

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.540.368,04	0,80%	294	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.047.249,67	3,68%	899	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.377.063,42	2,80%	1.004	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	2.067.543,08	1,08%	188	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.717.126,39	0,90%	321	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.748.051,33	2,48%	1.348	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.861.242,17	2,01%	122	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	11.732.247,69	6,12%	977	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.446.973,35	4,41%	677	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.832.907,74	5,13%	926	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.216.291,59	4,81%	689	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	19.776.260,64	10,31%	892	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	7.194.354,74	3,75%	302	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.175.990,15	3,22%	196	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.677.334,05	1,40%	299	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.691.773,92	5,58%	103	1,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.894.760,72	4,64%	443	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	14.706.270,78	7,67%	120	1,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.246.389,32	0,65%	634	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	3.029.940,63	1,58%	77	1,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)**

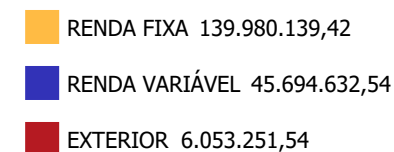
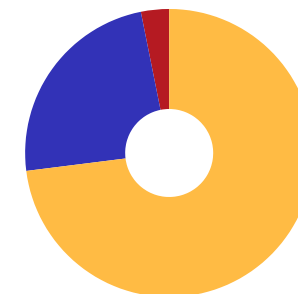
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	3.012.338,21	1,57%	20.464	0,49%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.556.635,64	0,81%	39	0,24%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.329.769,98	0,69%	2.222	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.026.633,29	1,58%	6.805	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	8.029.812,27	4,19%	179	2,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.415.909,33	3,87%	1.385	2,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	4.612.099,63	2,41%	160	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.326.775,54	0,69%	68	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.165.040,16	1,65%	5.938	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	Não inf...	Não há	1.227.396,22	0,64%	32.279	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.603.707,66	0,84%	18.477	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.539.561,52	0,80%	70	2,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.558.359,27	1,33%	98	0,26%	Artigo 8º, Inciso III
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTI...	D+31	Não há	520.796,17	0,27%	1.604	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.854.722,20	0,97%	7.730	0,25%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	2.110.049,00	1,10%	3.658	1,19%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	805.026,45	0,42%		0,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	2.157.696,19	1,13%	203	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso III
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.895.555,35	2,03%	20.762	0,64%	Artigo 9º - A, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>191.728.023,50</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>21.839,10</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>191.749.862,60</b>				

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2021)**

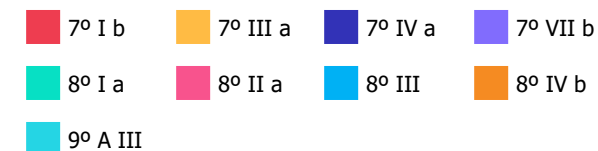
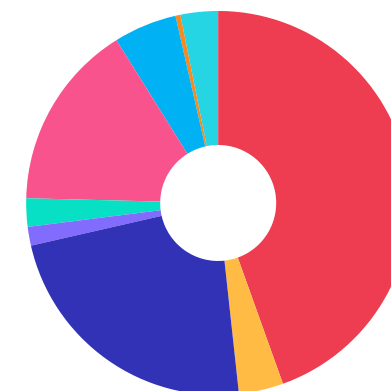
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	85.363.325,11	44,52%	15,00%	49,00%	90,00%	87.191.896,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	7.194.354,74	3,75%	1,50%	4,00%	60,00%	107.842.459,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	44.392.518,94	23,15%	5,00%	15,00%	40,00%	32.298.690,46
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	28.759.203,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.586.401,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	3.029.940,63	1,58%	0,00%	2,00%	5,00%	6.556.460,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.586.401,18
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>139.980.139,42</b>	<b>73,01%</b>	<b>21,50%</b>	<b>70,00%</b>	<b>220,00%</b>	



