

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	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.291.368,75	4,27%	588	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.517.185,60	5,02%	922	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.081.147,73	6,89%	679	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.820.431,72	9,33%	701	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.060.478,39	10,12%	885	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.267.210,74	4,19%	1.005	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.464.502,84	8,15%	976	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.142.559,98	7,09%	322	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.288.570,90	4,26%	899	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.005.631,08	3,33%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.288.714,40	4,26%	375	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	2.013.115,59	6,66%	301	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	767.668,93	2,54%	743	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	684.332,70	2,26%	196	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	108.521,94	0,36%	98	0,13%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	622.524,77	2,06%	95	0,05%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	966.359,07	3,20%	724	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	519.669,28	1,72%	2.098	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	311.886,81	1,03%	4.431	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	412.607,44	1,37%	15.778	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

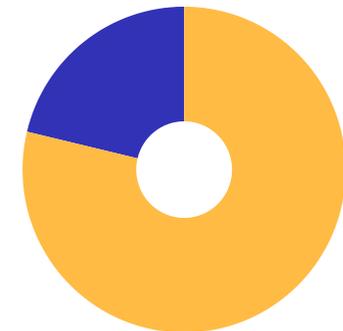


Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	355.364,85	1,18%	44.013	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	364.430,69	1,21%	2.413	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	190.230,17	0,63%	14.781	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	202.902,49	0,67%	8.663	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	805.558,01	2,67%	15.069	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	366.562,36	1,21%	193	0,09%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.170.666,86	3,87%	18.848	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	136.850,00	0,45%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			30.227.054,09				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

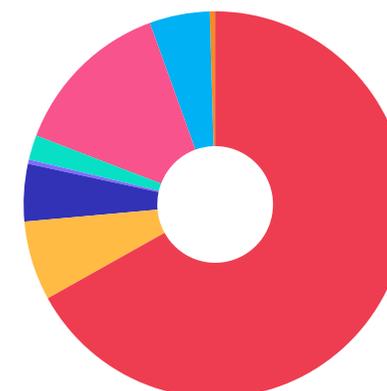
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	20.227.802,13	66,92%	20,00%	50,00%	90,00%	6.976.546,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	2.013.115,59	6,66%	0,00%	8,00%	40,00%	10.077.706,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.452.001,63	4,80%	0,00%	10,00%	40,00%	10.638.820,01
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.022.705,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	108.521,94	0,36%	0,00%	0,00%	3,00%	798.289,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.511.352,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.511.352,70
Total Renda Fixa	100,00%	23.801.441,29	78,74%	20,00%	68,00%	193,00%	



RENDA FIXA 23.801.441,29
RENDA VARIÁVEL 6.425.612,80

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	622.524,77	2,06%	0,00%	5,00%	10,00%	2.400.180,64
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.511.352,70
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	4.129.008,81	13,66%	0,00%	10,00%	20,00%	1.916.402,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.511.352,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.537.229,22	5,09%	0,00%	10,00%	10,00%	1.485.476,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	136.850,00	0,45%	0,00%	4,00%	5,00%	1.374.502,70
Total Renda Variável	30,00%	6.425.612,80	21,26%	0,00%	29,00%	55,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	1.511.352,70
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	18.023.946,91	59,63	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.410.252,54	37,75	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	684.332,70	2,26	0,00
PETRA CAPITAL	108.521,94	0,36	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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 '	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
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 '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	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%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	7,92%	3,22%	4,89%	7,92%	20,01%	0,66%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,71%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	3,05%	8,45%	2,90%	2,29%	8,45%	23,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,04%	8,22%	2,90%	2,21%	8,22%	23,25%	1,69%	0,04%
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%	3,42%	0,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,10%	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%	0,74%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,84%	6,14%	7,14%	8,03%	6,14%	30,17%	2,03%	0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4,85%	6,05%	7,10%	8,06%	6,05%	29,88%	2,04%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,84%	6,06%	7,13%	8,09%	6,06%	30,02%	2,04%	0,11%

