



RECIFE
PREFEITURA DA CIDADE



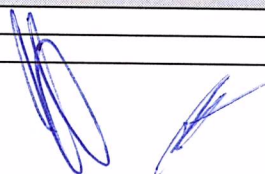
PREFEITURA DO RECIFE
AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA E ASSISTÊNCIA À SAÚDE DOS SERVIDOS
GERÊNCIA DE INVESTIMENTOS
AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE – APR

ART. 3º - B DA PORTARIA MPS N º 519/2011, INCLUÍDO PELO ART. 2º DA PORTARIA MPS N º 170, DE 25/04/2012, DOU DE 26/04/2012

AUTORIZAÇÃO DE APLICAÇÃO E RESGATE - APR		Nº / ANO:	4 /2020 - GI
Unidade Gestora do RPPS		OF. Nº:	4 /2020 - GI
Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores		Data:	07/01/2020
CNPJ: 05.244.336/0001-13			
Valor:		R\$ 227.300.000,00	
R\$ 227.300.000,00		Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"	
Duzentos e vinte e sete milhões e trezentos mil reais		Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "a"	
		Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"	
Sim para todos os fundos desta APR			
HISTÓRICO DA OPERAÇÃO/CARACTERÍSTICAS DOS ATIVOS:			
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO		
CNPJ do Fundo:	15.154.220/0001-47		
Segmento:	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações		
Tipo de Ativo:	Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"		
Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 20.768.000,00		
Quantidade de Cotas:	10.086.679,97763910		
Valor da Cota (R\$):	R\$	2,0589530000	
Data da Operação:	07/01/2020		
Data de Liquidação:	07/01/2020		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.230.554.210,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,688%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 82.825.175.450,00		
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	18,95%		
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.102.300.075,82	
% Recursos do Gestor com RPPS	21,82%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Forte		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACDEN	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	01/10/2019		
Data de Início FI:	01/11/2012		
Taxa Administração do FI (%):	1,50		
Índice de Referência do FI :	Índice Small Cap		

Tx Performance do FI (%):	Não possui	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	4	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	0,00	
Segmento:	R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:	0,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é superar o desempenho do Índice Small Cap (SMML) por meio do exercício de gestão ativa, proporcionando ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira composta por ativos de empresas de menor capitalização de mercado, não constituindo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado / Risco de Crédito / Risco de Liquidez / Risco de Concentração / Risco Sistemático e de Regulação / Risco Proveniente do uso de Derivativos. (Risco 5)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Muito Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,70%	
Retorno Médio Anual	8,77%	
Retorno Total	80,17%	
Maior Retorno	13,33%	
Menor Retorno	-13,84%	
Qtde. mês Positivo	48	
Qtde. mês Negativo	36	
Qtde. mês acima do Benchmark	40	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	44	
Risco Mensal Período	4,96%	
Risco Mensal 12 MESES	3,49%	
Risco Anual do Período	17,17%	
Retorno Relativo ao Benchmark	3,51%	
Sharpe	-0,06	
Information Ratio	0,11	
Tracking Error	5,04%	
VAR HISTÓRICO (95%)	8,98%	
VAR 12 MESES (95%)	11,01%	
Sharpe Modificado	-0,06	
Beta (12 meses)	0,97	
Erro Quadrático Médio (EQM)	1,45%	
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	

Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Data da reunião do Comitê de Investimentos	18/12/2019
Outras Observações:		
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"		
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?		Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?		Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?		Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?		Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?		Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?		Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 7º, VII, "a"		
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?		Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?		Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?		Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?		Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco		
Art. 8º, IV, "a"		
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?		Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantém a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?		Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?		Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?		Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	
CNPJ do Fundo:	30.068.224/0001-04	
Segmento:	FI de Ações - Geral	
Tipo de Ativo:	Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "a"	
Tipo de operação realizada:	Aplicação	
Valor da operação:	R\$ 35.000.000,00	
Quantidade de Cotas:	27.933.585,10804710	



Valor da Cota (R\$):	R\$	1,2529720000
Data da Operação:		07/01/2020
Data de Liquidação:		07/01/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	546.366.680,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		6,406%
Limite Máximo por PL do fundo		15,00%
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7 00000004-5
Administrador:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Administrador:		00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:		01/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN		Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS		R\$ 82.825.175.450,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.		18,95%
Gestor:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Gestor:		00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:		01/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN		Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.102.300.075,82
% Recursos do Gestor com RPPS		21,82%
Empresa de Rating		Fitch Ratings
Conceito		Forte
Representação do conceito		Muito bom
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria		Sim
Distribuidor:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Distribuidor:		00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:		01/10/2019
Data de Início FI:		25/06/2019
Taxa Administração do FI (%):		1,50
Índice de Referência do FI :		IBOVESPA
Tx Performance do FI (%):		Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):		Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):		Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Dispensado
Carência (dias):		0 dias
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		23
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		sim
CNPJ do Fundo:		20.658.576/0001-58; 14.866.273/0001-28; 11.392.165/0001-72; 17.898.650/0001-07; 26.768.800/0001-40; 28.470.587/0001-11; 31.533.338/0001-32; 11.403.850/0001-57; 05.164.353/0001-40; 15.862.830/0001-03.
Segmento:		Renda Variável
Tipo de Ativo:		FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"
% Carteira do Fundo:		16,632;16,441;12,271;10,868;10,728;10,652;8,423;7,287;4,474;3,053.
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	

Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é superar a variação do Índice Bovespa, por meio da aplicação dos recursos em cotas de fundos de investimento, que invistam em ativos financeiros e modalidades operacionais conforme a regulamentação em vigor, e dentro dos limites estabelecidos em sua política de investimento, não constituindo tal objetivo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA.
	Principais riscos do fundo:	Risco de mercado, de juros, de liquidez e os demais previstos no regulamento
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior

Retorno Médio Mensal	2,07%
Retorno Médio Anual	27,82%
Retorno Total	13,06%
Maior Retorno	5,24%
Menor Retorno	-0,74%
Qtde. mês Positivo	5
Qtde. mês Negativo	1
Qtde. mês acima do Benchmark	4
Qtde. mês abaixo do Benchmark	3
Risco Mensal Período	2,13%
Risco Mensal 12 MESES	-
Risco Anual do Período	7,36%
Retorno Relativo ao Benchmark	-51,25%
Sharpe	-21,49
Information Ratio	-49,01
Tracking Error	8,37%
VAR HISTÓRICO (95%)	5,58%
VAR 12 MESES (95%)	-
Sharpe Modificado	12,51
Beta (12 meses)	-
Erro Quadrático Médio (EQM)	2,25%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Prvidência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos: 18/12/2019

Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco

Art. 7º, III, "a" ; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"

Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não

Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco
Art. 7º, VII, "a"

A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo

O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
CNPJ do Fundo:	10.577.519/0001-90
Segmento:	FI 100% Títulos Públicos
Tipo de Ativo:	Fundos 100% Títulos Públicos - Art. 7º, I, "b"
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 30.532.000,00
Quantidade de Cotas:	12.749.987,57657110
Valor da Cota (R\$):	R\$ 2,3946690000
Data da Operação:	07/01/2020
Data de Liquidação:	07/01/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 2.173.238.520,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	1,405%
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal 50-7 00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-06
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 82.825.175.450,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	18,95%
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$ 81.102.300.075,82
% Recursos do Gestor com RPPS	21,82%
Empresa de Rating	Fitch Ratings
Conceito	Forte
Representação do conceito	Muito bom
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria e Riscos obrigatórios pelo BACEN	Sim
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-06

Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:		
Data de Início FI:	01/10/2019	
Taxa Administração do FI (%):	11/05/2012	
Índice de Referência do FI :	0,20	
Tx Performance do FI (%):	IRF-M 1+	
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui	
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui	
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance	
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado	
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado	
Carência (dias):	0 dias	
Data Listagem Bolsa:	Não listado	
Resgate (dias):	0	
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado	
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL	
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não	
CNPJ do Fundo:	0,00	
Segmento:	R\$ 0,00	
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00	
% Carteira do Fundo:	0,00	
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	Proporcionar rentabilidade compatível ao IRF-M 1+, por meio da aplicação em títulos públicos federais.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado, Crédito, Liquidez, de Concentração, Sistêmico e de Regulação, e Proveniente do uso de Derivativos.
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Médio
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	0,96%	
Retorno Médio Anual	12,20%	
Retorno Total	137,10%	
Maior Retorno	5,24%	
Menor Retorno	-2,71%	
Qtde. mês Positivo	69	
Qtde. mês Negativo	21	
Qtde. mês acima do Benchmark	31	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	59	
Risco Mensal Período	1,47%	
Risco Mensal 12 MESES	1,07%	
Risco Anual do Período	5,08%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-1,83%	
Sharpe	0,51	
Information Ratio	-0,81	
Tracking Error	0,34%	
VAR HISTÓRICO (95%)	3,39%	
VAR 12 MESES (95%)	3,60%	
Sharpe Modificado	0,60	
Beta (12 meses)	0,92	
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,10%	
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate	
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações	
	Data da reunião do Comitê de Investimentos	18/12/2019

