

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.



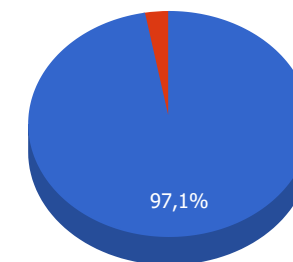
Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2019)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|---|------------|---------------|----------------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 3.361.278,83 | 8,06% | 949 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 7.851.026,26 | 18,82% | 36 | 2,57% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 4.871.621,18 | 11,68% | 708 | 0,09% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2 | Não há | 7.487.004,29 | 17,95% | 342 | 0,29% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 252.030,40 | 0,60% | 1.198 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0 | Não há | 733.892,87 | 1,76% | 362 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 3.511.913,73 | 8,42% | 695 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0 | Não há | 1.131.304,18 | 2,71% | 654 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 19.094,16 | 0,05% | 324 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 1.217,17 | 0,00% | 688 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO... | D+0 | Não há | 36.137,25 | 0,09% | 165.617 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 106.058,66 | 0,25% | 220 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA | D+2 | Não há | 4.254.399,39 | 10,20% | 698 | 2,24% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 29.588,86 | 0,07% | 3.396 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 6.843.641,58 | 16,41% | 339 | 1,98% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | D+5 a D... | Não há | 26.794,64 | 0,06% | 11 | 5,07% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | Não se ... | Não se aplica | 1.191.992,00 | 2,86% | | 0,51% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 41.708.995,45 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 46.901,35 | | | | Artigo 6º |
| PL Total | | | 41.755.896,80 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2019)

| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2019 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 20,00% | 90,00% | 37.538.095,91 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 28.068.767,56 | 67,30% | 15,00% | 30,00% | 90,00% | 9.469.328,35 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 60,00% | 25.025.397,27 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40,00% | 12.421.441,25 | 29,78% | 5,00% | 15,00% | 35,00% | 2.176.707,16 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 2,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 5,00% | 26.794,64 | 0,06% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 2.058.655,13 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 2.085.449,77 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 40.517.003,45 | 97,14% | 27,00% | 75,00% | 285,00% | |

Distribuição por Segmento

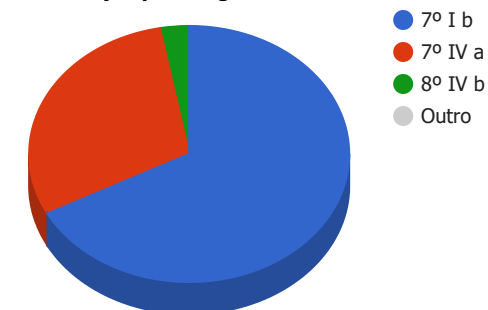


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2019)

| Artigos - Renda Variável | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2019 | | | GAP Superior |
|------------------------------------|---------------|---------------------|--------------|-------------------------------|---------------|---------------|--------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 4.170.899,55 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 7,00% | 10,00% | 20,00% | 8.341.799,09 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 20,00% | 8.341.799,09 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 7,00% | 10,00% | 4.170.899,55 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 2,00% | 0,00% | 5,00% | 2.085.449,77 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00% | 1.191.992,00 | 2,86% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 893.457,77 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 1.191.992,00 | 2,86% | 16,00% | 27,00% | 70,00% | |

Distribuição por Artigos



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

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| BANESTES DTVM | 19.084.714,75 | 45,76 | 0,27 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 13.778.097,30 | 33,03 | 0,00 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 8.819.388,76 | 21,15 | 0,00 |
| OLIVEIRA TRUST | 26.794,64 | 0,06 | 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 - 2019 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 28.068.767,56 | 67,30 | 15,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 12.421.441,25 | 29,78 | 5,00 | 35,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 26.794,64 | 0,06 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 7,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 0,00 | 0,00 | 5,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 2,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 1.191.992,00 | 2,86 | 2,00 | 5,00 |