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	4.568.973,85	2,38%	1,50%	2,50%	10,00%	14.603.828,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	30.133.436,42	15,72%	10,00%	16,50%	20,00%	8.212.168,28
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.187.195,82	5,31%	4,00%	5,50%	10,00%	8.985.606,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.586.401,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	805.026,45	0,42%	0,00%	1,00%	5,00%	8.781.374,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.586.401,18
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>45.694.632,54</b>	<b>23,83%</b>	<b>15,50%</b>	<b>25,50%</b>	<b>55,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	5,00%	9.586.401,18
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	6.053.251,54	3,16%	2,00%	3,00%	5,00%	3.533.149,64
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>6.053.251,54</b>	<b>3,16%</b>	<b>2,00%</b>	<b>4,50%</b>	<b>10,00%</b>	



**Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Janeiro / 2021)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	84.739.052,66	44,20	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.696.188,29	23,31	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	20.078.641,89	10,47	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	10.428.247,54	5,44	0,02
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	10.037.232,32	5,24	0,00
META ASSET MANAGEMENT	8.029.812,27	4,19	2,43
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.275.089,16	2,75	0,02
VINCI PARTNERS	4.612.099,63	2,41	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.026.633,29	1,58	0,17
ZION INVEST	805.026,45	0,42	0,10

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	85.363.325,11	44,52	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.194.354,74	3,75	1,50	6,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	44.392.518,94	23,15	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	3.029.940,63	1,58	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	4.568.973,85	2,38	1,50	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30.133.436,42	15,72	10,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	10.187.195,82	5,31	4,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	805.026,45	0,42	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	6.053.251,54	3,16	2,00	5,00

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	-0,87%	-0,87%	1,55%	0,00%	6,54%	18,79%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,85%	-0,85%	1,58%	-0,12%	6,32%	18,27%	0,02%	0,03%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,18%	3,07%	4,24%	7,69%	18,77%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,13%	3,03%	4,04%	7,68%	18,78%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-1,69%	-1,69%	8,43%	2,01%	3,68%	26,83%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,70%	-1,70%	8,29%	1,74%	3,23%	26,02%	0,04%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,70%	-1,70%	8,45%	1,96%	3,49%	25,99%	0,04%	0,17%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,53%	0,90%	3,22%	9,83%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	3,22%	3,64%	7,25%	19,86%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	0,01%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,86%	-0,86%	6,00%	2,62%	4,95%	23,66%	0,03%	0,11%



**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,88%	-0,88%	5,95%	2,59%	4,88%	23,40%	0,03%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,87%	-0,87%	5,99%	2,66%	4,88%	23,46%	0,03%	0,11%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,88%	-0,88%	5,96%	2,62%	4,67%	23,27%	0,03%	0,11%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16%	0,16%	0,68%	0,95%	2,20%	7,87%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	0,25%	0,52%	1,68%	6,66%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00%	0,00%	3,01%	2,00%	6,72%	22,98%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,01%	0,02%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,78%	0,20%	2,38%	14,58%	0,00%	0,01%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,58%	-0,58%	2,68%	0,52%	3,61%	14,74%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,47%	-0,47%	3,25%	1,20%	-	-	0,02%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	1,77%	0,70%	-	-	0,01%	-

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-1,11%	-1,11%	13,59%	13,55%	15,15%	37,36%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,05%	-0,05%	14,08%	12,91%	10,76%	36,09%	0,08%	0,27%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-5,08%	-5,08%	18,30%	8,08%	-4,52%	21,27%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,76%	-3,76%	20,27%	10,03%	-2,32%	25,54%	0,10%	0,38%
<b>IBX (Benchmark)</b>	-3,03%	-3,03%	22,21%	12,06%	1,64%	20,92%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-6,13%	-6,13%	13,37%	2,79%	-4,50%	21,23%	0,13%	0,52%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-3,46%	-3,46%	17,66%	7,48%	-8,05%	9,89%	0,12%	0,44%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,95%	-3,95%	15,85%	1,99%	-11,45%	21,54%	0,10%	0,41%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-3,25%	-3,25%	20,20%	9,42%	0,04%	22,84%	0,11%	0,41%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,59%	-5,59%	22,28%	14,81%	1,52%	22,76%	0,12%	0,40%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	-3,03%	-3,03%	17,56%	8,35%	-8,33%	10,98%	0,12%	0,44%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-3,43%	-3,43%	21,10%	10,52%	-4,50%	38,71%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,91%	-1,91%	17,05%	4,39%	-10,96%	33,55%	0,14%	0,48%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-