Outras Observações:	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantém a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR
CNPJ do Fundo:	DIVIDENDOS RPPS
Segmento:	15.154.441/0001-15
Tipo de Ativo:	FI de Ações - Geral
Tipo de operação realizada:	Fundos de Ações em geral - Art. 8º, II, "a"
Valor da operação:	Aplicação
Quantidade de Cotas:	R\$ 40.000.000,00
	18.475.596,96963260

Valor da Cota (R\$):	R\$	2,1650180000
Data da Operação:		07/01/2020
Data de Liquidação:		07/01/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	885.595.660,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:		4,517%
Limite Máximo por PL do fundo		15,00%
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7 00000004-5
Administrador:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Administrador:		00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:		01/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN		Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS		R\$ 82.825.175.450,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.		18,95%
Gestor:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Gestor:		00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:		01/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN		Sim
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.102.300.075,82
% Recursos do Gestor com RPPS		21,82%
Empresa de Rating		Fitch Ratings
Conceito		Forte
Representação do conceito		Muito bom
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria		Sim
Distribuidor:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Distribuidor:		00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:		01/10/2019
Data de Início FI:		23/08/2012
Taxa Administração do FI (%):		1,72
Índice de Referência do FI :		IDIV
Tx Performance do FI (%):		0,20
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):		IDIV
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):		100,00
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		SIM
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Dispensado
Carência (dias):		0 dias
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		2
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Sim
CNPJ do Fundo:		15.154.458/0001-72
Segmento:		Renda Variável
Tipo de Ativo:		FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, "a"
% Carteira do Fundo:		1,00

Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar aos seus cotistas a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em cotas do fundo CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES, doravante denominado FUNDO INVESTIDO, inscrito no CNPJ/MF sob o nº 15.154.458/0001-72, administrado pela ADMINISTRADORA e gerido pela GESTORA, que tem por objetivo buscar a valorização de suas cotas por meio da administração objetiva e concentrada de ações, bônus de subscrição, debêntures conversíveis e demais títulos de emissão de companhias abertas que passam por situações especiais e que, com o monitoramento adequado e, através do acompanhamento e participação contínuos das suas atividades, tem grande potencial para a distribuição contínua de dividendos.
	Principais riscos do fundo:	Riscos do mercado de ações (Risco 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior

Retorno Médio Mensal	0,80%
Retorno Médio Anual	9,99%
Retorno Total	99,40%
Maior Retorno	12,57%
Menor Retorno	-10,58%
Qtde. mês Positivo	53
Qtde. mês Negativo	34
Qtde. mês acima do Benchmark	42
Qtde. mês abaixo do Benchmark	45
Risco Mensal Período	3,87%
Risco Mensal 12 MESES	3,52%
Risco Anual do Período	13,40%
Retorno Relativo ao Benchmark	2,45%
Sharpe	0,02
Information Ratio	0,02
Tracking Error	15,00%
VAR HISTÓRICO (95%)	7,23%
VAR 12 MESES (95%)	8,96%
Sharpe Modificado	0,03
Beta (12 meses)	0,76
Erro Quadrático Médio (EQM)	4,31%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações Data da reunião do Comitê de Investimentos : 18/12/2019
Outras Observações:	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não

Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50
CNPJ do Fundo:	15.154.441/0001-15
Segmento:	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações
Tipo de Ativo:	Fundo de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações - Art. 8º, I, "a"

Tipo de operação realizada:	Aplicação		
Valor da operação:	R\$ 51.000.000,00		
Quantidade de Cotas:	34.085.668,64720000		
Valor da Cota (R\$):	R\$	1,4962300000	
Data da Operação:	07/01/2020		
Data de Liquidação:	07/01/2020		
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$	1.169.824.650,00	
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	4,360%		
Limite Máximo por PL do fundo	15,00%		
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal	50-7	00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019		
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 82.825.175.450,00		
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	18,95%		
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019		
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim		
Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.102.300.075,82	
% Recursos do Gestor com RPPS	21,82%		
Empresa de Rating	Fitch Ratings		
Conceito	Forte		
Representação do conceito	Muito bom		
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria	Sim		
Distribuidor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL		
CNPJ do Distribuidor:	00.360.305/0001-04		
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:	01/10/2019		
Data de Início FI:	18/02/2008		
Taxa Administração do FI (%):	0,70		
Índice de Referência do FI :	IBRX-50		
Tx Performance do FI (%):	Não possui		
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):	Não possui		
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):	Não possui		
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010	Não possui taxa de performance		
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:	Dispensado		
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:	Dispensado		
Carência (dias):	0 dias		
Data Listagem Bolsa:	Não listado		
Resgate (dias):	4		
Cód. Negociação Bolsa:	Não listado		
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:	INVESTIDOR GERAL		
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:	Não		
CNPJ do Fundo:	0,00		
Segmento:	R\$ 0,00		
Tipo de Ativo:	R\$ 0,00		
% Carteira do Fundo:	0,00		
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.		

Características dos Ativos (Caracterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	O objetivo do FUNDO é proporcionar ao Cotista a valorização de suas cotas por meio da aplicação dos recursos em carteira de ativos financeiros, visando superar, no longo prazo, a rentabilidade do Índice Brasil - 50 (IBX- 50), calculado e divulgado pela BM&FBOVESPA S.A - Bolsa de Valores, Mercadorias e Futuros, observados os riscos de flutuações desse indicador, não constituindo tal objetivo, em qualquer hipótese, garantia ou promessa de rentabilidade por parte da ADMINISTRADORA
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado / Risco de Crédito / Risco de Liquidez / Risco de Concentração / Risco Sistêmico e de Regulação / Risco Proveniente do uso de Derivativos. (Risco 4)
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo		Curto Prazo

Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior

Retorno Médio Mensal	0,34%
Retorno Médio Anual	4,21%
Retorno Total	44,49%
Maior Retorno	11,94%
Menor Retorno	-13,12%
Qtde. mês Positivo	58
Qtde. mês Negativo	49
Qtde. mês acima do Benchmark	43
Qtde. mês abaixo do Benchmark	64
Risco Mensal Período	5,19%
Risco Mensal 12 MESES	3,47%
Risco Anual do Período	17,98%
Retorno Relativo ao Benchmark	-21,44%
Sharpe	-0,31
Information Ratio	-0,98
Tracking Error	2,91%
VAR HISTÓRICO (95%)	9,02%
VAR 12 MESES (95%)	10,00%
Sharpe Modificado	-0,33
Beta (12 meses)	0,93
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,87%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPEV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
Outras Observações:	Data da reunião do Comitê de Investimentos : 18/12/2019
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo

Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo
Fundo:	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
CNPJ do Fundo:	15.154.441/0001-15
Segmento:	Fundo de Ações – BDR Nível I - Art. 9º, III
Tipo de Ativo:	Fundo de Ações – BDR Nível I - Art. 9º, III
Tipo de operação realizada:	Aplicação
Valor da operação:	R\$ 50.000.000,00
Quantidade de Cotas:	14.514.866,70707610
Valor da Cota (R\$):	R\$ 3,4447440000
Data da Operação:	07/01/2020
Data de Liquidação:	07/01/2020
Patrimônio Líquido do Fundo (R\$):	R\$ 676.375.300,00
(%) no Patrimônio Líquido do fundo:	7,392%
Limite Máximo por PL do fundo	10,00%
Banco/Agência/Conta:	Caixa Econômica Federal 50-7 00000004-5
Administrador:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Administrador:	00.360.305/0001-08
Data do Termo de Credenciamento do Administrador:	01/10/2019
Administrador com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim
Volume de Recursos do Administrador com RPPS	R\$ 82.825.175.450,00
% Recursos do Administrador com RPPS. O administrador do fundo de investimento detenha, no máximo, 50% (cinquenta por cento) dos recursos sob sua administração oriundos de regimes próprios de previdência social.	18,95%
Gestor:	CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Gestor:	00.360.305/0001-04
Data do Termo de Credenciamento do Gestor:	01/10/2019
Gestor com Comitê de auditoria e comitê de riscos, obrigado, pelo BACEN	Sim