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|---------|--------|---------|---------|--------|---------|------------------|
| IMA-B 5+ (Benchmark) | 2,60% | 30,37% | 3,02% | 7,64% | 30,37% | 50,45% | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,72% | 30,05% | 3,10% | 7,66% | 30,05% | 49,74% | 0,04% | 0,10% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2,56% | 29,73% | 2,85% | 7,41% | 29,73% | 49,17% | 0,04% | 0,10% |
| IRF-M 1 (Benchmark) | 0,42% | 6,76% | 1,38% | 3,33% | 6,76% | 14,21% | - | - |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,40% | 6,49% | 1,31% | 3,18% | 6,49% | 13,69% | 0,00% | 0,00% |
| IMA-B (Benchmark) | 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% | 0,03% | 0,07% |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 2,37% | 28,73% | 1,91% | 7,28% | 28,73% | 43,37% | 0,04% | 0,11% |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,57% | 31,04% | 2,88% | 8,38% | 31,04% | 48,64% | 0,05% | 0,11% |
| IRF-M (Benchmark) | 0,62% | 12,03% | 1,86% | 4,72% | 12,03% | 24,05% | - | - |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,60% | 11,79% | 1,81% | 4,61% | 11,79% | 23,56% | 0,01% | 0,03% |
| RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | -2,99% | -15,11% | -8,83% | -14,84% | -15,11% | -2,47% | 0,03% | 0,06% |
| CDI (Benchmark) | 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% | 0,00% | 0,00% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 0,35% | 5,74% | 1,14% | 2,65% | 5,74% | 12,44% | 0,00% | 0,00% |
| BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,13% | 2,05% | 0,48% | 0,97% | 2,05% | 4,37% | 0,00% | 0,00% |

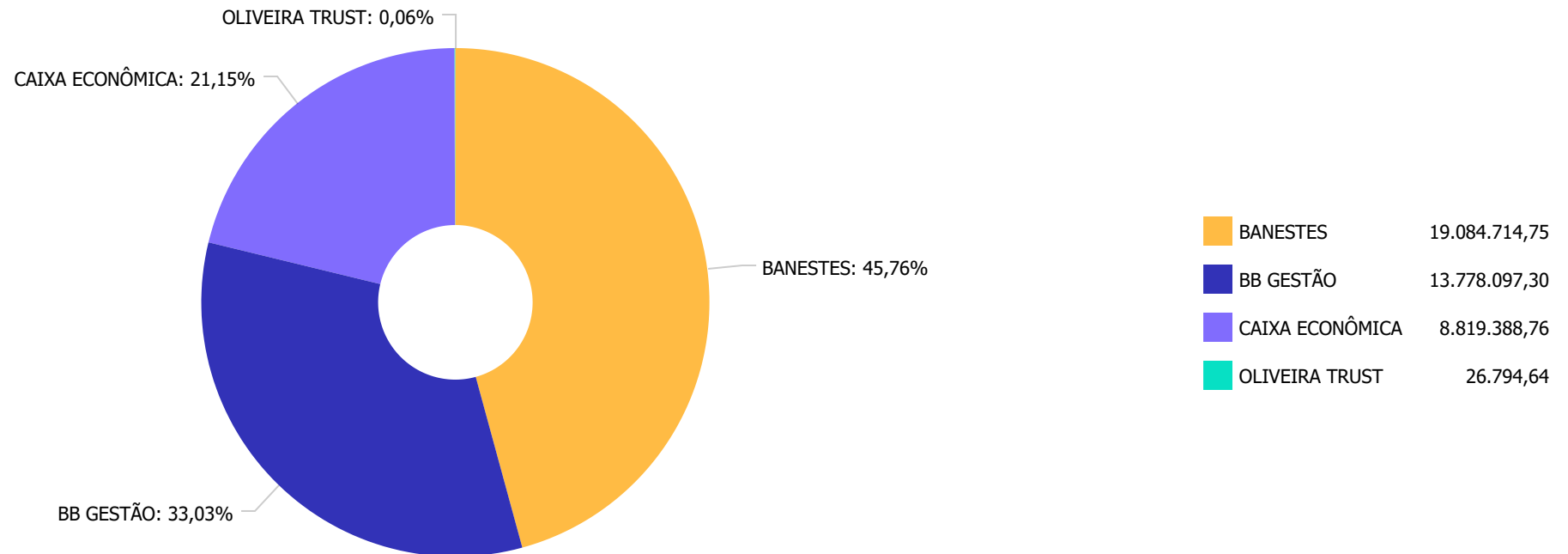
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 0,31% | 5,07% | 1,03% | 2,36% | 5,07% | 10,90% | 0,00% | 0,00% |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,40% | 6,08% | 1,04% | 2,66% | 6,08% | 13,46% | 0,00% | 0,00% |
| BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,35% | 5,78% | 0,88% | 2,68% | 5,78% | 12,41% | 0,00% | 0,01% |
| IPCA (Benchmark) | 1,15% | 4,31% | 1,77% | 2,03% | 4,31% | 8,21% | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,59% | 16,43% | 1,80% | 4,97% | 16,43% | 25,53% | 0,01% | 0,04% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA | 1,14% | 18,05% | 3,55% | 7,85% | 18,05% | - | 0,02% | 0,03% |