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
IRF-M (Benchmark)	1,95%	6,69%	1,99%	1,75%	6,69%	19,53%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,96%	6,40%	1,99%	1,64%	6,40%	18,94%	1,04%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,15%	-4,83%	-0,46%	-3,33%	-4,83%	-13,52%	0,01%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,64%	0,22%	0,40%	1,64%	6,54%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,38%	5,09%	3,18%	3,28%	5,09%	18,83%	1,02%	0,04%
IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,55%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,48%	4,66%	3,00%	2,83%	4,66%	17,68%	1,14%	0,04%

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

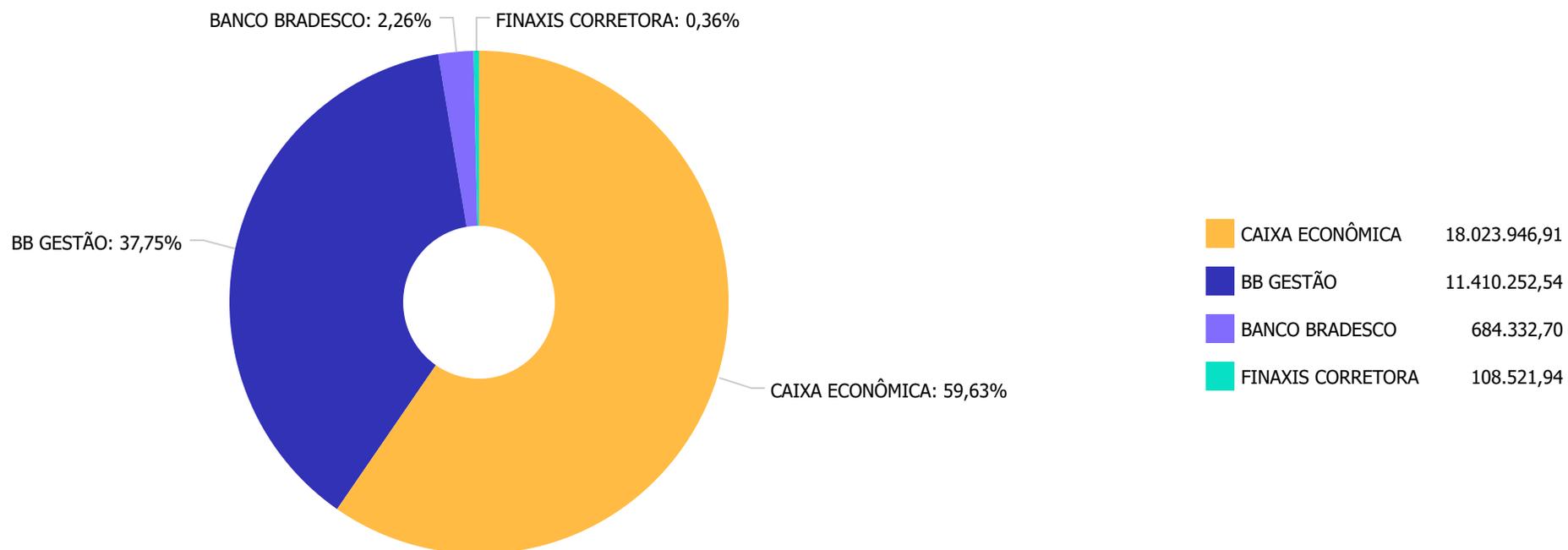
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	9,42%	3,62%	26,47%	26,00%	3,62%	33,83%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9,07%	1,51%	25,08%	24,45%	1,51%	31,39%	7,10%	0,43%
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	4,44%	-25,50%	18,22%	6,89%	-25,50%	24,73%	11,23%	0,54%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	8,33%	0,56%	20,94%	19,91%	0,56%	55,18%	6,96%	0,43%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	6,64%	-0,62%	23,88%	26,47%	-0,62%	50,58%	6,18%	0,41%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	8,92%	-1,80%	25,24%	24,47%	-1,80%	29,58%	6,40%	0,43%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	10,42%	14,03%	28,14%	32,00%	14,03%	67,13%	7,54%	0,46%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7,99%	-3,46%	20,38%	18,70%	-3,46%	44,17%	6,29%	0,39%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10,72%	5,98%	32,39%	29,35%	5,98%	49,89%	7,54%	0,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7,65%	1,18%	18,83%	18,56%	1,18%	-	5,83%	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%	6,40%	0,47%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,10%	2,01%	1,91%	1,07%	2,01%	11,22%	0,47%	0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,70%	3,52%	4,23%	4,60%	3,52%	22,23%	0,93%	0,08%



