

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
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	457.266,60	0,14%	17	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.966.352,06	9,17%	1.198	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.455,61	0,00%	1.361	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.364.686,76	0,75%	580	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	51.875.016,05	16,41%	695	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	400.901,40	0,13%	45	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.506.041,55	2,69%	923	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	3.053.196,00	0,97%	104	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.167,40	0,00%	376	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.304.113,91	1,99%	324	1,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	15.294.870,81	4,84%	167	1,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.406.853,04	0,45%	726	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	9.403.927,70	2,98%	817	1,26%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	12.920.015,44	4,09%	32	10,67%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24 du	Não há	17.356.653,62	5,49%	59.465	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	660.639,30	0,21%	1.635	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	16.131.060,09	5,10%	12.749	1,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.761.084,10	1,82%	12.392	0,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	D+2	01/10/2020	8.688.392,75	2,75%	955	1,74%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	10.015.247,97	3,17%	18.924	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	5.065.135,32	1,60%	67	0,77%	Artigo 9º - A, Inciso III
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	36.224.602,97	11,46%			Desenquadrado - RF

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2019)

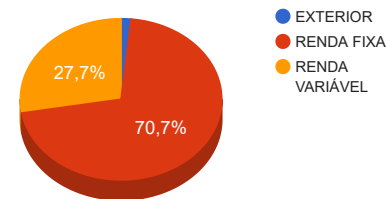
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	D+67 a D+1464	Não há	30.557.412,00	9,67%			Desenquadrado - RF
PREMIUM IMA-B FIC RENDA FIXA	D+67 ou D+1464	Não há	26.843.503,61	8,49%			Desenquadrado - RF
PREMIUM FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+67 a D+1464	Não há	10.994.445,38	3,48%			Desenquadrado - RF
TERRA NOVA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+67 a D+1829	Não há	6.690.329,16	2,12%			Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			315.958.370,60				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			95.610,53				Artigo 6º
Total			316.053.981,13				

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

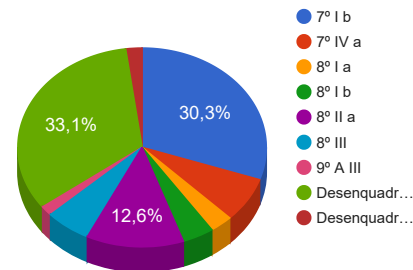
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	95.637.916,03	30,27%	25,00%	28,00%	100,00%	220.320.454,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	38,00%	60,00%	189.575.022,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	23.008.005,16	7,28%	0,00%	4,00%	40,00%	103.375.343,08
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	47.393.755,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	5,00%	15.797.918,53
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	9.403.927,70	2,98%	0,00%	4,00%	30,00%	85.383.583,48
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	12.920.015,44	4,09%	0,00%	1,00%	30,00%	81.867.495,74
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	39.909.437,11	12,63%	0,00%	8,00%	20,00%	23.282.237,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	18.703.640,72	5,92%	0,00%	10,00%	10,00%	12.892.196,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	15.797.918,53
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	5.065.135,32	1,60%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.065.135,32
Desenquadrado - RF	0,00%	104.619.963,96	33,11%	0,00%	0,00%	0,00%	-104.619.963,96
Desenquadrado - RV	0,00%	6.690.329,16	2,12%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.690.329,16
Total Carteira		315.958.370,60					

EXTERIOR	5.065.135,32	1,60%
RENDA FIXA	223.361.495,68	70,69%
RENDA VARIÁVEL	87.627.350,13	27,73%

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	95.637.916,03	30,26%	25,00%	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 "	23.008.005,16	7,28%	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 "	9.403.927,70	2,98%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	12.920.015,44	4,09%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	39.909.437,11	12,63%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	18.703.640,72	5,92%	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%
Artigo 9º - A, Inciso III	5.065.135,32	1,60%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	104.619.963,96	33,10%	0,00%	0,00%
Total	315.958.370,60	99,97%	25,00	690,00

Artigos	Base: dezembro / 2019		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Desenquadrado - RV	6.690.329,16	2,12%	0,00%	0,00%
Total	315.958.370,60	99,97%	25,00	690,00

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)

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES DO MUNICÍPIO DO CABO DE SANTO AGOSTINHO- CABOPREV

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 31/12/2019

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	113.063.034,10	35,77%	0,02%
Única Administradora	69.758.435,74	22,07%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.141.819,56	13,33%	0,00%
TERRA NOVA GESTÃO	41.551.857,38	13,15%	-
Itaú Unibanco	17.356.653,62	5,49%	0,00%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	16.131.060,09	5,10%	0,05%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.955.510,11	5,05%	0,00%

