416.581,13	1,57%	1,64%	95,37%	1,24%
Acumulado no ano					58.241.216,43	14,37%	10,59%	135,73%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.494.196,47	0,00	0,00	4.560.072,06	65.875,59	1,47%	1,69%	1,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	74.010.457,19	0,00	0,00	74.903.091,16	892.633,97	1,21%	1,01%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.471.672,90	0,00	0,00	15.645.539,97	173.867,07	1,12%	0,90%	1,12%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.593.654,01	0,00	0,00	10.710.382,14	116.728,13	1,10%	0,97%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	86.213.032,81	0,00	0,00	87.161.024,89	947.992,08	1,10%	0,74%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.947.520,42	0,00	0,00	3.983.724,49	36.204,07	0,92%	0,52%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.856.345,41	0,00	50.000.000,00	2.227.220,22	370.874,81	0,72%	4,25%	2,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.197.731,45	0,00	42.000.000,00	1.456.400,66	258.669,21	0,60%	2,80%	1,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	92.737.212,40	0,00	0,00	93.287.509,66	550.297,26	0,59%	0,93%	0,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.310.298,97	945.506,40	0,00	3.265.941,60	10.136,23	0,31%	0,07%	0,40%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.365.286,12	40.362.541,47	0,00	49.867.999,00	140.171,41	0,28%	0,01%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.220.974,95	57.714.767,16	10.782.562,45	53.300.872,55	147.692,89	0,23%	0,07%	0,40%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.711.142,72</b>	<b>0,93%</b>	<b>0,70%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.248.538,64	248.538,64	8,28%	3,66%	10,74%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.519.718,87	0,00	0,00	1.634.544,54	114.825,67	7,56%	4,36%	7,56%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	18.418.987,25	0,00	0,00	19.724.239,39	1.305.252,14	7,09%	4,66%	7,09%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	24.702.851,53	0,00	0,00	26.392.420,37	1.689.568,84	6,84%	4,64%	6,84%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.189.247,66	189.247,66	6,31%	3,97%	9,30%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.179.931,34	179.931,34	6,00%	6,23%	12,22%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.219.883,74	0,00	0,00	3.291.396,20	71.512,46	2,22%	1,53%	2,22%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.197.489,52	0,00	0,00	5.306.074,37	108.584,85	2,09%	1,10%	2,09%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.000.000,00	0,00	3.040.924,20	40.924,20	1,36%	1,57%	2,42%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.444.856,27	0,00	20.400,00	2.444.475,69	20.019,42	0,82%	-	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.455.584,67	0,00	0,00	3.466.867,86	11.283,19	0,33%	0,16%	0,33%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.926.600,00	0,00	0,00	5.652.350,00	-274.250,00	-4,63%	5,28%	-4,63%
Total Renda Variável					3.705.438,41	4,82%	3,99%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	85.117.503,74	0,00	0,00	87.161.024,89	2.043.521,15	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	73.062.933,48	0,00	0,00	74.903.091,16	1.840.157,68	2,52%	2,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	91.640.625,99	0,00	0,00	93.287.509,66	1.646.883,67	1,80%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	42.898.858,88	0,00	42.000.000,00	1.456.400,66	557.541,78	1,30%	2,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.706.411,63	0,00	50.000.000,00	2.227.220,22	520.808,59	1,01%	2,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.273.913,50	0,00	0,00	15.645.539,97	371.626,47	2,43%	2,43%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	10.455.964,88	0,00	0,00	10.710.382,14	254.417,26	2,43%	2,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.619.995,15	61.811.976,94	17.351.562,45	53.300.872,55	220.462,91	1,05%	1,33%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.244.540,47	47.428.517,12	0,00	49.867.999,00	194.941,41	0,91%	1,11%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.442.741,55	0,00	0,00	4.560.072,06	117.330,51	2,64%	2,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.889.752,88	0,00	0,00	3.983.724,49	93.971,61	2,42%	2,42%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.403.886,02	1.837.912,34	0,00	3.265.941,60	24.143,24	1,14%	1,31%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>7.885.806,28</b>	<b>2,00%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2019