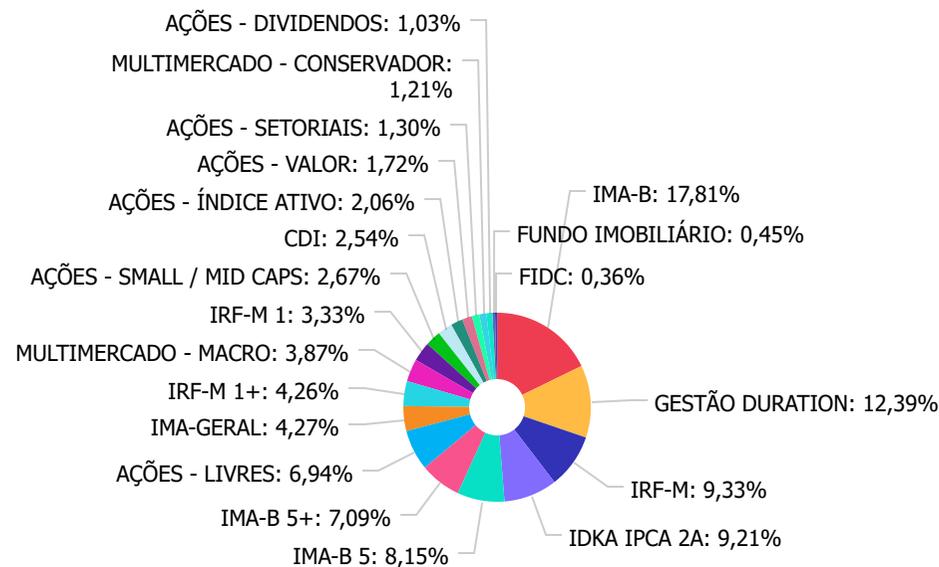
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	2,19%	-10,24%	2,69%	2,28%	-10,24%	22,05%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-4,97%	-8,15%	-26,02%	-12,28%	-8,15%	35,59%	15,57%	0,53%

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



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

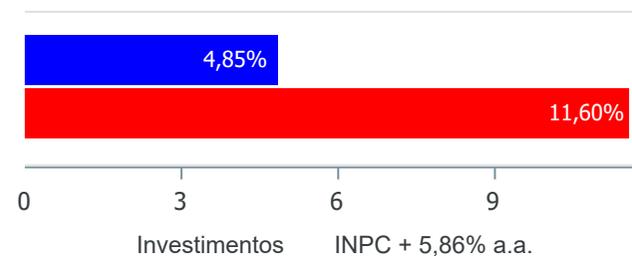


IMA-B	5.382.834,22	GESTÃO DURATION	3.744.811,09	IRF-M	2.820.431,72
IDKA IPCA 2A	2.784.396,34	IMA-B 5	2.464.502,84	IMA-B 5+	2.142.559,98
AÇÕES - LIVRES	2.098.762,05	IMA-GERAL	1.291.368,75	IRF-M 1+	1.288.714,40
MULTIMERCADO - MACRO	1.170.666,86	IRF-M 1	1.005.631,08	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	805.558,01
CDI	767.668,93	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	622.524,77	AÇÕES - VALOR	519.669,28
AÇÕES - SETORIAIS	393.132,66	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	366.562,36	AÇÕES - DIVIDENDOS	311.886,81
FUNDO IMOBILIÁRIO	136.850,00	FIDC	108.521,94		