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	2,01%	22,95%	2,85%	6,72%	22,95%	39,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,49%	11,75%	2,89%	3,65%	11,75%	18,46%	0,20%	1,766%	6,37%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,49%	11,76%	2,89%	3,65%	11,76%	18,47%	0,20%	1,766%	6,36%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	2,93%	2,40%	1,37%	2,93%	6,40%	0,20%	0,433%	4,14%
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,90%	-	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	1,20%	-	-
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%
IPCA	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-	-
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,85%	12,43%	1,81%	4,38%	12,43%	23,11%	0,40%	1,092%	3,13%
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%
IMA Geral ex-C	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%	0,30%	1,209%	3,22%
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%
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%	-	-	-

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
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,31%	5,07%	1,03%	2,36%	5,07%	10,90%	0,80%	0,007%	0,20%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	4,82%	0,97%	2,23%	4,82%	10,36%	1,00%	0,009%	0,20%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM IMA-B FIC RENDA FIXA	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,80%	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	5,91%	1,20%	2,76%	5,91%	12,45%	0,20%	0,060%	0,24%
PREMIUM FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	1,00%	-	-

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

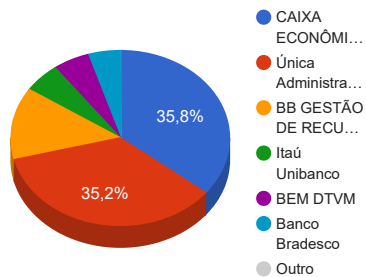
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	12,65%	58,20%	21,15%	32,65%	58,20%	71,06%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,55%	54,75%	20,34%	31,86%	54,75%	62,50%	1,50%	5,088%	15,32%
IGC	7,75%	38,53%	12,47%	19,53%	38,53%	54,76%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	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%	-	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	9,57%	47,82%	13,36%	22,60%	47,82%	80,22%	1,50%	4,706%	13,64%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,13%	45,27%	12,81%	22,94%	45,27%	77,92%	1,90%	4,076%	12,62%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	6,74%	30,58%	10,20%	14,09%	30,58%	49,42%	0,50%	4,833%	12,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,33%	7,98%	1,53%	3,54%	7,98%	-	1,60%	0,163%	1,14%
IPCA	1,15%	4,31%	1,77%	2,03%	4,31%	8,21%	-	-	-
TERRA NOVA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	1,50%	-	-
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAPRES MID SMALL CAPS FI AÇÕES	10,43%	44,48%	15,15%	25,87%	44,48%	78,58%	1,50%	4,787%	12,22%

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (dezembro / 2019)

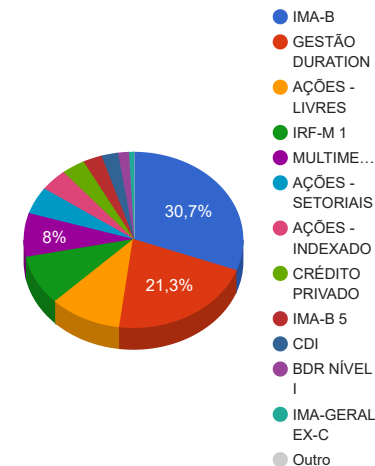
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Global BDRX	-1,52%	35,67%	5,85%	16,89%	35,67%	51,98%	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	-1,76%	34,46%	5,54%	16,36%	34,46%	48,15%	0,70%	4,693%	15,18%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	113.063.034,10	35,77%
Única Administradora	111.310.293,12	35,22%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.141.819,56	13,33%
Itaú Unibanco	17.356.653,62	5,49%
BEM DTVM	16.791.699,39	5,31%
Banco Bradesco	15.294.870,81	4,84%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	95.610,53	0,03%