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	23.915.773,27	0,00	0,00	26.392.420,37	2.476.647,10	10,36%	10,36%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	17.838.503,86	0,00	0,00	19.724.239,39	1.885.735,53	10,57%	10,57%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.248.538,64	248.538,64	8,28%	17,89%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.113.526,29	0,00	0,00	5.306.074,37	192.548,08	3,77%	3,77%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.189.247,66	189.247,66	6,31%	14,56%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.179.931,34	179.931,34	6,00%	18,18%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.463.864,97	0,00	0,00	1.634.544,54	170.679,57	11,66%	11,66%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.147.350,78	0,00	0,00	3.291.396,20	144.045,42	4,58%	4,58%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.370.388,36	0,00	61.200,00	2.444.475,69	135.287,33	5,72%	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.414.541,19	0,00	0,00	3.466.867,86	52.326,67	1,53%	1,53%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.606.235,00	0,00	0,00	5.652.350,00	46.115,00	0,82%	0,82%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.000.000,00	0,00	3.040.924,20	40.924,20	1,36%	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>5.762.026,54</b>	<b>8,25%</b>	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	73.859.762,98	6.739.363,44	0,00	93.287.509,66	12.688.383,24	16,37%	16,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	124.430.273,65	4.166.268,11	50.347.630,00	87.161.024,89	8.912.113,13	10,79%	11,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.558.733,77	35.000.000,00	0,00	74.903.091,16	8.344.357,39	12,54%	12,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	46.915.886,64	50.000.000,00	2.227.220,22	5.311.333,58	20,39%	29,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	39.700.579,92	42.000.000,00	1.456.400,66	3.755.820,74	14,26%	22,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.030.560,97	68.461.605,63	90.840.562,45	53.300.872,55	2.649.268,40	5,85%	6,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.534.938,42	0,00	769.928,89	15.645.539,97	1.880.530,44	13,33%	13,34%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	9.545.418,25	0,00	0,00	10.710.382,14	1.164.963,89	12,20%	12,20%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	4.000.000,00	0,00	4.560.072,06	560.072,06	14,00%	16,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.093.818,04	50.397.427,64	24.115.000,83	49.867.999,00	491.754,15	5,38%	5,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.808.515,50	0,00	210.274,13	3.983.724,49	385.483,12	10,45%	10,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.381.198,19	0,00	5.555.095,15	0,00	173.896,96	3,23%	5,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.388.958,00	5.777.070,69	4.000.000,00	3.265.941,60	99.912,91	4,87%	6,49%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,00	3.000.000,00	3.026.527,51	0,00	26.527,51	0,88%	22,46%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>46.444.417,52</b>	<b>13,12%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	7.570.180,91	13.572.722,77	0,00	26.392.420,37	5.249.516,69	28,06%	31,00%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	6.888.935,87	9.020.434,19	0,00	19.724.239,39	3.814.869,33	25,48%	29,44%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.220.716,54	0,00	0,00	1.634.544,54	413.828,00	33,90%	33,90%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.646.364,39	0,00	606.100,72	2.444.475,69	404.212,02	16,41%	0,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	5.000.000,00	0,00	5.306.074,37	306.074,37	6,12%	18,08%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	3.000.000,00	0,00	3.291.396,20	291.396,20	9,71%	13,70%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MULTIMERCADO	5.392.660,00	0,00	0,00	5.652.350,00	259.690,00	4,82%	4,82%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	3.210.660,52	0,00	0,00	3.466.867,86	256.207,34	7,98%	7,98%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.248.538,64	248.538,64	8,28%	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.189.247,66	189.247,66	6,31%	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.179.931,34	179.931,34	6,00%	50,52%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1.971.233,62	0,00	2.113.596,74	0,00	142.363,12	7,22%	53,27%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.000.000,00	0,00	3.040.924,20	40.924,20	1,36%	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>11.796.798,91</b>	<b>22,33%</b>	