

# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2020

**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.181.135,24	0,39%	57	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	35.286.777,71	11,56%	922	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	40.682.107,10	13,33%	969	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	20.272.138,16	6,64%	888	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.154.516,00	0,71%	1.213	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	21.861.755,48	7,16%	941	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	22.683.793,86	7,43%	709	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	5.902.753,07	1,93%	359	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.649.244,10	3,16%	1.361	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	13.236.245,19	4,34%	330	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	35.172.726,42	11,53%	717	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	288.027,39	0,09%	67	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.882.532,26	0,62%	262	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	20.921.115,84	6,86%	308	0,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.994.002,07	2,95%	684	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.332.438,64	0,76%	288	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	684.508,09	0,22%	15	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	941.254,75	0,31%	651	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	21.175,52	0,01%		0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	3.080,47	0,00%		0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

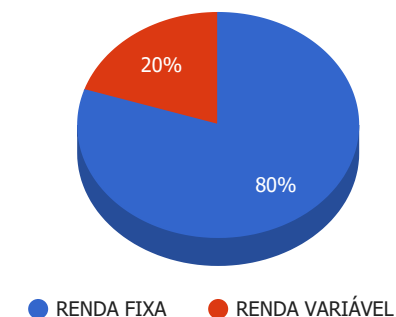
**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.628.362,38	0,53%	36	1,28%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	3.297.199,73	1,08%	147	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.742.767,02	1,55%	1.504	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.701.247,07	0,89%	6.358	0,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.981.909,13	0,98%	211	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.342.921,07	1,42%	18.810	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	5.585.788,51	1,83%	88	1,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	9.016.470,93	2,95%	16.684	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	D+7	Não há	4.437.945,21	1,45%	55	2,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.509.494,30	1,48%	1.661	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.401.618,28	1,11%	2.823	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.030.520,84	1,32%	11.169	0,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.390.596,41	0,78%	11.903	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.350.651,18	1,75%	26.307	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	824.721,00	0,27%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.750.000,00	0,57%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>305.143.540,42</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	210.253.751,98	68,90%	20,00%	40,00%	100,00%	94.889.788,44
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	61.028.708,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	20.921.115,84	6,86%	0,00%	10,00%	60,00%	162.165.008,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.514.354,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	12.952.203,55	4,24%	0,00%	20,00%	40,00%	109.105.212,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.514.354,04
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.514.354,04
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.514.354,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	24.255,99	0,01%	0,00%	1,00%	5,00%	15.232.921,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.257.177,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.257.177,02
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>244.151.327,36</b>	<b>80,01%</b>	<b>20,00%</b>	<b>71,00%</b>	<b>275,00%</b>	

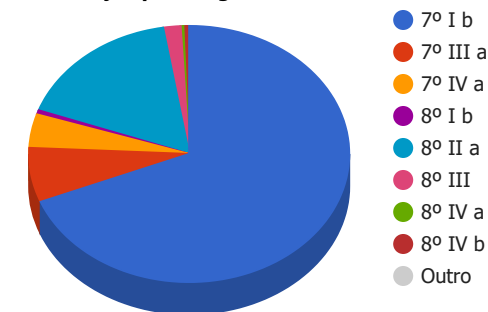
**Distribuição por Segmento**



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.514.354,04
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.628.362,38	0,53%	0,00%	2,00%	10,00%	28.885.991,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	51.438.478,50	16,86%	0,00%	15,00%	20,00%	9.590.229,58
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.514.354,04
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.350.651,18	1,75%	0,00%	8,00%	10,00%	25.163.702,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	824.721,00	0,27%	0,00%	2,00%	5,00%	14.432.456,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.750.000,00	0,57%	0,00%	2,00%	5,00%	13.507.177,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.257.177,02
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>60.992.213,06</b>	<b>19,99%</b>	<b>0,00%</b>	<b>29,00%</b>	<b>75,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