Volume de Recursos do Gestor com RPPS	R\$	81.102.300.075,82
% Recursos do Gestor com RPPS		21,82%
Empresa de Rating		Fitch Ratings
Conceito		Forte
Representação do conceito		Muito bom
O fundo atende a Resolução 3.922/2010, quanto ao Comitê de Auditoria		Sim
Distribuidor:		CAIXA ECONOMICA FEDERAL
CNPJ do Distribuidor:		00.360.305/0001-08
Data do Termo de Credenciamento do Distribuidor:		01/10/2019
Data de Início FI:		24/06/2013
Taxa Administração do FI (%):		0,70
Índice de Referência do FI :		BDRX
Tx Performance do FI (%):		Não possui
Tx Performance (Índ. de Ref.: Qual Índ.Ref. é decidido se a Tx. performance será cobrada ou não):		Não possui
Tx Performance (% a superar: Informar % do Índ. Ref. que o fundo deve performar para haver a cobrança de tx performance):		Não possui
Taxa de Performance atende as condições da Resolução 3.922/2010		Não possui taxa de performance
Agência de Classificação de Risco que classificou o FI:		Dispensado
Classificação de risco do FI conforme Agência de Classificação de Risco:		Dispensado
Carência (dias):		0 dias
Data Listagem Bolsa:		Não listado
Resgate (dias):		3
Cód. Negociação Bolsa:		Não listado
Fundo Destinado à Categoria de Investidor:		INVESTIDOR GERAL
Fundo Investe em Cotas de Outros Fundos? Se sim, informar todos os fundos:		Não
CNPJ do Fundo:		0,00
Segmento:		R\$ 0,00
Tipo de Ativo:		R\$ 0,00
% Carteira do Fundo:		0,00
Descrição da operação (como foi realizada a negociação):	Autorizada pelo Comitê de Investimentos. Trata-se de Instituição com boa posição no Ranking ANBIMA de Gestores e devidamente credenciada pela Autarquia Municipal de Previdência e Assistência à Saúde dos Servidores. A operação faz parte do processo de diversificação da carteira de investimentos com vistas ao atingimento/superação da meta atuarial. A operação está aderente com a Política de Investimentos.	
Características dos Ativos(Characterizar o Fundo de Investimento negociado)	Objetivos:	Proporcionar rentabilidade por meio de carteira diversificada de recibos de ações de empresas estrangeiras - Brazilian Depositary Receipts (BDR) títulos públicos federais.
	Principais riscos do fundo:	Risco de Mercado, Crédito, Liquidez, de Concentração, Sistêmico e de Regulação, Proveniente do uso de Derivativos, Proveniente de Mercado Externo, de Contraparte, e Operacional
	Risco do Fundo atribuído pelo Administrador	Risco Alto
Prazo de Liquidação: Até 60 dias = Curto Prazo / Acima de 60 dias até 5 anos = Médio Prazo / Acima de 5 anos = Longo Prazo	Curto Prazo	
Dados com base desde 2011 ou Início do fundo até mês anterior		
Retorno Médio Mensal	1,62%	
Retorno Médio Anual	21,29%	
Retorno Total	245,11%	
Maior Retorno	12,88%	
Menor Retorno	-14,16%	
Qtde. mês Positivo	51	
Qtde. mês Negativo	26	
Qtde. mês acima do Benchmark	24	
Qtde. mês abaixo do Benchmark	53	
Risco Mensal Período	5,09%	
Risco Mensal 12 MESES	5,20%	
Risco Anual do Período	17,62%	
Retorno Relativo ao Benchmark	-15,41%	
Sharpe	0,64	

Information Ratio	-1,43
Tracking Error	2,25%
VAR HISTÓRICO (95%)	10,12%
VAR 12 MESES (95%)	10,45%
Sharpe Modificado	0,67
Beta (12 meses)	0,92
Erro Quadrático Médio (EQM)	0,68%
Compatibilidade da aplicação com as obrigações presentes e futuras do RPPS:	Sim, porém, não há a necessidade de Atestado de Compatibilidade em razão do prazo curto da carência e/ou resgate
Análise / Parecer do Conselho Municipal de Previdência ou Comitê de Investimentos, conforme previsto na legislação do RPPS (Alçadas):	Operação deliberada/autorizada pelo Comitê de Investimentos da RECIPIREV através da Planilha/Estudo Técnico de Deliberações
	Data da reunião do Comitê de Investimentos 18/12/2019
Outras Observações:	
Caso o fundo esteja enquadrado nos artigos a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, III, "a"; Art. 7º, IV, "a"; Art. 7º, IV, "b"; Art. 7º, V, "b"; Art. 7º, VII, "a"; Art. 7º, VII, "b"; Art. 7º, VII, "c"; Art. 8º, I, "a"; Art. 8º, II, "a"; Art. 8º, III; Art. 8º, IV, "a"; Art. 8º, IV, "b"	
Fundo possui ativos de emissores privados como ativo final na carteira?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por instituição financeira ?	Não
Há ativos financeiros não emitidos por companhias abertas, operacionais e registrados na CVM?	Não
Há ativos financeiros emitidos por securitizadoras (CRI ou CRA)?	Não
Há ativos financeiros que não são cotas de classe sênior de FIDC?	Não
Há ativos financeiros ou que os respectivos emissores não são considerados de baixo risco de crédito?	Não
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 7º, VII, "a"	
A série /classe das cotas é considerado de baixo risco de crédito?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do fundo determina que o limite máximo de concentração em PJ seja de 20%?	Pergunta não se aplica ao fundo
Foi comprovado que o gestor do FI já realizou no mínimo 10 ofertas públicas de cotas seniores de FIDC encerradas e integralmente liquidadas?	Pergunta não se aplica ao fundo
O total das aplicações de RPPS representa no máximo, 50% do total de cotas seniores?	Pergunta não se aplica ao fundo
O FI teve suas demonstrações financeiras auditadas e publicadas anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
Caso o fundo esteja enquadrado no artigo a seguir, responder SIM ou NÃO, do contrário deixar em branco	
Art. 8º, IV, "a"	
O FIP é qualificado como entidade de investimento, nos termos da regulamentação específica da CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FIP determina que o valor justo dos ativos investidos esteja respaldado em laudo de avaliação elaborado por Auditores Independentes ou Analistas de Valores Mobiliários autorizados pela CVM?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que o valor justo dos ativos emitidos por cada uma das empresas investidas corresponda a, no máximo 25% do total do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que a cobrança de taxa de performance seja feita somente após o recebimento, pelos investidores, da totalidade de seu capital integralizado, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno nele previstos?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do FI, ou gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, mantem a condição de cotista do fundo em percentual equivalente a, no mínimo, 5% do capital subscrito do fundo?	Pergunta não se aplica ao fundo
O regulamento do FI determina que as companhias ou sociedades investidas pelo fundo tenham suas demonstrações financeiras auditadas por auditor independente registrado na CVM e publicadas, no mínimo, anualmente?	Pergunta não se aplica ao fundo
O gestor do fundo já realizou, nos últimos 10 anos, desinvestimento integral de, pelo menos, 3 sociedades investidas no Brasil por meio de FIP e os referidos desinvestimentos resultaram em recebimento da totalidade do capital integralizado nas referidas sociedades investidas, devidamente atualizado pelo índice de referência e taxa de retorno previstos no regulamento?	Pergunta não se aplica ao fundo

Anexo: Lâmina(s) do fundo(s) e ofício(s)

PROPONENTE

Andreson Carlos Gomes de Oliveira
Chefe de Divisão de Investimentos
CPF:052.430.264-25
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 05/12/2020

GESTOR/AUTORIZADOR

José Marcos Alves de Barros
Gerente de Investimentos
CPF:334.826.354-00
Entidade Certificadora: ANBIMA
CPA 20 e CEA
Validade da Certificação: 21/11/2021

Ilma Senhora
MARIA VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
Caixa Econômica Federal – Agência Cais do Apolo
NESTA

Senhora Gerente,

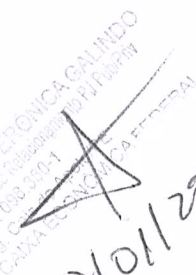
Solicitamos efetuar as seguintes aplicações vinculadas à conta 4-5.

- a) R\$ 20.768.000,00 (Vinte milhões, setecentos e sessenta e oito mil reais), no fundo CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES CNPJ: 15.154.220/0001-47;
- b) R\$ 35.000.000,00 (Trinta e cinco milhões de reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO DE AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR CNPJ: 30.068.224/0001-04;
- c) R\$ 30.532.000,00 (Trinta milhões, quinhentos e trinta e dois mil reais), no fundo CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP CNPJ: 10.577.519/0001-90;
- d) R\$ 40.000.000,00 (Quarenta e milhões de reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS CNPJ: 15.154.441/0001-15;
- e) R\$ 51.000.000,00 (Cinquenta milhões de reais), no FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 CNPJ: 03.737.217/0001-77;
- f) R\$ 50.000.000,00 (Cinquenta milhões de reais), no fundo CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I CNPJ: 17.502.937/0001-68.