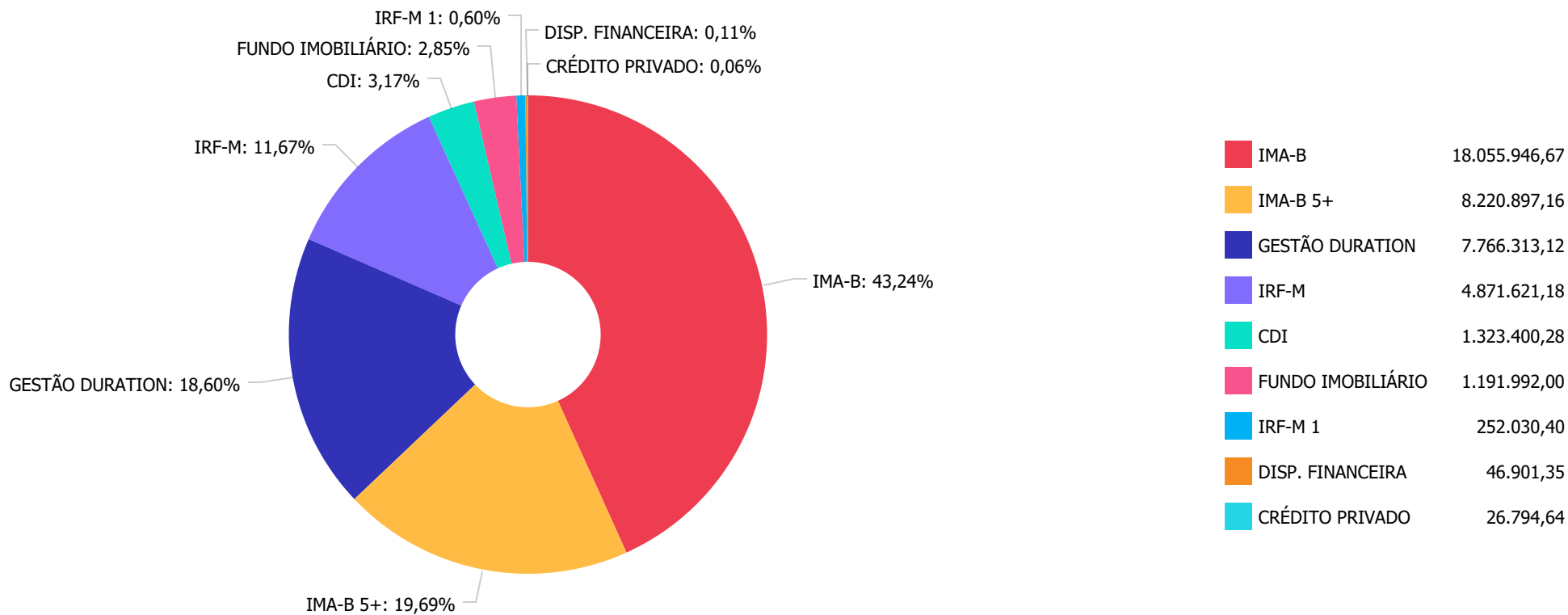
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2019 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 9,96% | 47,62% | 34,23% | 44,38% | 47,62% | 39,25% | 0,14% | 0,17% |

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2019)



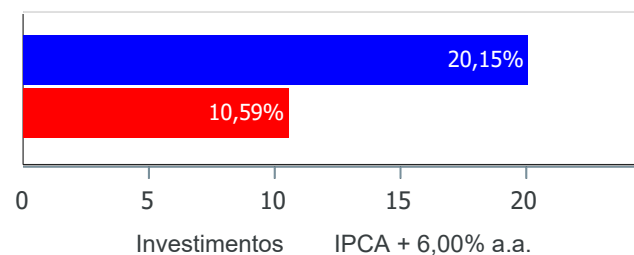
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2019)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2019)