Artigos - Exterior	Resolução	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%	15.257.177,02
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.257.177,02
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.257.177,02
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>15,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	214.912.047,80	70,43	0,04
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	50.794.469,79	16,65	0,00
VINCI PARTNERS	17.830.427,75	5,84	0,06
ICATU VANGUARDA	9.016.470,93	2,95	0,02
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	4.864.441,39	1,59	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.801.601,27	1,25	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.390.596,41	0,78	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	824.721,00	0,27	0,19
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	684.508,09	0,22	0,03
VILA RICA CAPITAL	21.175,52	0,01	0,83
BRASIL PLURAL	3.080,47	0,00	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 - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	210.253.751,98	68,90	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	20.921.115,84	6,86	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.952.203,55	4,24	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	24.255,99	0,01	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	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	1.628.362,38	0,53	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	51.438.478,50	16,86	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	5.350.651,18	1,75	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	824.721,00	0,27	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.750.000,00	0,57	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00	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	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,68%	0,68%	2,01%	4,43%	9,50%	20,53%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-37,17%	-37,17%	-1,52%	468,32%	72,38%	-45,82%	0,43%	6,52%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-3,47%	-3,47%	54,63%	-26,06%	285,17%	-84,57%	0,03%	5,56%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	0,38%	1,75%	4,52%	10,29%	20,76%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	0,46%	1,57%	4,44%	10,30%	20,93%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	1,11%	1,11%	0,99%	5,27%	13,57%	27,70%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	1,08%	0,92%	5,12%	13,23%	27,17%	0,01%	0,04%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,03%	0,03%	-1,54%	6,07%	22,33%	43,41%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,04%	-0,04%	-1,75%	5,77%	21,74%	42,13%	0,03%	0,09%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	0,42%	1,14%	2,93%	6,40%	13,64%	0,00%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,42%	1,13%	2,89%	6,33%	13,50%	0,00%	0,00%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,43%	0,43%	1,10%	2,90%	6,41%	13,53%	0,00%	0,00%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	0,42%	1,13%	2,90%	6,33%	13,46%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,54%	0,54%	1,46%	4,93%	11,80%	22,57%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,54%	1,41%	4,89%	11,76%	22,83%	0,01%	0,02%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,55%	0,55%	0,79%	4,24%	10,67%	5,04%	0,02%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,25%	0,25%	-0,36%	5,44%	17,72%	34,14%	0,02%	0,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,23%	0,23%	-0,36%	5,45%	17,66%	34,19%	0,02%	0,06%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,88%	0,88%	1,04%	4,50%	11,47%	23,54%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	0,98%	4,38%	11,22%	23,04%	0,01%	0,03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	0,35%	1,05%	2,45%	5,55%	12,19%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37%	0,37%	1,03%	2,44%	5,55%	12,08%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	0,34%	1,04%	2,66%	9,69%	19,74%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%