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	27.748.654,49	618.826,85	339.158,44	28.164.595,04	136.272,14	136.272,14	0,49%	0,49%	0,69%	0,69%	70,53%	2,13%
Fevereiro	28.164.595,04	1.280.252,41	1.260.351,14	27.857.442,10	-327.054,21	-190.782,07	-1,16%	-0,68%	0,58%	1,27%	-53,46%	3,90%
Março	27.857.442,10	373.992,42	352.164,05	25.768.915,89	-2.110.354,58	-2.301.136,65	-7,57%	-8,20%	0,68%	1,96%	-418,36%	15,61%
Abril	25.768.915,89	463.813,88	429.400,65	26.344.456,16	541.127,04	-1.760.009,61	2,10%	-6,27%	0,22%	2,19%	-286,97%	8,03%
Mai	26.344.456,16	425.409,90	473.449,92	26.851.718,60	555.302,46	-1.204.707,15	2,11%	-4,30%	0,20%	2,39%	-179,64%	4,02%
Junho	26.851.718,60	486.746,33	436.505,44	27.551.403,98	649.444,49	-555.262,66	2,41%	-1,99%	0,78%	3,19%	-62,32%	3,37%
Julho	27.551.403,98	409.098,42	405.044,75	28.393.287,37	837.829,72	282.567,06	3,04%	0,99%	0,96%	4,18%	23,75%	2,70%
Agosto	28.393.287,37	404.191,20	421.200,55	28.030.299,35	-345.978,67	-63.411,61	-1,22%	-0,24%	0,84%	5,05%	-4,70%	2,67%
Setembro	28.030.299,35	398.350,79	419.058,86	27.636.526,60	-373.064,68	-436.476,29	-1,33%	-1,57%	1,35%	6,47%	-24,18%	3,68%
Outubro	27.636.526,60	383.216,76	384.723,95	27.564.709,63	-70.309,78	-506.786,07	-0,25%	-1,82%	1,37%	7,93%	-22,89%	3,13%
Novembro	27.564.709,63	376.720,05	387.255,14	28.401.125,66	846.951,12	340.165,05	3,07%	1,20%	1,41%	9,45%	12,71%	3,00%
Dezembro	28.401.125,66	1.181.437,47	406.181,08	30.227.054,09	1.050.672,04	1.390.837,09	3,60%	4,85%	1,97%	11,60%	41,77%	2,22%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



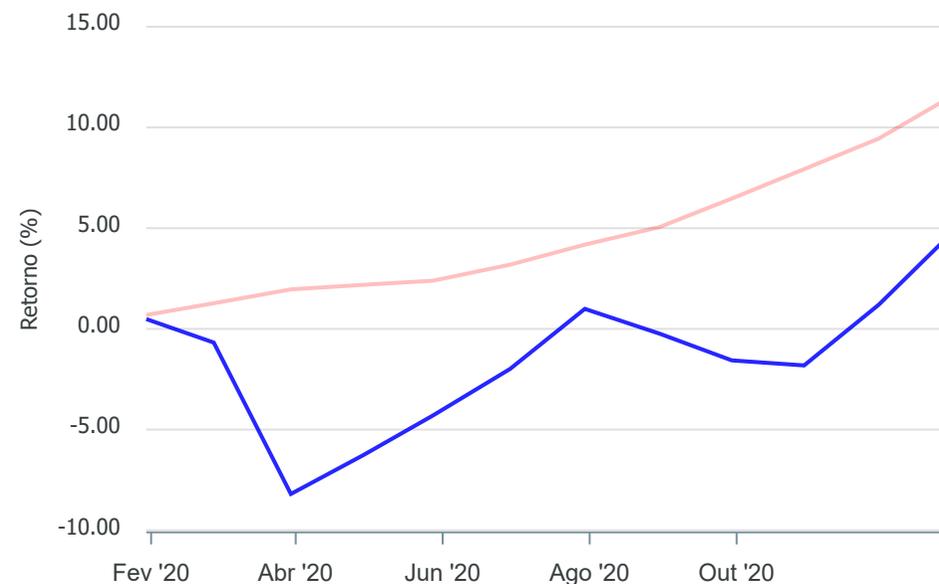
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/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...	1.991.912,06	0,00	0,00	2.142.559,98	150.647,92	7,56%	7,56%	3,42%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.919.927,01	0,00	0,00	2.013.115,59	93.188,58	4,85%	4,85%	2,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.229.078,00	0,00	0,00	1.288.570,90	59.492,90	4,84%	4,84%	2,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.980.545,93	4.823,07	0,00	2.081.147,73	95.778,73	4,82%	4,84%	2,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.250.722,46	0,00	0,00	1.288.714,40	37.991,94	3,04%	3,04%	1,69%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	667.773,51	0,00	0,00	684.332,70	16.559,19	2,48%	2,48%	1,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.261.360,60	0,00	0,00	1.291.368,75	30.008,15	2,38%	2,38%	1,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.766.093,74	0,00	0,00	2.820.431,72	54.337,98	1,96%	1,96%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.420.455,51	0,00	0,00	2.464.502,84	44.047,33	1,82%	1,82%	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.246.608,51	0,00	0,00	1.267.210,74	20.602,23	1,65%	1,65%	0,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.494.386,82	0,00	0,00	1.517.185,60	22.798,78	1,53%	1,53%	0,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.020.586,62	0,00	0,00	3.060.478,39	39.891,77	1,32%	1,32%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.039.636,58	48.572,73	85.552,15	1.005.631,08	2.973,92	0,27%	0,28%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	258.920,57	828.041,67	319.928,93	767.668,93	635,62	0,06%	0,10%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	108.681,36	0,00	0,00	108.521,94	-159,42	-0,15%	-0,15%	0,01%
Total Renda Fixa	22.656.689,28	881.437,47	405.481,08	23.801.441,29	668.795,62	2,89%		1,30%