Justificativa da aplicação ou resgate: APR 004/2020


JOSÉ MARCOS ALVES DE BARROS
GERENTE DE INVESTIMENTOS


FRANCISCO CANINDÉ ANTUNES FURTADO JÚNIOR
DIRETOR VICE PRESIDENTE

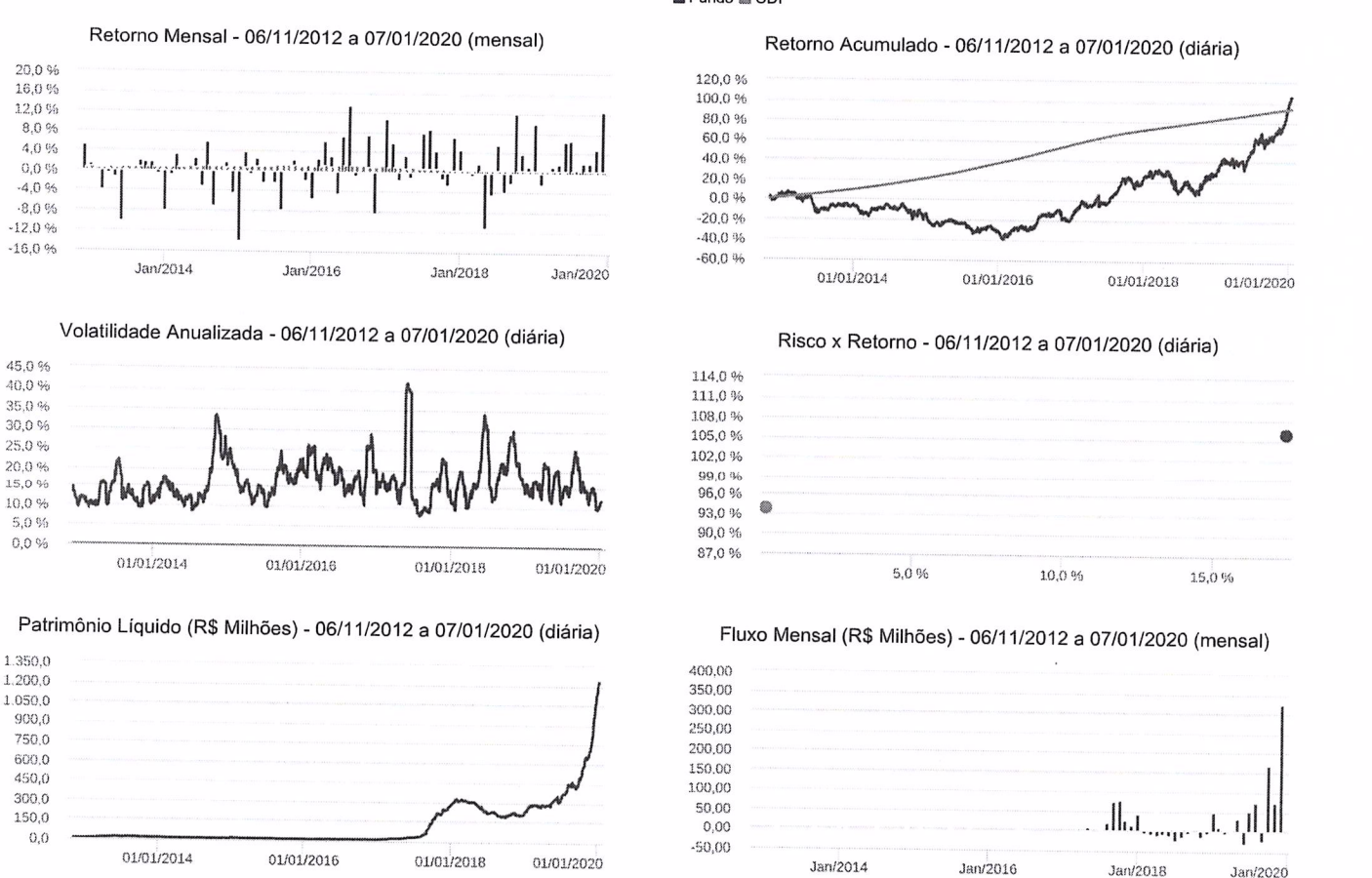

M. VERÔNICA GALINDO
Gerente de Atendimento PJ - Público
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Características		Informações Operacionais											
CNPJ: 15.154.220/0001-47		Aplicação Mínima: R\$ 100,00											
Gestão: Caixa Econômica Federal		Aplicação Adicional: R\$ 50,00											
Administrador: Caixa Econômica Federal		Saldo Mínimo: R\$ 50,00											
Taxa de Administração: 1,50%		Resgate Mínimo: R\$ 50,00											
Taxa de Administração (Máxima): 1,50%		Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du											
Classificação Anbima: Ações Small Caps		Conversão da Cota para Resgate: D+1 du											
Código de Referência: 317594		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du											
Início do Fundo: 01/11/2012													

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19
Fundo	105,90	2,45	56,60	64,11	148,18	12,55	4,77	2,06	2,02	0,68	6,67	6,41	1,76	1,22	-0,25	-2,50	10,10
% do CDI	112,99	3.581,78	958,96	502,75	616,34	3.349,11	1.254,05	428,95	435,98	135,92	1.175,34	1.366,63	323,75	234,60	-52,56	-506,31	1.859,80
CDI	93,72	0,07	5,90	12,75	24,04	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54
Ibovespa	100,42	0,88	26,76	48,34	93,70	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82
IBX	132,74	1,10	29,14	51,48	98,53	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71
IGP-M	49,96	0,10	7,43	15,42	14,93	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	2,058953	1.230.554,21	441.222,86	16,31%	-8,96%	7,74%	-28,36	16,31%	12,55%	-2,50%	9
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos



Composição da Carteira nov/2019

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

07/01/2020

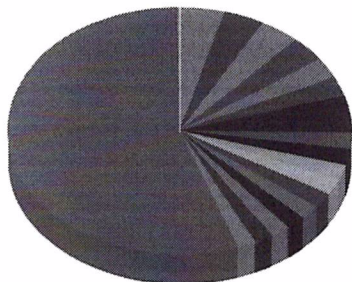
Performance dos Fundos em Carteira											Retorno (%) / % do Benchmark - CDI	
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	12 meses	
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio	
CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4,46	0,07	97,00	481,05	99,57	481,05	99,57	481,05	99,57	-	RS 6.390.639.890,5	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	
Ações	90,79%	90,67%	90,61%	90,64%	92,80%	92,53%	91,97%	88,12%	
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	7,46%	7,67%	7,78%	7,45%	6,52%	6,71%	6,80%	10,44%	
Cotas de Fundos	4,46%	2,59%	3,91%	1,41%	1,99%	1,59%	1,12%	1,25%	
Outras Aplicações	0,84%	0,84%	0,84%	0,85%	-	-	0,00%	0,00%	
Valores a receber	0,33%	0,33%	0,21%	0,22%	0,26%	0,27%	0,49%	0,94%	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Valores a pagar	-2,17%	-1,59%	-2,72%	-0,45%	-1,21%	-0,77%	-0,35%	-0,59%	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	730.940,34	626.415,19	448.122,10	463.860,81	387.161,30	314.487,86	323.926,66	286.241,95	
Data da Divulgação	04/12/2019	06/11/2019	08/10/2019	03/09/2019	08/08/2019	05/07/2019	06/06/2019	08/05/2019	

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2019



Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA	4,46 %
REFERENCIADO DI L...	
YDUQS PART ON NM - YDUQ3	4,06 %
ENEVA ON NM - ENEV3	3,98 %
VIAVAREJO ON N2 - VVAR3	3,45 %
TOTVS ON NM - TOTS3	2,78 %
FLEURY ON NM - FLRY3	2,78 %
QUALICORP ON NM - QUAL3	2,63 %
BRADSPAR PN N1 - BRAP4	2,43 %
CYRELA REALT ON NM - CYRE3	2,26 %
LIGHT S/A ON NM - LIGT3	2,23 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - SAPR11	2,20 %
BANRISUL PNB N1 - BRSR6	2,14 %
CVC BRASIL ON NM - CVCB3	2,11 %
Valores a pagar / Liquidação - Nota de Corretagem	-2,04 %
SANEPAR PN - SAPR4	1,98 %
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários - TAEE11	1,97 %
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	1,88 %
SANTOS BRP ON NM - STBP3	1,81 %
Lançamentos positivos menores que 1,81%	58,75 %
Lançamentos negativos maiores que -2,04%	-0,13 %

:: CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES

07/01/2020

Características

CNPJ: 30.068.224/0001-04
 Gestão: Caixa Econômica Federal
 Administrador: Caixa Econômica Federal
 Taxa de Administração: 1,50%
 Taxa de Administração (Máxima): 1,50%
 Classificação Anbima: Ações Livre
 Código de Referência: 500909
 Início do Fundo: 25/06/2019

Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00
 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00
 Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00
 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00
 Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du
 Conversão da Cota para Resgate: D+23 du
 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+25 du

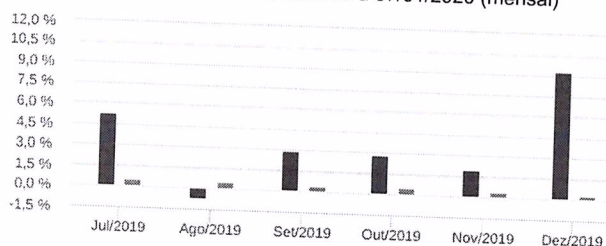
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19
Fundo	25,30	1,39	-	-	-	9,30	1,94	2,82	2,98	-0,74	5,24	-	-	-	-	-	-
% do CDI	858,73	2.035,34	-	-	-	2.481,77	509,63	588,94	643,28	-147,25	922,00	-	-	-	-	-	-
CDI	2,95	0,07	5,90	12,75	24,04	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54
Ibovespa	16,55	0,88	26,76	48,34	93,70	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82
IBX	17,82	1,10	29,14	51,48	98,53	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71
IGP-M	3,04	0,10	7,43	15,42	14,93	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,252972	546.366,68	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