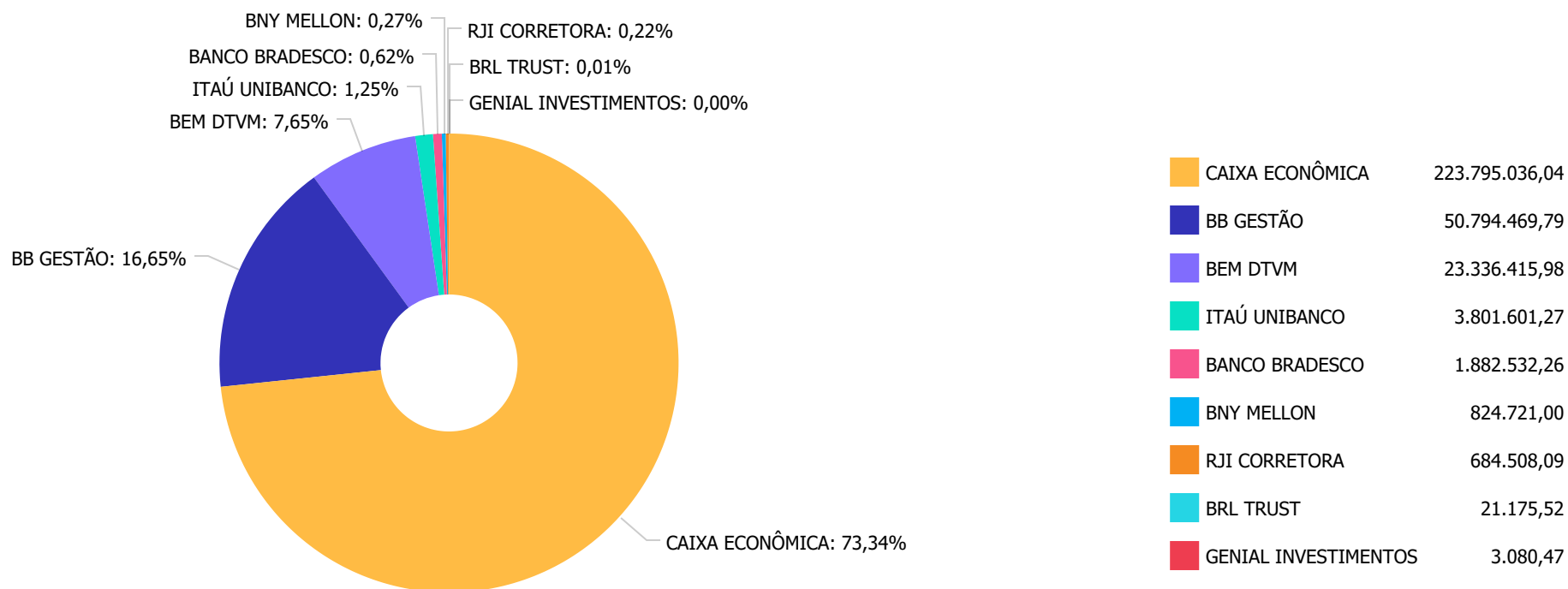
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,97%	0,97%	4,10%	6,66%	13,61%	28,42%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-1,58%	-1,58%	10,79%	17,15%	27,01%	50,76%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,62%	0,62%	8,68%	15,29%	27,77%	60,37%	0,07%	0,09%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1,53%	1,53%	10,76%	17,94%	28,52%	51,11%	0,08%	0,09%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	-1,29%	-1,29%	4,28%	11,26%	18,91%	40,76%	0,11%	0,09%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-1,71%	-1,71%	5,96%	11,27%	16,13%	32,41%	0,10%	0,09%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	2,32%	2,32%	14,38%	19,29%	32,86%	59,65%	0,07%	0,10%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1,12%	1,12%	14,12%	19,20%	36,62%	62,90%	0,08%	0,10%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	1,74%	1,74%	17,13%	24,40%	33,90%	64,36%	0,09%	0,13%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,82%	3,82%	10,95%	16,92%	24,29%	47,97%	0,11%	0,09%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,17%	3,17%	14,95%	20,83%	-	-	0,08%	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,44%	-1,44%	10,33%	13,10%	20,92%	48,45%	0,10%	0,10%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	0,45%	0,45%	18,98%	24,82%	45,25%	64,69%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,50%	0,50%	18,51%	24,23%	41,26%	56,18%	0,09%	0,14%