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo no Mês | Retorno | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro | 35.960.953,34 | 406.682,26 | 669.600,17 | 36.329.454,05 | 631.418,62 | 631.418,62 | 1,76% | 1,76% | 0,83% | 0,83% | 211,13% | 1,03% |
| Fevereiro | 36.329.454,05 | 957.814,49 | 980.514,17 | 36.478.731,79 | 171.977,42 | 803.396,04 | 0,47% | 2,24% | 0,90% | 1,73% | 129,00% | 1,03% |
| Março | 36.478.731,79 | 4.370.867,42 | 4.507.104,22 | 36.516.012,59 | 173.517,60 | 976.913,64 | 0,48% | 2,72% | 1,19% | 2,95% | 92,37% | 1,97% |
| Abril | 36.516.012,59 | 623.829,09 | 784.871,12 | 36.587.416,93 | 232.446,37 | 1.209.360,01 | 0,64% | 3,38% | 1,06% | 4,04% | 83,61% | 0,90% |
| Mai | 36.587.416,93 | 9.382.430,50 | 9.457.335,46 | 37.425.652,25 | 913.140,28 | 2.122.500,29 | 2,50% | 5,96% | 0,64% | 4,71% | 126,60% | 1,62% |
| Junho | 37.425.652,25 | 3.177.762,30 | 3.478.890,65 | 38.292.122,61 | 1.167.598,71 | 3.290.099,00 | 3,12% | 9,26% | 0,45% | 5,18% | 178,91% | 1,95% |
| Julho | 38.292.122,61 | 704.143,24 | 741.596,42 | 38.828.369,14 | 573.699,71 | 3.863.798,71 | 1,50% | 10,90% | 0,72% | 5,94% | 183,53% | 1,29% |
| Agosto | 38.828.369,14 | 6.633.048,87 | 6.748.024,88 | 38.443.310,08 | -270.083,05 | 3.593.715,66 | -0,70% | 10,13% | 0,62% | 6,60% | 153,54% | 2,59% |
| Setembro | 38.443.310,08 | 81.197.392,23 | 81.465.321,23 | 39.360.658,09 | 1.185.277,01 | 4.778.992,67 | 3,08% | 13,52% | 0,45% | 7,07% | 191,22% | 2,23% |
| Outubro | 39.360.658,09 | 79.305.310,88 | 79.353.743,40 | 40.878.189,08 | 1.565.963,51 | 6.344.956,18 | 3,98% | 18,04% | 0,63% | 7,75% | 232,74% | 2,46% |
| Novembro | 40.878.189,08 | 66.561.739,95 | 66.704.656,16 | 40.348.586,43 | -386.686,44 | 5.958.269,74 | -0,95% | 16,92% | 0,98% | 8,80% | 192,26% | 2,27% |
| Dezembro | 40.348.586,43 | 99.447.921,23 | 99.207.544,41 | 41.708.995,45 | 1.120.032,20 | 7.078.301,94 | 2,76% | 20,15% | 1,64% | 10,59% | 190,28% | 3,36% |