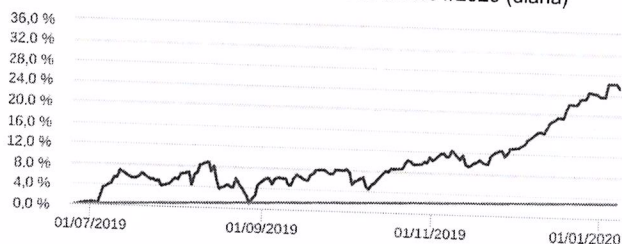
Gráficos

■ Fundo ■ CDI

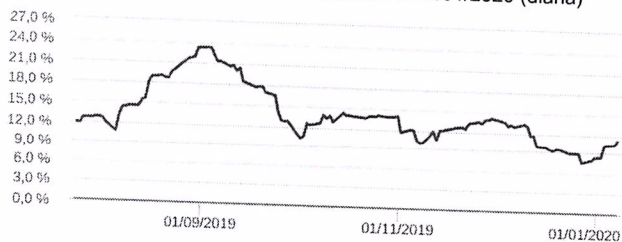
Retorno Mensal - 26/06/2019 a 07/01/2020 (mensal)



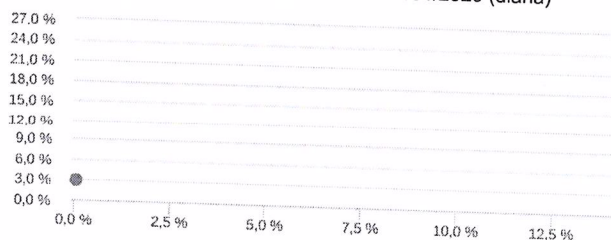
Retorno Acumulado - 26/06/2019 a 07/01/2020 (diária)



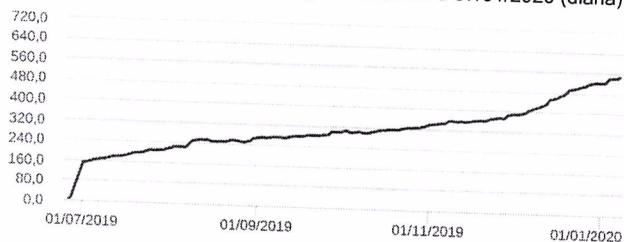
Volatilidade Anualizada - 26/06/2019 a 07/01/2020 (diária)



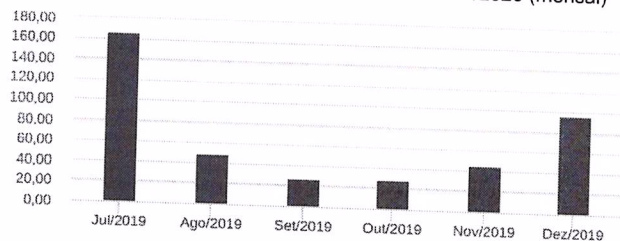
Risco x Retorno - 26/06/2019 a 07/01/2020 (diária)



Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 26/06/2019 a 07/01/2020 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 26/06/2019 a 07/01/2020 (mensal)



Composição da Carteira

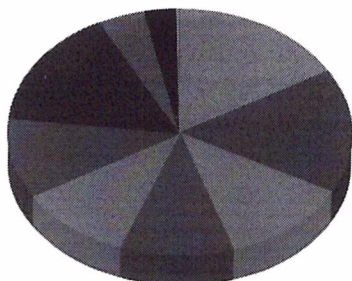
nov/2019

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
 Fonte: Quantum Axis.

Performance dos Fundos em Carteira												Retorno (%) / % do Benchmark - CDI	
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início		
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio		
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	16,63	1,03	1.512,11	292,20	434,02	292,20	434,02	292,20	434,02	-			
BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	16,44	1,36	1.988,78	253,47	263,26	253,47	263,26	253,47	263,26	-			
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12,27	2,35	3.440,31	629,23	406,85	629,23	406,85	629,23	406,85	-			
SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10,87	1,57	2.289,07	238,65	282,84	238,65	282,84	238,65	282,84	-			
LEBLON AÇÕES II FIC AÇÕES	10,73	1,92	2.809,63	125,01	604,84	125,01	604,84	125,01	604,84	-			
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	10,65	1,87	2.736,93	513,21	357,98	513,21	357,98	513,21	357,98	-			
OCEANA SELECTION 30 FIC AÇÕES	8,42	1,17	1.706,84	47,78	788,62	47,78	788,62	47,78	788,62	-			
CLARITAS VALOR FEEDER FI AÇÕES	7,29	2,04	2.982,69	263,26	175,10	263,26	175,10	263,26	175,10	-			
CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	4,47	0,07	98,89	280,52	100,55	280,52	100,55	280,52	100,55	-			
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	3,05	1,62	2.368,36	170,91	176,97	170,91	176,97	170,91	176,97	-			

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	
Cotas de Fundos	100,83%	100,61%	100,12%	101,39%	100,02%	203,77%	-	-	
Valores a receber	0,00%	0,53%	2,34%	0,00%	0,23%	-	-	-	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	
Valores a pagar	-0,35%	-0,30%	-0,76%	-0,31%	-0,11%	-0,26%	-	-	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	386.313,87	335.338,83	298.849,60	263.556,06	216.181,13	47.805,71	-	-	
Data da Divulgação	04/12/2019	06/11/2019	08/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019	-	-	

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.



■ Cotas de MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	16,63 %
■ Cotas de BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	16,44 %
■ Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12,27 %
■ Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10,87 %
■ Cotas de LEBLON AÇÕES II FIC AÇÕES	10,73 %
■ Cotas de VINCI MOSAICO FI AÇÕES	10,65 %
■ Cotas de OCEANA SELECTION 30 FIC AÇÕES	8,42 %
■ Cotas de CLARITAS VALOR FEEDER FI AÇÕES	7,29 %
■ Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	4,47 %
■ Cotas de APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	3,05 %
■ Outros Valores a pagar	-0,14 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,11 %
■ Valores a pagar / Ajustes Patrimônio Devedor	-0,10 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Outros Valores a receber	0,00 %

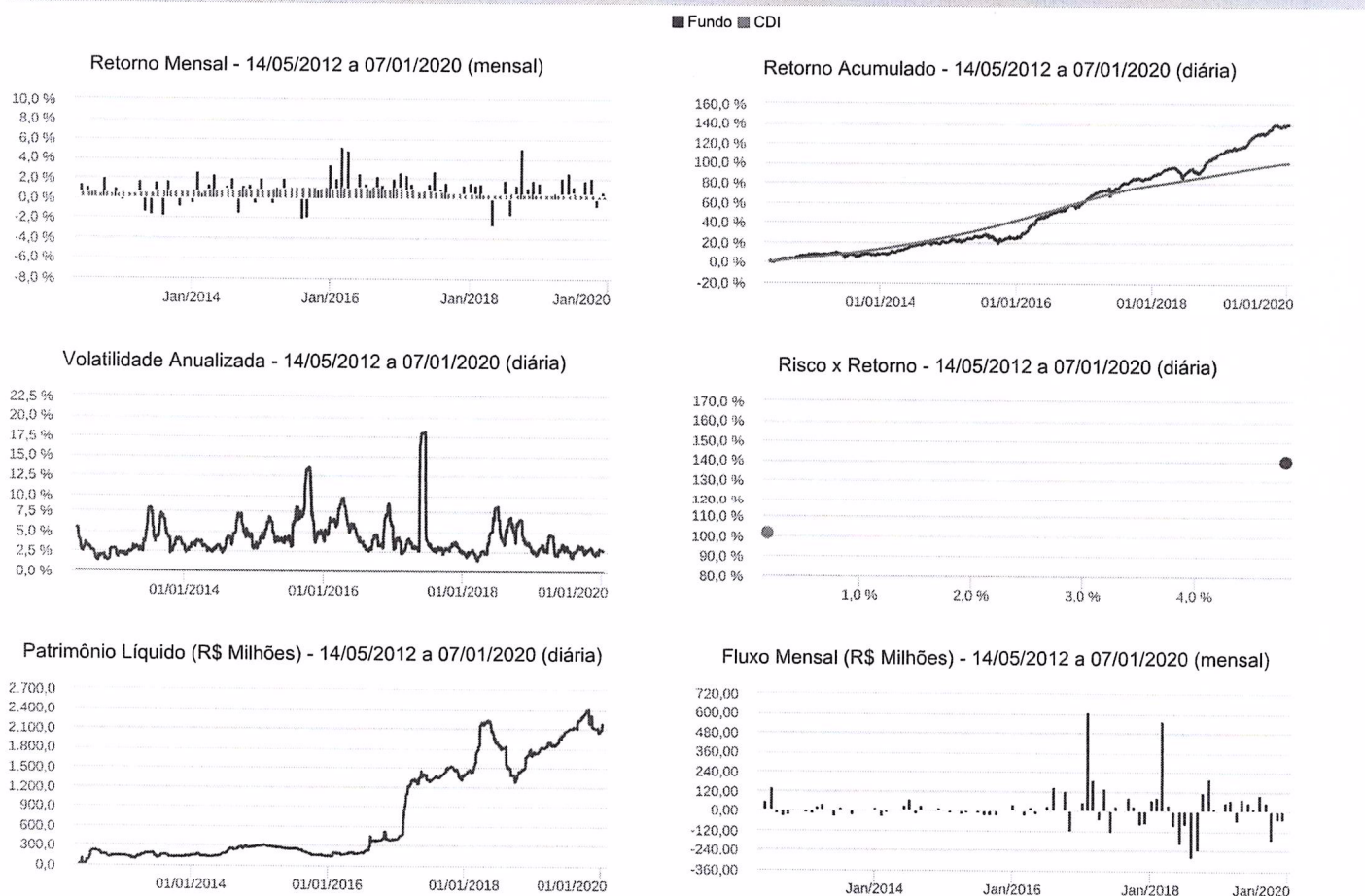
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