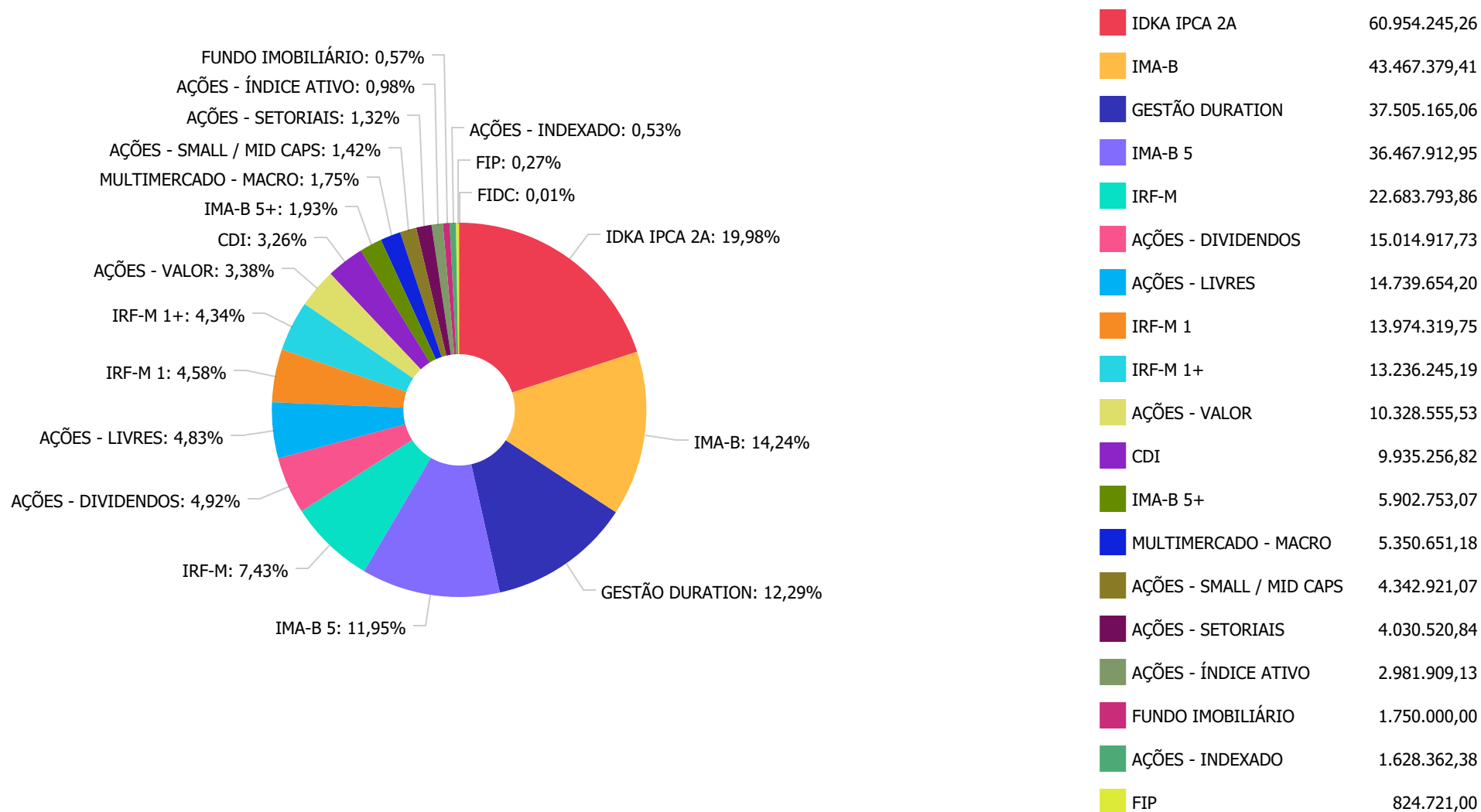
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,68%	0,68%	3,58%	6,70%	14,67%	28,07%	0,02%	0,02%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,50%	1,50%	18,04%	22,35%	26,94%	49,81%	0,09%	0,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	17,45%	17,45%	46,57%	62,48%	67,46%	50,21%	0,22%	0,23%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1,95%	1,95%	16,92%	24,18%	35,42%	67,70%	0,09%	0,13%

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



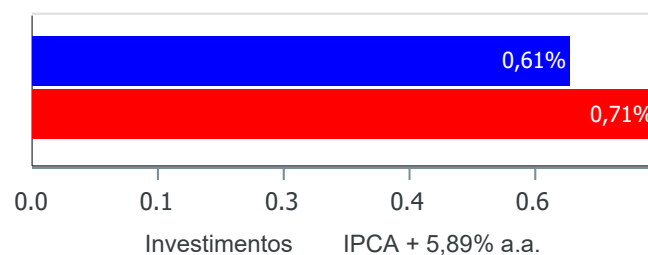
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