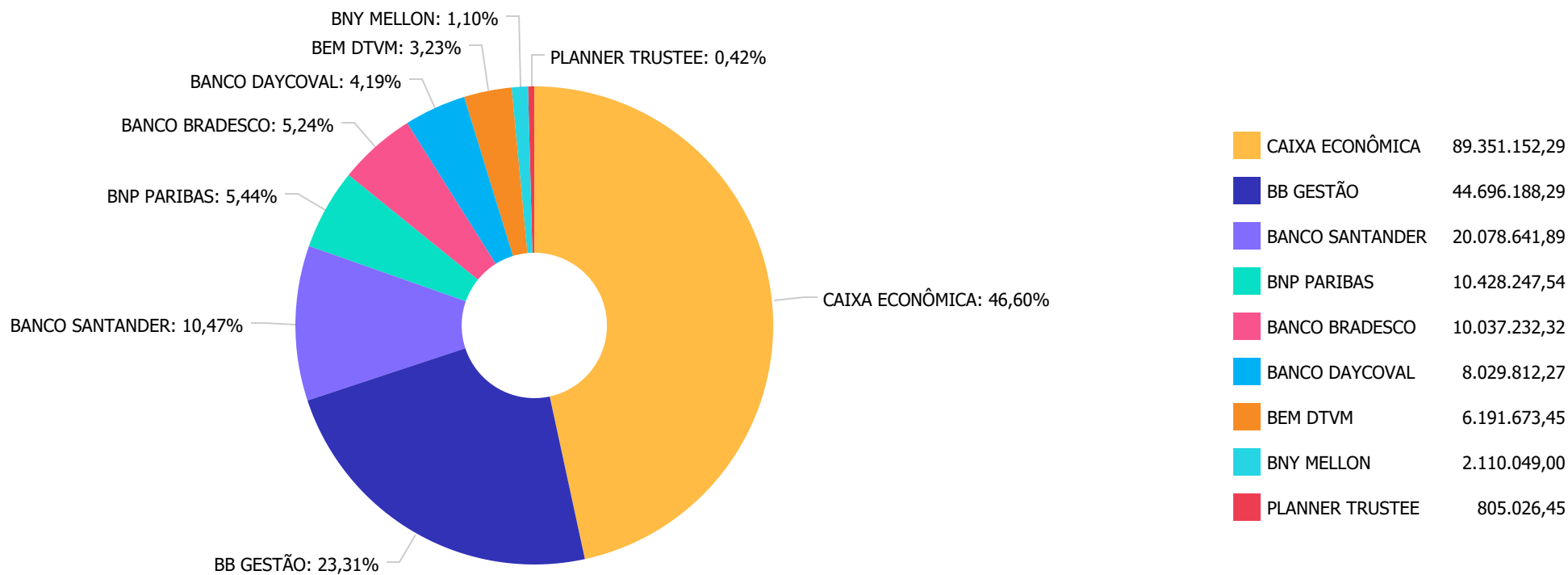
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,09%	-0,09%	4,50%	3,05%	2,72%	17,79%	0,02%	0,08%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	-0,04%	-0,04%	0,09%	-1,72%	-3,38%	3,63%	0,01%	0,02%
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,63%	-0,63%	2,12%	0,83%	0,31%	4,52%	0,02%	0,03%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,49%	2,85%	2,20%	-	-	0,01%	-
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,43%	-1,43%	-12,66%	-27,37%	-40,00%	-60,57%	0,07%	0,51%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-3,56%	-3,56%	14,87%	8,21%	-2,16%	-	0,10%	0,40%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,23%	0,23%	4,92%	2,44%	3,04%	-	0,02%	0,11%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,32%	-2,32%	22,30%	11,79%	-6,79%	36,41%	0,12%	0,52%