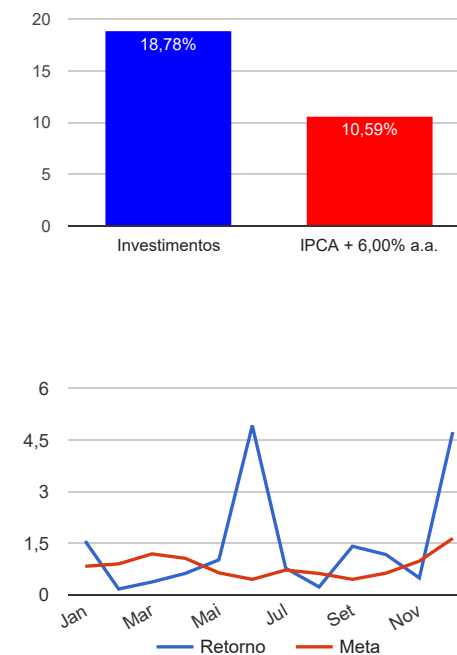


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	97.135.981,18	30,73%
GESTÃO DURATION	67.169.886,86	21,25%
AÇÕES - LIVRES	33.487.713,71	10,60%
IRF-M 1	28.980.807,67	9,17%
MULTIMERCADO	25.393.969,88	8,03%
AÇÕES - SETORIAIS	15.825.651,10	5,01%
AÇÕES - INDEXADO	12.920.015,44	4,09%
CRÉDITO PRIVADO	10.994.445,38	3,48%
IMA-B 5	8.906.942,95	2,82%
CDI	7.713.134,35	2,44%
BDR NÍVEL I	5.065.135,32	1,60%
IMA-GERAL EX-C	2.364.686,76	0,75%
DISP. FINANCEIRA	95.610,53	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	231.494.045,74	3.770.011,85	1.266.858,18	237.651.117,71	3.653.918,30	1,56%	0,83%	187,77%	1,01%
Fevereiro	237.651.117,71	12.057.709,70	8.841.535,89	241.274.696,92	407.405,40	0,17%	0,90%	18,89%	1,44%
Março	241.274.696,92	0,00	0,00	242.179.473,56	904.776,64	0,37%	1,19%	31,42%	2,50%
Abril	242.179.473,56	241.224,70	180.541,61	243.754.488,98	1.514.332,33	0,63%	1,06%	59,00%	1,33%
Mai	243.754.488,98	51.852.386,28	46.980.586,50	251.156.568,59	2.530.279,83	1,02%	0,64%	158,85%	2,02%
Junho	251.156.568,59	0,00	0,00	263.518.651,43	12.362.082,84	4,92%	0,45%	1.092,97%	2,09%
Julho	263.518.651,43	8.947.833,90	881.521,94	273.687.311,44	2.102.348,05	0,77%	0,72%	106,88%	2,10%
Agosto	273.687.311,44	4.721.711,96	1.571.793,31	277.470.819,70	633.589,61	0,23%	0,62%	36,88%	2,60%
Setembro	277.470.819,70	16.191.986,18	13.822.955,52	283.789.640,50	3.949.790,14	1,41%	0,45%	316,07%	1,49%
Outubro	283.789.640,50	56.808.106,73	53.919.218,78	290.034.732,44	3.356.203,99	1,17%	0,63%	184,72%	2,17%
Novembro	290.034.732,44	10.563.543,15	8.158.385,35	293.875.389,99	1.435.499,75	0,49%	0,98%	50,30%	2,46%
Dezembro	293.875.389,99	21.123.116,66	15.018.375,46	314.178.266,17	14.198.134,98	4,73%	1,64%	288,19%	1,99%
Acumulado no ano					47.048.361,86	18,78%	10,59%	177,36%	

Acumulado no Ano


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(%)
PREMIUM FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	9.833.077,89	0,00	0,00	10.994.445,38	1.161.367,49	11,81%	-	-
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	33.578.253,98	0,00	0,00	36.224.602,97	2.646.348,99	7,88%	-	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	28.352.292,33	0,00	0,00	30.557.412,00	2.205.119,67	7,78%	-	-
PREMIUM IMA-B FIC RENDA FIXA	25.087.460,77	0,00	0,00	26.843.503,61	1.756.042,84	7,00%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.008.388,60	0,00	0,00	3.053.196,00	44.807,40	1,49%	1,77%	1,49%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	450.557,10	0,00	0,00	457.266,60	6.709,50	1,49%	1,77%	1,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.404.673,48	0,00	0,00	8.506.041,55	101.368,07	1,21%	1,01%	1,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.342.229,43	0,00	0,00	2.364.686,76	22.457,33	0,96%	1,21%	0,96%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.166.392,47	0,00	0,00	15.294.870,81	128.478,34	0,85%	1,09%	0,85%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	397.794,60	0,00	0,00	400.901,40	3.106,80	0,78%	0,43%	0,78%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	39.278.774,79	12.340.000,00	0,00	51.875.016,05	256.241,26	0,50%	0,93%	0,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.397,67	0,00	0,00	14.455,61	57,94	0,40%	0,07%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.851.697,41	0,00	0,00	28.966.352,06	114.654,65	0,40%	0,07%	0,40%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.159,29	0,00	0,00	2.167,40	8,11	0,38%	0,06%	0,38%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.368.022,23	342.601,78	307.592,83	1.406.853,04	3.821,86	0,22%	0,01%	0,28%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	12.392.066,93	9.556.141,13	15.666.361,24	6.304.113,91	22.267,09	0,10%	0,01%	0,31%
Total Renda Fixa					8.472.857,34	3,94%	0,72%	