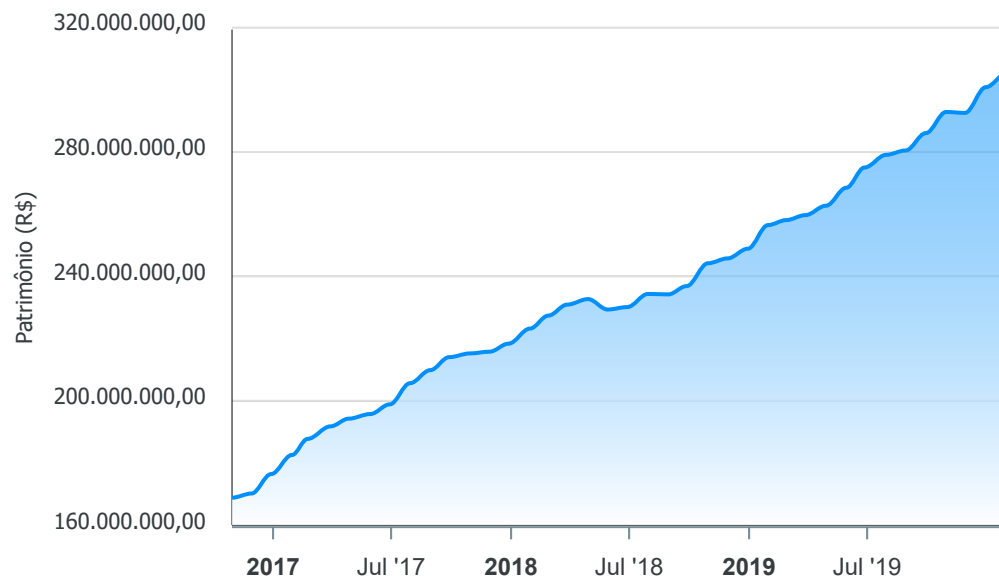
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	300.838.476,80	17.510.660,84	15.043.413,85	305.143.540,42	1.837.816,63	1.837.816,63	0,61%	0,61%	0,71%	0,71%	85,11%	2,29%

Investimentos x Meta Atuarial



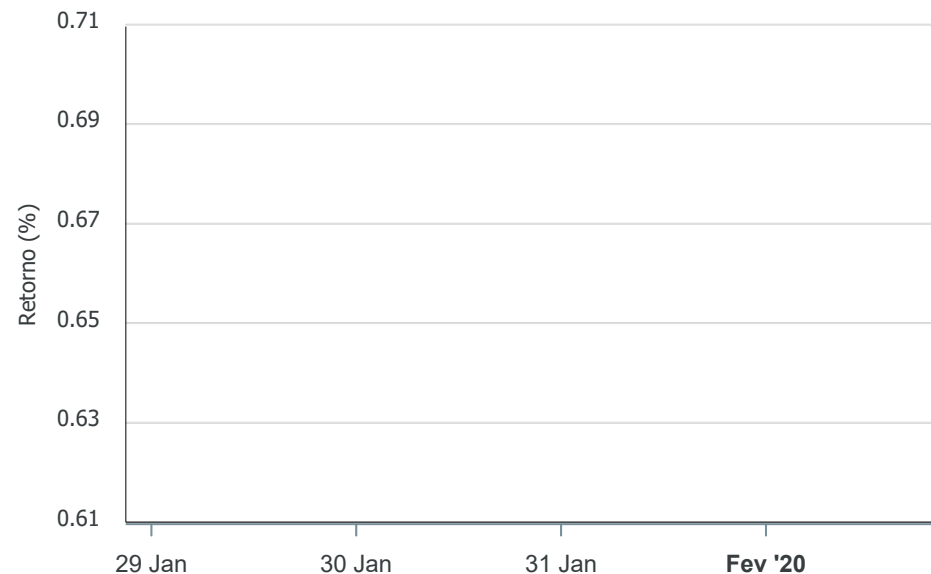
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	13.095.358,03	0,00	0,00	13.236.245,19	140.887,16	1,08%	1,08%	0,96%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	22.491.653,92	0,00	0,00	22.683.793,86	192.139,94	0,85%	0,85%	0,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	34.886.897,76	0,00	0,00	35.172.726,42	285.828,66	0,82%	0,82%	0,64%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	680.782,08	0,00	0,00	684.508,09	3.726,01	0,55%	0,55%	1,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	35.095.820,66	0,00	0,00	35.286.777,71	190.957,05	0,54%	0,54%	0,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1.174.791,24	0,00	0,00	1.181.135,24	6.344,00	0,54%	0,54%	0,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	40.496.973,67	0,00	0,00	40.682.107,10	185.133,43	0,46%	0,46%	0,55%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	286.801,19	0,00	0,00	288.027,39	1.226,20	0,43%	0,43%	0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.608.640,61	0,00	0,00	9.649.244,10	40.603,49	0,42%	0,42%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.145.518,88	0,00	0,00	2.154.516,00	8.997,12	0,42%	0,42%	0,09%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.874.704,59	0,00	0,00	1.882.532,26	7.827,67	0,42%	0,42%	0,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	20.194.392,18	0,00	0,00	20.272.138,16	77.745,98	0,38%	0,38%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	937.973,44	0,00	0,00	941.254,75	3.281,31	0,35%	0,35%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.324.517,58	0,00	0,00	2.332.438,64	7.921,06	0,34%	0,34%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	21.807.963,75	0,00	0,00	21.861.755,48	53.791,73	0,25%	0,25%	1,67%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	20.873.217,31	0,00	0,00	20.921.115,84	47.898,53	0,23%	0,23%	1,66%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.063.718,74	7.510.660,84	11.618.625,20	8.994.002,07	38.247,69	0,19%	0,37%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	5.905.029,36	0,00	0,00	5.902.753,07	-2.276,29	-0,04%	-0,04%	2,62%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	21.936,99	0,00	0,00	21.175,52	-761,47	-3,47%	-3,47%	2,87%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.902,69	0,00	1.259,31	3.080,47	-562,91	-11,48%	-37,17%	43,35%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>246.971.594,67</b>	<b>7.510.660,84</b>	<b>11.619.884,51</b>	<b>244.151.327,36</b>	<b>1.288.956,36</b>	<b>0,51%</b>		<b>0,80%</b>