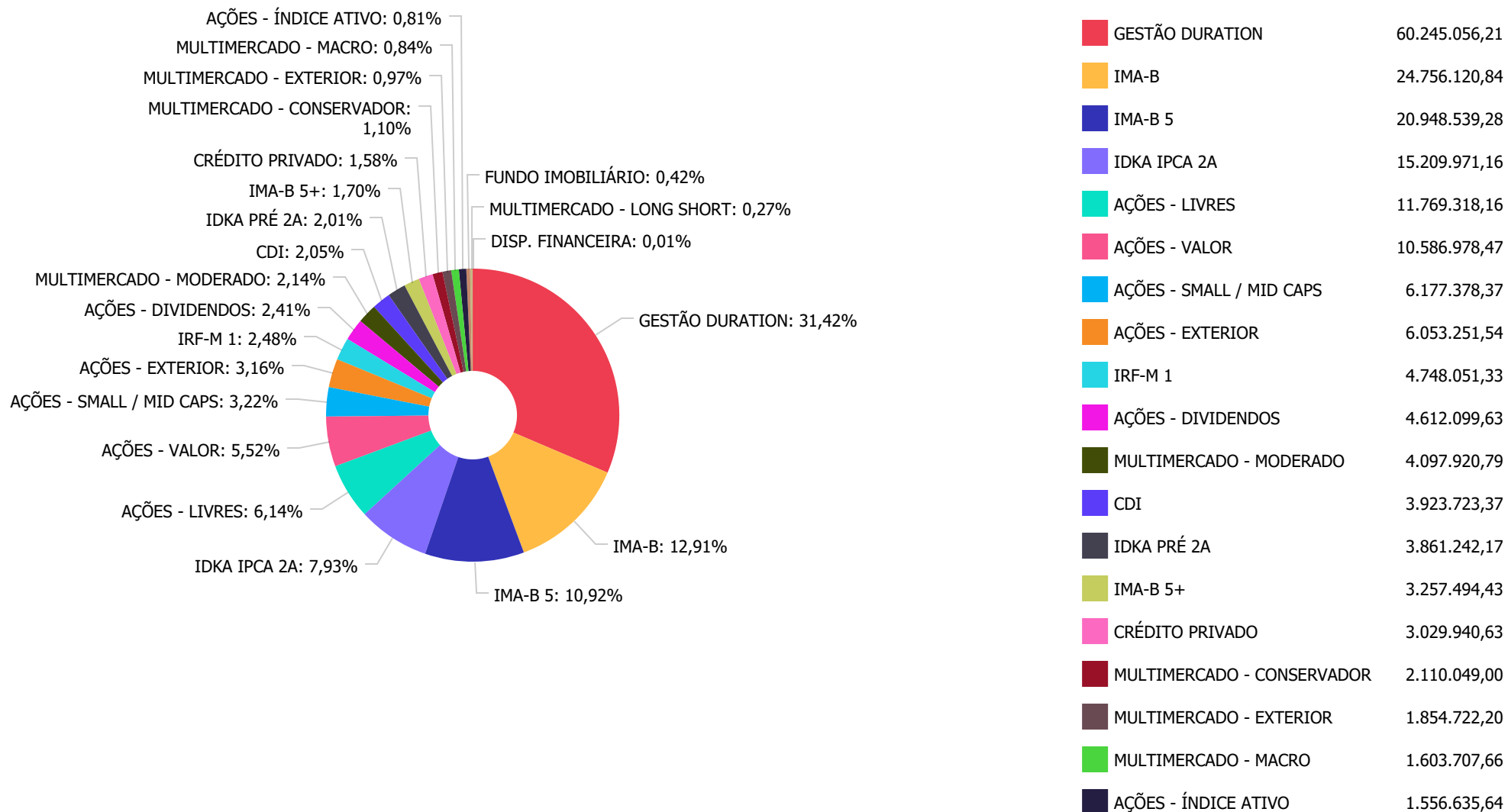
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	6,11%	6,11%	9,83%	21,25%	53,50%	120,12%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	5,79%	5,79%	9,11%	20,97%	53,70%	118,69%	0,12%	0,22%
<b>IBX (Benchmark)</b>	-3,03%	-3,03%	22,21%	12,06%	1,64%	20,92%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5,00%	5,00%	7,75%	18,26%	50,02%	97,61%	0,13%	0,22%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2021)



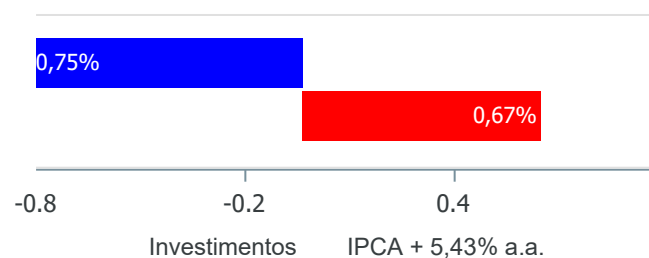
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)**