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.118.733,44	0,00	0,00	5.761.084,10	642.350,66	12,55%	5,09%	12,55%
TERRA NOVA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.010.535,91	0,00	0,00	6.690.329,16	679.793,25	11,31%	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	598.225,57	0,00	0,00	660.639,30	62.413,73	10,43%	4,79%	10,43%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	14.722.373,00	0,00	0,00	16.131.060,09	1.408.687,09	9,57%	4,71%	9,57%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	16.051.670,44	0,00	0,00	17.356.653,62	1.304.983,18	8,13%	4,08%	8,13%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8.743.308,01	0,00	0,00	9.403.927,70	660.619,69	7,56%	4,36%	7,56%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	12.104.004,36	0,00	0,00	12.920.015,44	816.011,08	6,74%	4,83%	6,74%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	9.797.645,76	0,00	0,00	10.015.247,97	217.602,21	2,22%	1,53%	2,22%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	8.660.115,70	0,00	0,00	8.688.392,75	28.277,05	0,33%	0,16%	0,33%
Total Renda Variável					5.820.737,94	7,12%	3,70%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	5.155.850,68	0,00	0,00	5.065.135,32	-90.715,36	-1,76%	4,69%	-1,76%
				Total Exterior	-90.715,36	-1,76%	4,69%	

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 (%)
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	33.458.772,26	0,00	0,00	36.224.602,97	2.765.830,71	8,27%	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	28.201.394,72	0,00	0,00	30.557.412,00	2.356.017,28	8,35%	-
PREMIUM IMA-B FIC RENDA FIXA	24.932.232,65	0,00	0,00	26.843.503,61	1.911.270,96	7,67%	-
PREMIUM FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	9.765.210,15	0,00	0,00	10.994.445,38	1.229.235,23	12,59%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	35.843.832,11	15.340.000,00	0,00	51.875.016,05	691.183,94	1,75%	1,80%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	495.424,93	28.617.475,75	492.375,40	28.966.352,06	345.826,78	1,20%	1,31%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	15.035.150,40	0,00	15.294.870,81	259.720,41	1,73%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.508.636,82	0,00	9.211.816,81	8.506.041,55	209.221,54	1,65%	2,52%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	6.927.422,98	22.131.421,11	22.848.486,44	6.304.113,91	93.756,26	0,61%	1,03%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.967.510,60	0,00	0,00	3.053.196,00	85.685,40	2,89%	2,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.322.625,77	0,00	0,00	2.364.686,76	42.060,99	1,81%	1,81%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	15.560.659,88	0,00	15.595.810,28	0,00	35.150,40	0,23%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	27.405.658,94	0,00	27.405.658,94	14.455,61	14.455,61	0,77%	1,33%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	444.437,40	0,00	0,00	457.266,60	12.829,20	2,89%	2,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	689.836,83	1.172.396,83	467.558,26	1.406.853,04	12.177,64	0,83%	0,97%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	391.494,30	0,00	0,00	400.901,40	9.407,10	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.141,62	0,00	0,00	2.167,40	25,78	1,20%	1,20%
Total Renda Fixa					10.073.855,23	4,75%	

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 (%)
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7.213.079,24	8.000.000,00	0,00	17.356.653,62	2.143.574,38	14,09%	12,81%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	14.229.768,86	0,00	0,00	16.131.060,09	1.901.291,23	13,36%	13,36%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	14.645.297,46	0,00	3.000.000,00	12.920.015,44	1.274.717,98	10,08%	10,20%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8.421.967,07	0,00	0,00	9.403.927,70	981.960,63	11,66%	11,66%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.787.258,47	0,00	0,00	5.761.084,10	973.825,63	20,34%	20,34%
TERRA NOVA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.969.822,27	0,00	0,00	6.690.329,16	720.506,89	12,07%	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	9.576.938,34	0,00	0,00	10.015.247,97	438.309,63	4,58%	4,58%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	8.557.255,73	0,00	0,00	8.688.392,75	131.137,02	1,53%	1,53%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	560.659,88	0,00	660.639,30	99.979,42	17,83%	15,15%
Total Renda Variável					8.665.302,81	10,52%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	4.799.416,94	0,00	0,00	5.065.135,32	265.718,38	5,54%	5,54%
				Total Exterior	265.718,38	5,54%	