Investimentos x Meta Atuarial



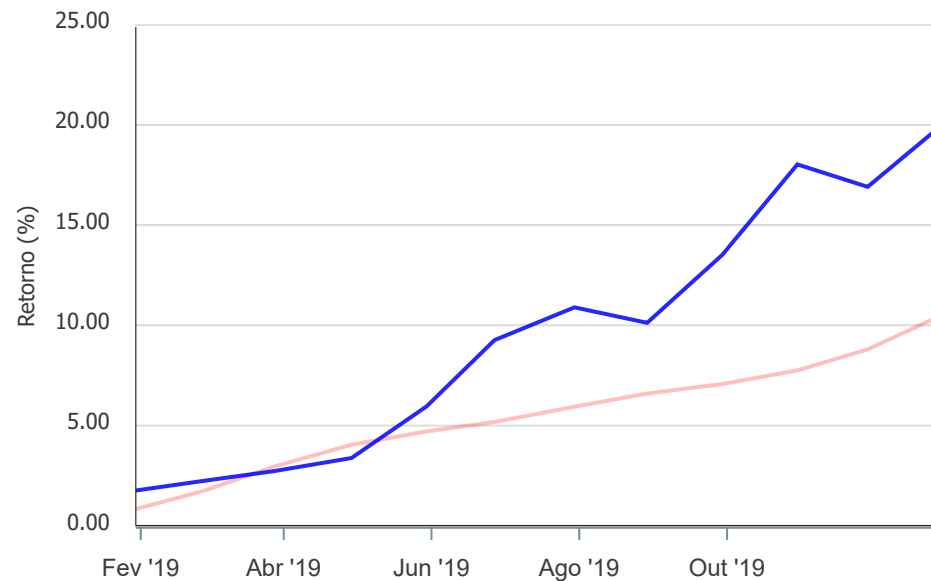
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2019
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... | 715.600,58 | 0,00 | 0,00 | 733.892,87 | 18.292,29 | 2,56% | 2,56% | 4,25% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 2.329.036,44 | 5.000.461,60 | 0,00 | 7.487.004,29 | 157.506,25 | 2,15% | 2,72% | 4,09% |
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 7.962.214,54 | 20.500.000,00 | 21.000.010,05 | 7.851.026,26 | 388.821,77 | 1,37% | 2,57% | 4,74% |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA | 4.206.513,84 | 0,00 | 0,00 | 4.254.399,39 | 47.885,55 | 1,14% | 1,14% | 1,79% |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 6.208.861,77 | 19.781.966,54 | 19.441.000,00 | 6.843.641,58 | 293.813,27 | 1,13% | 2,37% | 4,10% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 2.807.218,64 | 3.000.000,00 | 2.500.000,00 | 3.361.278,83 | 54.060,19 | 0,93% | 1,99% | 2,80% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 4.494.470,22 | 400.000,00 | 50.000,00 | 4.871.621,18 | 27.150,96 | 0,55% | 0,60% | 0,93% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 251.032,81 | 0,00 | 0,00 | 252.030,40 | 997,59 | 0,40% | 0,40% | 0,07% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 6.022.554,40 | 0,00 | 4.900.000,00 | 1.131.304,18 | 8.749,78 | 0,15% | 0,35% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,00 | 6.209,65 | 5.000,00 | 1.217,17 | 7,52 | 0,12% | 0,35% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 817.035,29 | 6.336.500,00 | 3.645.000,00 | 3.511.913,73 | 3.378,44 | 0,05% | 0,59% | 0,93% |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 152.909,31 | 18.000.000,00 | 18.052.000,00 | 106.058,66 | 5.149,35 | 0,03% | 0,40% | 0,03% |
| BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 224.360,15 | 16.316.991,14 | 16.516.154,81 | 29.588,86 | 4.392,38 | 0,03% | 0,35% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 2.935.235,64 | 6.049.922,12 | 8.968.361,23 | 19.094,16 | 2.297,63 | 0,03% | 0,31% | 0,01% |
| BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P... | 109.922,90 | 4.055.870,18 | 4.130.018,32 | 36.137,25 | 362,49 | 0,01% | 0,13% | 0,01% |
| RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 27.619,90 | 0,00 | 0,00 | 26.794,64 | -825,26 | -2,99% | -2,99% | 3,49% |
| Total Renda Fixa | 39.264.586,43 | 99.447.921,23 | 99.207.544,41 | 40.517.003,45 | 1.012.040,20 | 2,56% | | 3,06% |

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

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 | 1.084.000,00 | 0,00 | 0,00 | 1.191.992,00 | 107.992,00 | 9,96% | 9,96% | 13,66% |
| Total Renda Variável | 1.084.000,00 | 0,00 | 0,00 | 1.191.992,00 | 107.992,00 | 9,96% | | 13,66% |