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

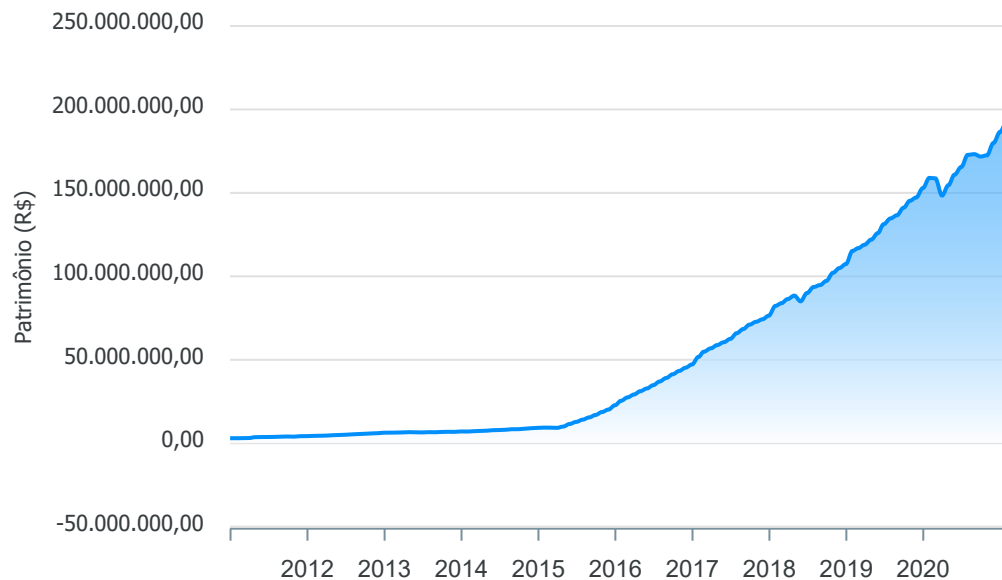
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	186.459.080,35	17.523.935,63	10.809.983,83	191.728.023,50	-1.445.008,65	-1.445.008,65	-0,75%	-0,75%	0,67%	0,67%	-111,38%	3,61%

Investimentos x Meta Atuarial

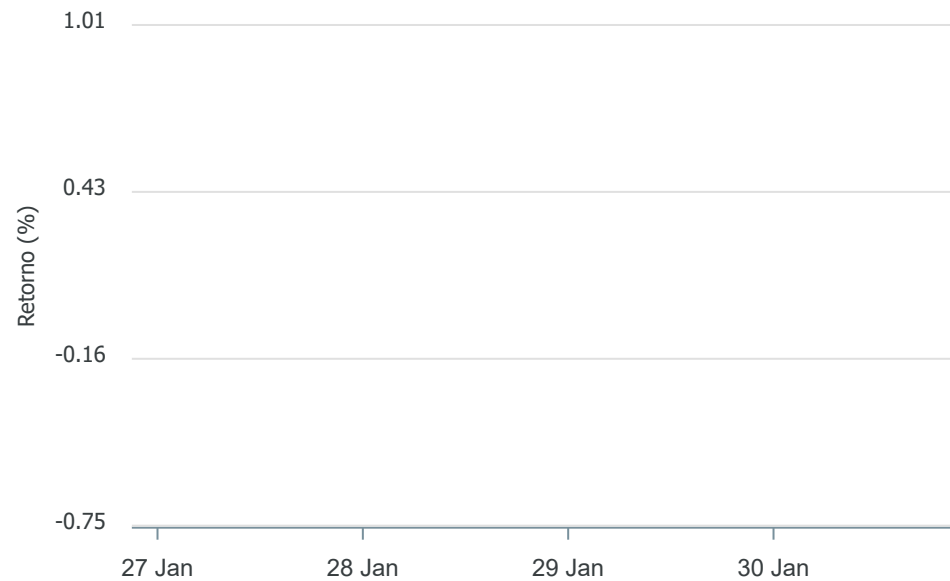


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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