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 (%)
TERRA NOVA IMA-B FIC RENDA FIXA	30.705.628,37	0,00	0,00	36.224.602,97	5.518.974,60	17,97%	-
TERRA NOVA IMA-B II FIC RENDA FIXA	25.833.804,99	0,00	0,00	30.557.412,00	4.723.607,01	18,28%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.879.633,38	38.958.469,26	0,00	51.875.016,05	4.036.913,41	16,00%	16,43%
PREMIUM IMA-B FIC RENDA FIXA	22.887.480,15	0,00	0,00	26.843.503,61	3.956.023,46	17,28%	-
PREMIUM FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	8.471.705,90	0,00	0,00	10.994.445,38	2.522.739,48	29,78%	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	21.385.898,84	0,00	22.967.489,59	0,00	1.581.590,75	7,40%	22,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.231.334,34	8.000.000,00	9.211.816,81	8.506.041,55	1.486.524,02	11,74%	12,85%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.062.350,09	0,00	27.405.658,94	14.455,61	1.357.764,46	5,96%	6,55%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	10.625.461,40	3.618.290,88	15.595.810,28	0,00	1.352.058,00	9,85%	11,60%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.106.561,03	0,00	17.772.018,11	0,00	665.457,08	3,89%	12,33%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.732.155,20	0,00	143.798,18	3.053.196,00	464.838,98	17,53%	11,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.658,31	29.099.015,36	505.974,09	28.966.352,06	359.652,48	6,08%	6,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	6.439.465,43	49.658.292,23	50.058.891,14	6.304.113,91	265.247,39	3,05%	5,07%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	15.035.150,40	0,00	15.294.870,81	259.720,41	1,73%	12,43%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.187.704,61	0,00	2.364.686,76	176.982,15	8,09%	13,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.739.827,15	0,00	1.869.591,11	0,00	129.763,96	7,46%	22,59%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	409.161,00	0,00	21.495,80	457.266,60	69.601,40	17,52%	11,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.874.241,75	0,00	1.937.485,74	0,00	63.243,99	3,37%	13,89%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.074.180,89	0,00	1.111.591,54	0,00	37.410,65	3,48%	11,79%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	389.477,10	0,00	21.133,21	400.901,40	32.557,51	8,63%	2,93%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.310,47	3.010.877,87	1.634.548,17	1.406.853,04	21.212,87	3,58%	4,82%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.046,39	0,00	0,00	2.167,40	121,01	5,91%	5,91%
Total Renda Fixa					29.082.005,07	15,36%	

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 (%)
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	1.089.271,56	11.000.000,00	0,00	16.131.060,09	4.041.788,53	48,69%	47,82%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.874.707,53	11.265.921,82	3.000.000,00	12.920.015,44	2.779.386,09	32,81%	30,58%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,00	15.000.000,00	0,00	17.356.653,62	2.356.653,62	17,56%	45,27%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3.722.825,72	0,00	0,00	5.761.084,10	2.038.258,38	54,75%	54,75%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3.202.806,18	4.219.709,41	0,00	9.403.927,70	1.981.412,11	33,88%	33,90%
TERRA NOVA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.157.349,98	0,00	0,00	6.690.329,16	1.532.979,18	29,72%	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	8.808.212,44	0,00	0,00	10.015.247,97	1.207.035,53	13,70%	13,70%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	8.046.305,96	0,00	0,00	8.688.392,75	642.086,79	7,98%	7,98%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	560.659,88	0,00	660.639,30	99.979,42	17,83%	44,48%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.024.591,92	0,00	1.053.066,89	0,00	28.474,97	2,78%	9,03%
				Total Renda Variável	16.708.054,62	28,97%	

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

Ativos de Investimentos no Exterior	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	3.767.048,17	0,00	0,00	5.065.135,32	1.298.087,15	34,46%	34,46%
				Total Exterior	1.298.087,15	34,46%	