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.489.990,00	0,00	40.500,00	1.750.000,00	300.510,00	20,17%	17,45%	22,09%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.302.685,58	0,00	0,00	2.390.596,41	87.910,83	3,82%	3,82%	10,56%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.332.445,30	1.000.000,00	0,00	3.401.618,28	69.172,98	2,08%	3,17%	7,96%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	5.478.846,78	0,00	0,00	5.585.788,51	106.941,73	1,95%	1,95%	8,52%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.000.573,89	1.000.000,00	0,00	4.030.520,84	29.946,95	0,75%	1,12%	8,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.314.323,79	0,00	0,00	5.350.651,18	36.327,39	0,68%	0,68%	1,97%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	2.408.247,01	2.000.000,00	0,00	4.437.945,21	29.698,20	0,67%	2,32%	7,40%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.275.713,13	1.000.000,00	0,00	3.297.199,73	21.486,60	0,66%	1,53%	8,42%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.960.825,26	0,00	0,00	9.016.470,93	55.645,67	0,62%	0,62%	7,23%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	2.499.864,30	2.000.000,00	0,00	4.509.494,30	9.630,00	0,21%	1,74%	8,60%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.695.608,31	1.000.000,00	0,00	2.701.247,07	5.638,76	0,21%	1,50%	8,96%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	3.383.128,10	0,00	3.383.029,34	0,00	-98,76	0,00%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	825.899,28	0,00	0,00	824.721,00	-1.178,28	-0,14%	-0,14%	0,01%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	3.020.850,62	0,00	0,00	2.981.909,13	-38.941,49	-1,29%	-1,29%	10,86%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.812.023,03	0,00	0,00	4.742.767,02	-69.256,01	-1,44%	-1,44%	9,53%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.409.106,07	2.000.000,00	0,00	4.342.921,07	-66.185,00	-1,50%	0,50%	9,31%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.656.751,68	0,00	0,00	1.628.362,38	-28.389,30	-1,71%	-1,71%	9,61%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>53.866.882,13</b>	<b>10.000.000,00</b>	<b>3.423.529,34</b>	<b>60.992.213,06</b>	<b>548.860,27</b>	<b>0,91%</b>		<b>8,27%</b>