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	469.359,13	0,00	0,00	519.669,28	50.310,15	10,72%	10,72%	7,54%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	373.661,21	0,00	0,00	412.607,44	38.946,23	10,42%	10,42%	7,54%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	570.764,10	0,00	0,00	622.524,77	51.760,67	9,07%	9,07%	7,10%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	887.252,18	0,00	0,00	966.359,07	79.106,89	8,92%	8,92%	6,40%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	187.295,06	0,00	0,00	202.902,49	15.607,43	8,33%	8,33%	6,96%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	329.084,13	0,00	0,00	355.364,85	26.280,72	7,99%	7,99%	6,29%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	338.548,00	0,00	0,00	364.430,69	25.882,69	7,65%	7,65%	5,83%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	748.663,04	0,00	0,00	805.558,01	56.894,97	7,60%	7,60%	6,40%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	182.143,88	0,00	0,00	190.230,17	8.086,29	4,44%	4,44%	11,23%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	311.886,81	11.886,81	3,96%	6,64%	6,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.151.091,53	0,00	0,00	1.170.666,86	19.575,33	1,70%	1,70%	0,93%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	362.574,12	0,00	0,00	366.562,36	3.988,24	1,10%	1,10%	0,47%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	144.000,00	0,00	700,00	136.850,00	-6.450,00	-4,48%	-4,97%	15,57%
Total Renda Variável	5.744.436,38	300.000,00	700,00	6.425.612,80	381.876,42	6,32%		5,61%

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.937.868,90	0,00	0,00	2.142.559,98	204.691,08	10,56%	10,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.930.704,09	12.186,55	0,00	2.081.147,73	138.257,09	7,12%	7,13%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.879.582,71	0,00	0,00	2.013.115,59	133.532,88	7,10%	7,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.202.786,82	0,00	0,00	1.288.570,90	85.784,08	7,13%	7,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.385.356,86	0,00	0,00	2.464.502,84	79.145,98	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.999.253,33	0,00	0,00	3.060.478,39	61.225,06	2,04%	2,04%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.765.341,55	0,00	0,00	2.820.431,72	55.090,17	1,99%	1,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.469.796,59	0,00	0,00	1.517.185,60	47.389,01	3,22%	3,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.251.633,93	0,00	0,00	1.291.368,75	39.734,82	3,17%	3,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.229.729,92	0,00	0,00	1.267.210,74	37.480,82	3,05%	3,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.252.348,07	0,00	0,00	1.288.714,40	36.366,33	2,90%	2,90%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	664.430,74	0,00	0,00	684.332,70	19.901,96	3,00%	3,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.077.148,71	98.495,32	176.873,47	1.005.631,08	6.860,52	0,58%	0,64%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	236.482,14	1.530.692,41	1.000.586,70	767.668,93	1.081,08	0,06%	0,22%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	109.019,27	0,00	0,00	108.521,94	-497,33	-0,46%	-0,46%
Total Renda Fixa	22.391.483,63	1.641.374,28	1.177.460,17	23.801.441,29	946.043,55	4,14%	