Características	Informações Operacionais
CNPJ: 10.577.519/0001-90	Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00
Gestão: Caixa Econômica Federal	Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Administrador: Caixa Econômica Federal	Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração: 0,20%	Resgate Mínimo: R\$ 0,00
Taxa de Administração (Máxima): Não possui	Conversão da Cota para Aplicação: D+0
Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados	Conversão da Cota para Resgate: D+0
Código de Referência: 303887	Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0
Início do Fundo: 11/05/2012	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19
Fundo	139,47	0,09	13,58	27,22	48,68	0,70	-0,85	2,22	1,85	0,05	1,28	2,71	2,12	0,59	0,59	0,21	1,66
% do CDI	138,18	126,05	230,16	213,48	202,50	186,82	-222,67	463,48	399,97	9,13	225,48	577,81	390,26	113,77	126,32	42,58	305,76
CDI	100,93	0,07	5,90	12,75	24,04	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54
Ibovespa	96,25	0,88	26,76	48,34	93,70	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82
IBX	138,31	1,10	29,14	51,48	98,53	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71
IGP-M	57,71	0,10	7,43	15,42	14,93	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark
Fundo	2,394669	2.173.238,52	2.028.792,72	2,98%	-1,26%	1,41%	3,93	2,97%	2,71%	-0,85%	8
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0

Gráficos



Composição da Carteira nov/2019

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

07/01/2020

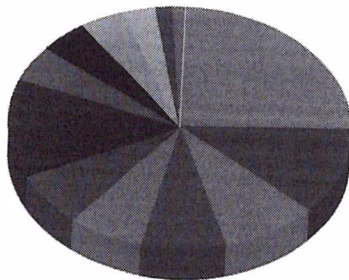
Performance dos Fundos em Carteira

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Não há fundos(FI) na carteira													

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)

Tipo de Aplicação	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19
Títulos Públicos	75,65%	73,59%	70,52%	70,90%	68,60%	87,95%	90,66%	78,26%
Operações Compromissadas	24,34%	26,44%	29,48%	28,98%	31,48%	11,98%	9,31%	21,69%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,01%	-0,04%	0,01%	0,13%	-0,08%	0,07%	0,03%	0,06%
Valores a receber	0,01%	0,00%	0,01%	0,13%	0,00%	0,07%	0,03%	0,06%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,04%	-0,00%	-0,00%	-0,08%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.111.375,26	2.184.287,18	2.308.726,83	2.212.647,72	2.107.362,70	2.064.641,18	1.957.722,92	1.841.553,83
Data da Divulgação	04/12/2019	06/11/2019	07/10/2019	03/09/2019	05/08/2019	05/07/2019	06/06/2019	07/05/2019

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

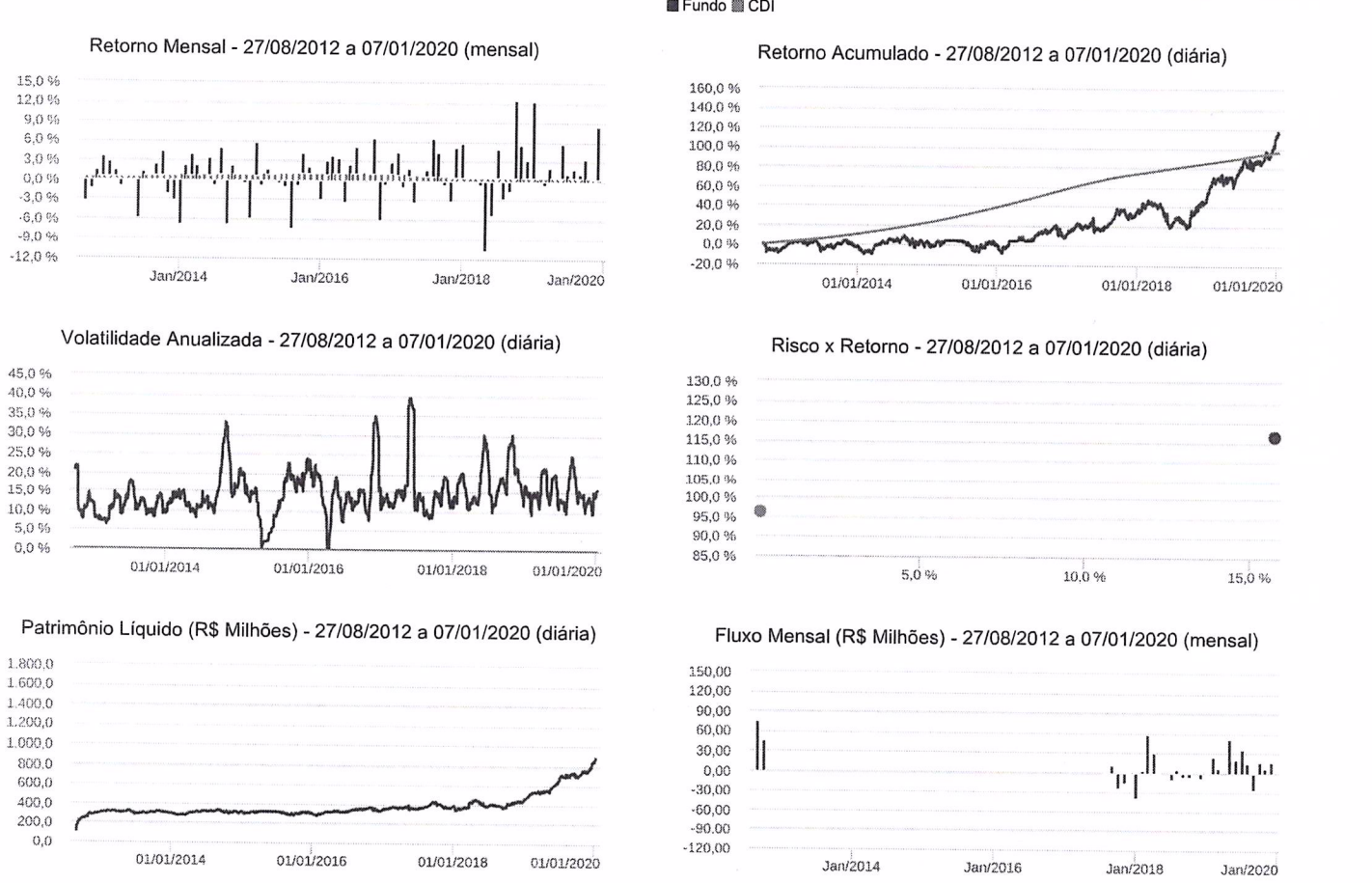


Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2027	24,34 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2023	11,74 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2021	9,14 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025	8,05 %
LTN - Venc.: 01/07/2021	7,01 %
LFT - Venc.: 01/09/2022	6,91 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2027	6,91 %
LTN - Venc.: 01/01/2022	6,37 %
LFT - Venc.: 01/03/2023	4,94 %
LTN - Venc.: 01/07/2023	4,59 %
LTN - Venc.: 01/07/2022	4,11 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2029	3,17 %
LTN - Venc.: 01/10/2021	1,60 %
LTN - Venc.: 01/04/2021	1,11 %
Outros Valores a receber	0,01 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF29	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	0,01 %
Lançamentos negativos maiores que -0,00%	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.

Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 15.154.441/0001-15		Aplicação Mínima: R\$ 100.000,00															
Gestão: Vinci Partners		Aplicação Adicional: R\$ 0,00															
Administrador: Caixa Econômica Federal		Saldo Mínimo: R\$ 0,00															
Taxa de Administração: 1,72%		Resgate Mínimo: R\$ 0,00															
Taxa de Administração (Máxima): 1,72%		Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du															
Classificação Anbima: Ações Dividendos		Conversão da Cota para Resgate: D+30 du															
Código de Referência: 311383		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+32 du															
Início do Fundo: 23/08/2012																	
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19
Fundo	116,50	1,71	40,44	57,69	91,57	8,52	0,53	3,46	1,05	1,86	1,04	5,82	0,10	2,14	-0,70	0,39	12,23
% do CDI	120,93	2.498,70	685,23	452,45	380,90	2.275,04	138,12	721,21	225,54	369,84	182,86	1.241,79	17,70	412,71	-148,88	79,08	2.252,45
CDI	96,34	0,07	5,90	12,75	24,04	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54
Ibovespa	99,68	0,88	26,76	48,34	93,70	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82
IBX	135,02	1,10	29,14	51,48	98,53	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71
IGP-M	51,91	0,10	7,43	15,42	14,93	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark						
Fundo	2,165018	885.595,66	647.398,32	15,69%	-8,00%	7,45%	-16,08	15,70%	8,52%	-0,70%	8						
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0						

Gráficos



Composição da Carteira nov/2019

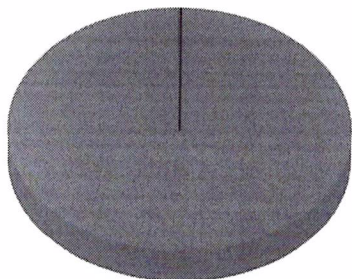
As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

:: CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES

07/01/2020

Performance dos Fundos em Carteira											Retorno (%) / % do Benchmark - CDI	
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início	
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade		
												PL Médio
CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	100,09	1,74	2.538,09	167,49	173,86	167,49	173,86	167,49	173,86	-		

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	
Cotas de Fundos	100,09%	100,09%	100,09%	100,09%	100,09%	100,06%	100,07%	100,07%	
Operações Compromissadas	0,04%	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	0,06%	0,07%	0,07%	
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Valores a pagar	-0,14%	-0,15%	-0,15%	-0,15%	-0,40%	-0,38%	-0,14%	-1,55%	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	761.709,54	749.627,40	707.345,83	725.340,57	696.683,77	654.515,20	599.177,34	547.850,81	
Data da Divulgação	04/12/2019	06/11/2019	07/10/2019	04/09/2019	08/08/2019	05/07/2019	10/06/2019	06/05/2019	
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									
	nov/2019								



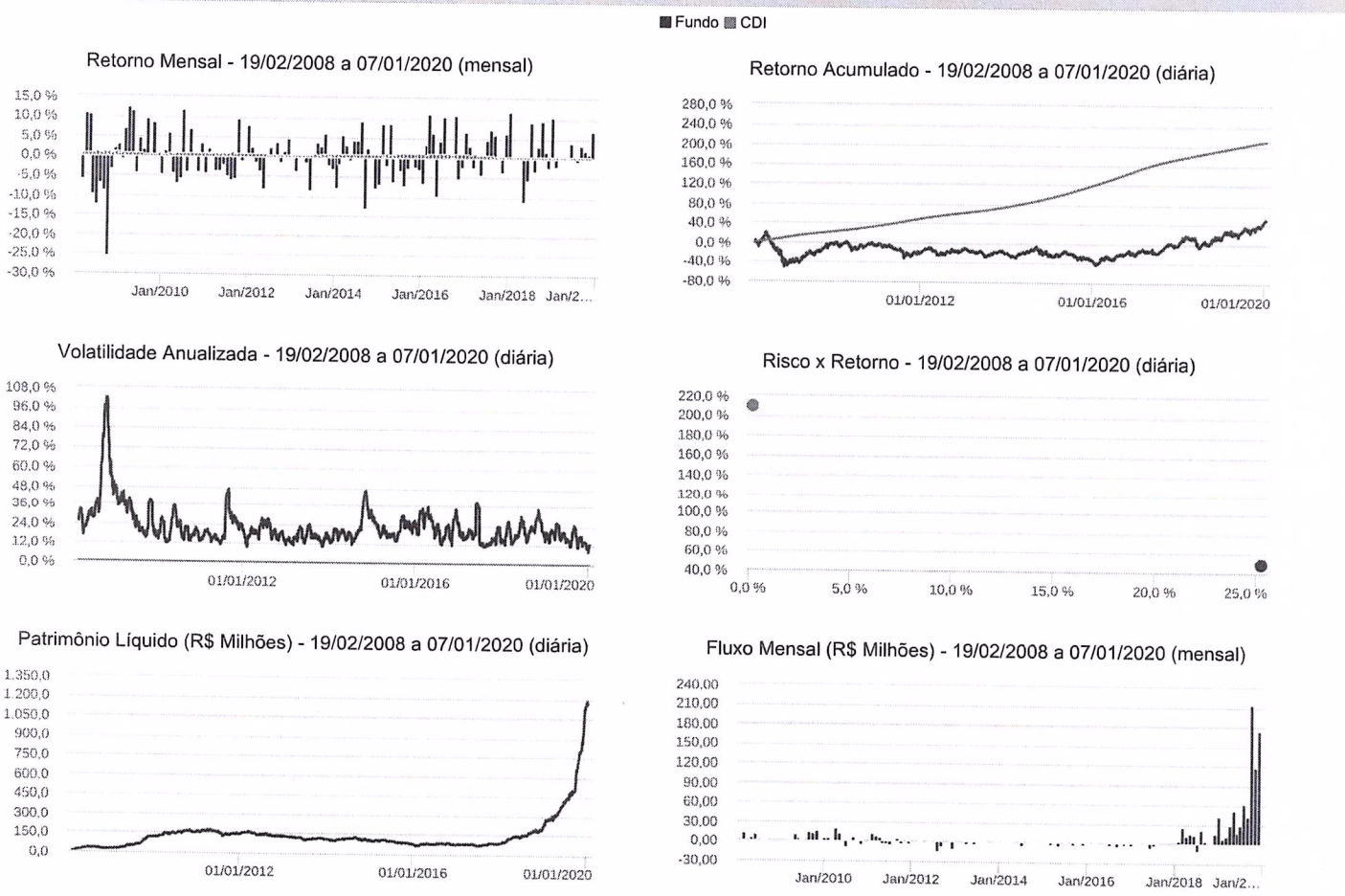
■ Cotas de CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	100,09 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,08 %
■ Outros Valores a pagar	-0,06 %
■ Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/10/2020	0,04 %
■ Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

Características		Informações Operacionais											
CNPJ: 03.737.217/0001-77		Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00											
Gestão: Caixa Econômica Federal		Aplicação Adicional: R\$ 0,00											
Administrador: Caixa Econômica Federal		Saldo Mínimo: R\$ 0,00											
Taxa de Administração: 0,70%		Resgate Mínimo: R\$ 0,00											
Taxa de Administração (Máxima): 0,70%		Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du											
Classificação Anbima: Ações Índice Ativo		Conversão da Cota para Resgate: D+1 du											
Código de Referência: 204226		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du											
Início do Fundo: 18/02/2008													

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19
Fundo	49,62	1,00	25,40	42,57	86,68	7,09	1,04	2,19	3,35	-0,71	0,65	4,15	0,55	0,25	-0,36	-2,05	10,63
% do CDI	23,61	1.459,19	430,36	333,85	360,57	1.891,25	273,44	457,20	722,52	-140,88	113,76	884,75	100,74	48,84	-77,69	-416,05	1.957,87
CDI	210,18	0,07	5,90	12,75	24,04	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54
Ibovespa	85,76	0,88	26,76	48,34	93,70	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82
IBX	135,86	1,10	29,14	51,48	98,53	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71
IGP-M	100,08	0,10	7,43	15,42	14,93	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,49623	1.169.824,65	509.256,97	17,72%	-10,66%	8,41%	-22,84	17,72%	7,09%	-2,05%	7
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0



Composição da Carteira nov/2019

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

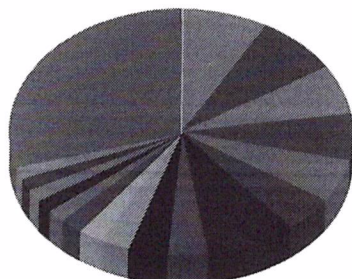
Performance dos Fundos em Carteira		Retorno (%) / % do Benchmark - CDI									
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6,30	0,07	97,00	481,05	99,57	481,05	99,57	481,05	99,57	-	
CAIXA MASTER AÇÕES LIVRE FI AÇÕES	1,09	0,40	590,51	18,15	792,84	18,15	792,84	18,15	792,84	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	
Ações	96,14%	96,62%	96,24%	96,16%	97,43%	97,61%	97,42%	97,32%	
Cotas de Fundos	7,39%	2,61%	6,77%	2,05%	1,64%	2,21%	1,38%	1,64%	
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	1,80%	1,83%	1,80%	1,78%	1,54%	1,62%	1,66%	1,70%	
Outras Aplicações	0,25%	0,25%	0,25%	0,25%	-	-	0,00%	-	
Valores a receber	0,19%	0,11%	0,26%	0,24%	0,21%	0,27%	0,26%	0,42%	
Opções - Posições titulares	0,02%	-	-	-	-	-	-	-	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Opções - Posições lançadas	-0,01%	-	-	-	-	-	-	-	
Valores a pagar	-4,06%	-1,43%	-9,83%	-0,49%	-0,82%	-1,46%	-0,67%	-0,99%	
Títulos Públicos	-	0,00%	5,52%	-	-	-	-	-	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	915.792,17	789.306,72	561.994,35	501.044,75	441.153,05	409.445,87	375.031,05	320.619,23	
Data da Divulgação	04/12/2019	06/11/2019	08/10/2019	03/09/2019	08/08/2019	05/07/2019	06/06/2019	08/05/2019	