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

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|---------------|---------------|--------------|---------------------|--------------|------------|
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 6.343.874,97 | 57.350.000,00 | 56.592.455,40 | 7.851.026,26 | 749.606,69 | 1,18% | 2,88% |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 5.128.026,70 | 51.843.069,49 | 50.674.000,00 | 6.843.641,58 | 546.545,39 | 0,96% | 1,91% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 7.332.358,68 | 5.891.066,30 | 6.000.000,00 | 7.487.004,29 | 263.579,31 | 1,99% | 3,10% |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA | 4.108.469,95 | 0,00 | 0,00 | 4.254.399,39 | 145.929,44 | 3,55% | 3,55% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 6.536.666,81 | 400.000,00 | 2.150.000,00 | 4.871.621,18 | 84.954,37 | 1,22% | 1,81% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 2.787.796,31 | 3.000.000,00 | 2.500.000,00 | 3.361.278,83 | 73.482,52 | 1,27% | 2,70% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 4.019.617,72 | 6.336.500,00 | 6.890.000,00 | 3.511.913,73 | 45.796,01 | 0,44% | 1,80% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 713.531,55 | 0,00 | 0,00 | 733.892,87 | 20.361,32 | 2,85% | 2,85% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 0,00 | 6.011.284,20 | 4.900.000,00 | 1.131.304,18 | 20.019,98 | 0,33% | 1,14% |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 103.903,95 | 53.455.000,00 | 53.471.000,00 | 106.058,66 | 18.154,71 | 0,03% | 1,04% |
| BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 61.543,82 | 47.629.971,52 | 47.676.254,81 | 29.588,86 | 14.328,33 | 0,03% | 0,88% |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 951.295,81 | 0,00 | 958.759,56 | 0,00 | 7.463,75 | 0,78% | 1,48% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 45.493,25 | 9.104.378,94 | 9.134.595,66 | 19.094,16 | 3.817,63 | 0,04% | 1,03% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 248.775,28 | 0,00 | 0,00 | 252.030,40 | 3.255,12 | 1,31% | 1,31% |
| BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P... | 47.179,75 | 4.268.761,96 | 4.280.517,40 | 36.137,25 | 712,94 | 0,02% | 0,48% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 24,54 | 24.939,65 | 23.805,00 | 1.217,17 | 57,98 | 0,23% | 1,11% |
| RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 44.083,00 | 0,00 | 14.556,14 | 26.794,64 | -2.732,22 | -6,20% | -8,83% |
| Total Renda Fixa | | | | | 1.995.333,27 | 5,18% | |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|--|----------------|------------|----------|-----------------------------|-------------------|---------------|------------|
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 888.016,00 | 0,00 | 0,00 | 1.191.992,00 | 303.976,00 | 34,23% | 34,23% |
| | | | | Total Renda Variável | 303.976,00 | 34,23% | |

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|---------------|---------------|--------------|---------------------|--------------|------------|
| BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.707.663,53 | 80.816.901,78 | 76.364.981,19 | 7.851.026,26 | 1.691.442,14 | 2,05% | 31,04% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 6.072.075,21 | 10.528.052,74 | 14.500.000,00 | 3.361.278,83 | 1.261.150,88 | 7,60% | 22,59% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 504.061,75 | 11.963.057,39 | 6.000.000,00 | 7.487.004,29 | 1.019.885,15 | 8,18% | 30,05% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 7.855.024,76 | 937.244,00 | 4.687.000,00 | 4.871.621,18 | 766.352,42 | 8,72% | 11,79% |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 0,00 | 68.938.069,49 | 62.719.284,04 | 6.843.641,58 | 624.856,13 | 0,91% | 28,73% |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA | 0,00 | 5.645.320,23 | 2.000.000,00 | 4.254.399,39 | 609.079,16 | 10,79% | 18,05% |
| BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 5.238.611,42 | 0,00 | 5.458.759,56 | 0,00 | 220.148,14 | 4,20% | 10,23% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 5.334.343,10 | 1.040.000,00 | 6.290.037,62 | 252.030,40 | 167.724,92 | 2,63% | 6,49% |
| BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 2.817.255,32 | 71.655.000,00 | 74.474.818,05 | 106.058,66 | 108.621,39 | 0,15% | 6,08% |
| BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 3.430.247,09 | 59.612.247,80 | 63.093.480,65 | 29.588,86 | 80.574,62 | 0,13% | 5,78% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.358.112,18 | 6.814.939,65 | 8.236.293,26 | 1.217,17 | 64.458,60 | 0,79% | 5,72% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 0,00 | 10.346.500,00 | 6.890.000,00 | 3.511.913,73 | 55.413,73 | 0,54% | 16,43% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 0,00 | 700.000,00 | 0,00 | 733.892,87 | 33.892,87 | 4,84% | 29,73% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 0,00 | 6.011.284,20 | 4.900.000,00 | 1.131.304,18 | 20.019,98 | 0,33% | 5,74% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | 572.192,76 | 12.110.294,77 | 12.682.322,83 | 19.094,16 | 18.929,46 | 0,15% | 5,07% |
| BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P... | 35.425,26 | 5.650.030,41 | 5.651.066,93 | 36.137,25 | 1.748,51 | 0,03% | 2,05% |
| RP FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 189.383,21 | 0,00 | 139.958,16 | 26.794,64 | -22.630,41 | -11,95% | -15,11% |
| Total Renda Fixa | | | | | 6.721.667,69 | 1,73% | |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|--|----------------|------------|-----------|-----------------------------|-------------------|---------------|------------|
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 846.557,75 | 0,00 | 11.200,00 | 1.191.992,00 | 356.634,25 | 42,13% | 47,62% |
| | | | | Total Renda Variável | 356.634,25 | 42,13% | |