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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	771.609,72	0,00	0,00	966.359,07	194.749,35	25,24%	25,24%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	662.847,78	0,00	0,00	805.558,01	142.710,23	21,53%	21,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	392.516,82	0,00	0,00	519.669,28	127.152,46	32,39%	32,39%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	497.691,61	0,00	0,00	622.524,77	124.833,16	25,08%	25,08%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	321.995,42	0,00	0,00	412.607,44	90.612,02	28,14%	28,14%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	295.211,26	0,00	0,00	355.364,85	60.153,59	20,38%	20,38%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	306.690,11	0,00	0,00	364.430,69	57.740,58	18,83%	18,83%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.123.116,02	0,00	0,00	1.170.666,86	47.550,84	4,23%	4,23%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	167.772,07	0,00	0,00	202.902,49	35.130,42	20,94%	20,94%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	160.919,25	0,00	0,00	190.230,17	29.310,92	18,21%	18,21%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	311.886,81	11.886,81	3,96%	23,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	359.682,91	0,00	0,00	366.562,36	6.879,45	1,91%	1,91%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	184.990,00	0,00	700,00	136.850,00	-47.440,00	-25,64%	-26,02%
Total Renda Variável	5.245.042,97	300.000,00	700,00	6.425.612,80	881.269,83	15,89%	

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.116.402,84	0,00	250.000,00	3.060.478,39	194.075,55	6,23%	6,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.287.305,21	0,00	0,00	2.464.502,84	177.197,63	7,75%	7,75%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.650.847,63	0,00	0,00	2.820.431,72	169.584,09	6,40%	6,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.890.648,05	69.499,32	0,00	2.081.147,73	121.000,36	6,17%	6,14%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.898.262,08	0,00	0,00	2.013.115,59	114.853,51	6,05%	6,05%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.904.116,24	0,00	500.000,00	1.517.185,60	113.069,36	5,94%	7,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.036.010,55	0,00	0,00	2.142.559,98	106.549,43	5,23%	5,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.267.271,79	9.842,52	91.412,43	1.288.714,40	103.012,52	8,07%	8,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.172.998,57	0,00	0,00	1.267.210,74	94.212,17	8,03%	8,03%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.214.923,79	0,00	0,00	1.288.570,90	73.647,11	6,06%	6,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.228.823,03	0,00	0,00	1.291.368,75	62.545,72	5,09%	5,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.195.602,27	247.239,52	476.988,85	1.005.631,08	39.778,14	2,76%	3,63%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	653.849,32	0,00	0,00	684.332,70	30.483,38	4,66%	4,66%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	173.053,65	4.983.408,81	4.394.692,69	767.668,93	5.899,16	0,11%	1,64%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	114.029,08	0,00	0,00	108.521,94	-5.507,14	-4,83%	-4,83%
Total Renda Fixa	22.804.144,10	5.309.990,17	5.713.093,97	23.801.441,29	1.400.400,99	4,98%	

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 ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.130.905,36	0,00	0,00	1.170.666,86	39.761,50	3,52%	3,52%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	375.000,00	0,00	412.607,44	37.607,44	10,03%	14,03%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	340.403,48	150.000,00	0,00	519.669,28	29.265,80	5,97%	5,98%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	311.886,81	11.886,81	3,96%	-0,62%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	613.294,61	0,00	0,00	622.524,77	9.230,16	1,51%	1,51%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	359.328,08	0,00	0,00	366.562,36	7.234,28	2,01%	2,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	360.197,30	0,00	0,00	364.430,69	4.233,39	1,18%	1,18%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	174.842,44	27.547,99	0,00	202.902,49	512,06	0,25%	0,56%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	148.999,00	0,00	1.400,00	136.850,00	-10.749,00	-7,21%	-8,15%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	984.094,73	0,00	0,00	966.359,07	-17.735,66	-1,80%	-1,80%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	375.000,00	0,00	355.364,85	-19.635,15	-5,24%	-3,46%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	832.445,39	0,00	0,00	805.558,01	-26.887,38	-3,23%	-3,23%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	0,00	264.518,32	0,00	190.230,17	-74.288,15	-28,08%	-25,50%
Total Renda Variável	4.944.510,39	1.492.066,31	1.400,00	6.425.612,80	-9.563,90	-0,15%	

Disclaimer

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

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

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

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

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

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

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

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