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

nov/2019

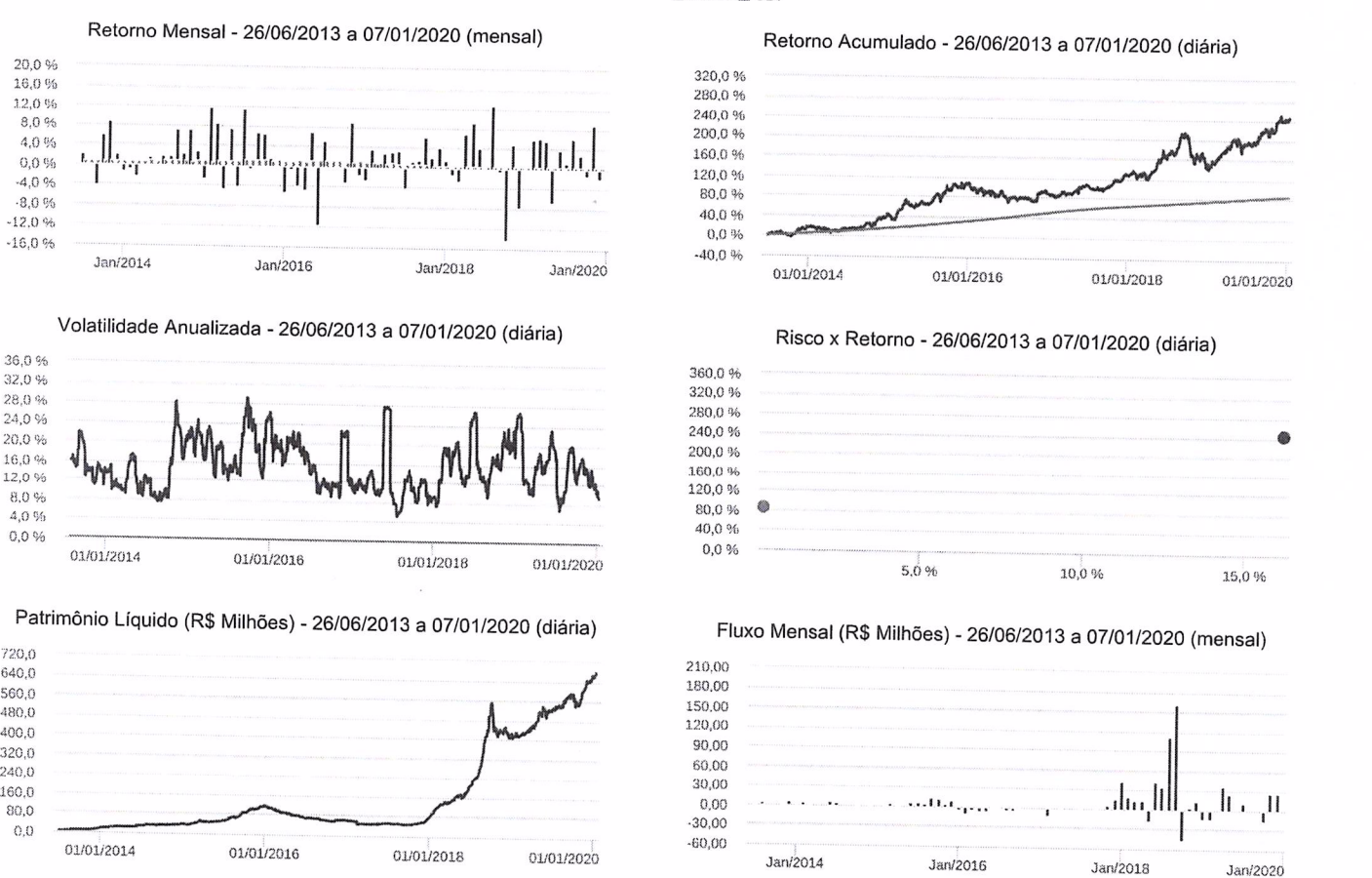


■ ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	8,86 %
■ VALE ON N1 - VALE3	8,46 %
■ PETROBRAS PN - PETR4	7,04 %
■ BRADESCO PN N1 - BBDC4	6,76 %
■ Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	6,30 %
■ B3 ON NM - B3SA3	5,35 %
■ PETROBRAS ON - PETR3	4,83 %
■ BRASIL ON NM - BBAS3	4,46 %
■ AMBEV S/A ON - ABEV3	4,12 %
■ Valores a pagar / Liquidação - Nota de Corretagem	-4,01 %
■ ITAUSA PN N1 - ITSA4	3,11 %
■ JBS ON NM - JBSS3	2,43 %
■ LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	2,37 %
■ BRADESCO ON N1 - BBDC3	1,86 %
■ BRF SA ON NM - BRFS3	1,83 %
■ MAGAZ LUIZA ON NM - MGLU3	1,83 %
■ IRBBRASIL RE ON NM - IRBR3	1,80 %
■ SUZANO PAPELON NM - SUZB3	1,75 %
■ Lançamentos positivos menores que 1,75%	32,60 %
■ Lançamentos negativos maiores que -4,01%	-0,06 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias.
Fonte: Quantum Axis.

Características		Informações Operacionais															
CNPJ: 17.502.937/0001-68		Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00															
Gestão: Caixa Econômica Federal		Aplicação Adicional: R\$ 500,00															
Administrador: Caixa Econômica Federal		Saldo Mínimo: R\$ 5.000,00															
Taxa de Administração: 0,70%		Resgate Mínimo: R\$ 500,00															
Taxa de Administração (Máxima): 0,70%		Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du															
Classificação Anbima: Ações Livre		Conversão da Cota para Resgate: D+1 du															
Código de Referência: 339075		Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du															
Início do Fundo: 24/06/2013																	
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	dez/19	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	mar/19	fev/19	jan/19
Fundo	244,47	1,57	39,11	51,45	84,79	-1,76	8,92	-1,37	2,66	6,02	1,30	3,87	-6,70	5,51	6,12	5,80	0,66
% do CDI	285,75	2.291,17	662,63	403,46	352,68	-469,57	2.345,22	-286,23	573,80	1.200,51	228,61	825,52	-1.234,15	1.063,07	1.304,82	1.174,77	121,64
CDI	85,56	0,07	5,90	12,75	24,04	0,37	0,38	0,48	0,46	0,50	0,57	0,47	0,54	0,52	0,47	0,49	0,54
Ibovespa	148,78	0,88	26,76	48,34	93,70	6,85	0,95	2,36	3,57	-0,67	0,84	4,06	0,70	0,98	-0,18	-1,86	10,82
IBX	159,11	1,10	29,14	51,48	98,53	7,27	0,97	2,20	3,21	-0,16	1,17	4,10	1,14	1,06	-0,11	-1,76	10,71
IGP-M	46,59	0,10	7,43	15,42	14,93	2,09	0,30	0,68	0,00	-0,67	0,40	0,80	0,45	0,92	1,26	0,88	0,01
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Veze Acima do Benchmark						
Fundo	3,444744	676.375,30	528.009,56	14,59%	-9,68%	6,93%	1,73	14,59%	8,92%	-6,70%	8						
CDI	-	-	-	0,04%	-	0,02%	1,00	0,00%	0,57%	0,37%	0						

Gráficos



Composição da Carteira nov/2019

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

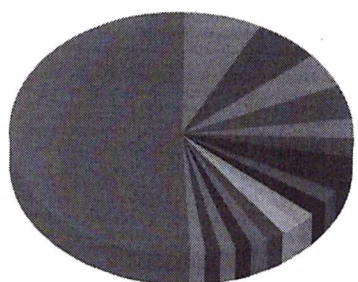
:: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I

07/01/2020

Performance dos Fundos em Carteira												Retorno (%) / % do Benchmark - CDI	
FUNDO	% do PL	Mês		Desde o início		Desde o início		Desde o início		Desde o início	Desde o início		
		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio		
CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4,51	0,07	97,00	481,05	99,57	481,05	99,57	481,05	99,57	-			

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)									
Tipo de Aplicação	nov/19	out/19	set/19	ago/19	jul/19	jun/19	mai/19	abr/19	
Brazilian Depository Receipt - BDR	95,98%	99,35%	99,15%	98,92%	99,50%	99,17%	99,13%	99,27%	
Cotas de Fundos	4,51%	3,00%	0,90%	1,20%	0,52%	1,44%	0,85%	6,95%	
Valores a receber	0,32%	0,08%	0,07%	0,13%	0,21%	0,06%	0,17%	0,08%	
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	
Valores a pagar	-0,12%	-2,36%	-0,11%	-0,28%	-0,18%	-0,70%	-0,23%	-6,19%	
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	642.628,50	566.207,01	589.391,27	573.901,77	541.420,31	523.608,34	504.348,18	513.379,70	
Data da Divulgação	05/12/2019	08/11/2019	07/10/2019	04/09/2019	13/08/2019	11/07/2019	10/06/2019	08/05/2019	

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)									
	nov/2019								



■ APPLE DRN - AAPL34	7,44 %
■ MICROSOFT DRN - MSFT34	6,17 %
■ AMAZON DRN - AMZO34	4,58 %
■ Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	4,51 %
■ FACEBOOK DRN - FBOK34	2,56 %
■ JPMORGAN DRN - JPMC34	2,48 %
■ ALPHABET DRN - GOGL35	2,41 %
■ VISA INC DRN - VISA34	2,27 %
■ JOHNSON DRN - JNJB34	1,97 %
■ WAL MART DRN - WALM34	1,92 %
■ BERKSHIRE DRN - BERK34	1,91 %
■ ALPHABET DRN - GOGL34	1,89 %
■ BANK AMERICA DRN - BOAC34	1,76 %
■ PG DRN - PGCO34	1,64 %
■ EXXON MOBIL DRN - EXXO34	1,56 %
■ ATT INC DRN - ATTB34	1,49 %
■ INTEL DRN - ITLC34	1,44 %
■ UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	1,43 %
■ Lançamentos positivos menores que 1,43%	51,41 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.