**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021**

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.815.535,15	0,00	0,00	9.832.907,74	17.372,59	0,18%	0,18%	0,95%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.244.377,70	0,00	0,00	1.246.389,32	2.011,62	0,16%	0,16%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.369.888,38	0,00	0,00	5.377.063,42	7.175,04	0,13%	0,13%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.207.410,83	0,00	0,00	9.216.291,59	8.880,76	0,10%	0,10%	1,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	8.683.703,97	2.000.000,00	0,00	10.691.773,92	8.069,95	0,08%	0,08%	0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.723.484,86	2.000.000,00	0,00	11.732.247,69	8.762,83	0,07%	0,08%	1,04%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	11.200.569,52	3.500.000,02	0,00	14.706.270,78	5.701,24	0,04%	0,03%	0,24%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	3.767.553,60	5.216.759,71	6.309.983,81	2.677.334,05	3.004,55	0,03%	0,08%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.771.145,36	2.000.000,00	0,00	19.776.260,64	5.115,28	0,03%	0,03%	0,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.746.854,17	0,00	0,00	4.748.051,33	1.197,16	0,03%	0,03%	0,15%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	3.030.008,51	0,00	0,00	3.029.940,63	-67,88	0,00%	0,00%	1,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.112.535,96	2.807.175,90	0,00	8.894.760,72	-24.951,14	-0,28%	-0,47%	1,56%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.211.974,52	0,00	0,00	6.175.990,15	-35.984,37	-0,58%	-0,58%	1,40%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.894.129,84	0,00	0,00	3.861.242,17	-32.887,67	-0,84%	-0,84%	1,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.520.570,06	0,00	0,00	8.446.973,35	-73.596,71	-0,86%	-0,86%	2,59%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.109.277,02	0,00	0,00	7.047.249,67	-62.027,35	-0,87%	-0,87%	2,57%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	2.085.911,41	0,00	0,00	2.067.543,08	-18.368,33	-0,88%	-0,88%	2,58%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	7.258.367,96	0,00	0,00	7.194.354,74	-64.013,22	-0,88%	-0,88%	2,57%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.566.943,93	0,00	0,00	1.540.368,04	-26.575,89	-1,70%	-1,70%	4,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.746.760,63	0,00	0,00	1.717.126,39	-29.634,24	-1,70%	-1,70%	4,11%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	129.067.003,38	17.523.935,63	6.309.983,81	139.980.139,42	-300.815,78	-0,21%		1,24%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.532.070,67	0,00	0,00	1.539.561,52	7.490,85	0,49%	0,49%	0,86%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.552.387,08	0,00	0,00	2.558.359,27	5.972,19	0,23%	0,23%	2,43%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.110.913,67	0,00	0,00	2.110.049,00	-864,67	-0,04%	-0,04%	0,85%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.855.707,01	0,00	0,00	1.854.722,20	-984,81	-0,05%	-0,05%	8,06%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.605.125,32	0,00	0,00	1.603.707,66	-1.417,66	-0,09%	-0,09%	1,73%
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIME...	2.033.200,31	0,00	1.500.000,00	520.796,17	-12.404,14	-0,61%	-0,63%	2,13%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO FIC AÇÕES	3.273.443,63	0,00	2.000.000,02	1.227.396,22	-46.047,39	-1,41%	-3,03%	11,67%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	816.693,50	0,00	0,00	805.026,45	-11.667,05	-1,43%	-1,43%	7,37%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.226.787,26	0,00	0,00	3.165.040,16	-61.747,10	-1,91%	-1,91%	14,28%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	3.084.011,84	0,00	0,00	3.012.338,21	-71.673,63	-2,32%	-2,32%	12,19%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.401.660,28	0,00	1.000.000,00	1.329.769,98	-71.890,30	-2,99%	-5,59%	12,13%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.664.728,89	0,00	0,00	7.415.909,33	-248.819,56	-3,25%	-3,25%	11,36%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.612.345,07	0,00	0,00	1.556.635,64	-55.709,43	-3,46%	-3,46%	11,79%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.375.796,39	0,00	0,00	1.326.775,54	-49.020,85	-3,56%	-3,56%	9,94%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.792.420,98	0,00	0,00	4.612.099,63	-180.321,35	-3,76%	-3,76%	10,41%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.151.025,04	0,00	0,00	3.026.633,29	-124.391,75	-3,95%	-3,95%	9,65%
META VALOR FI AÇÕES	8.554.179,31	0,00	0,00	8.029.812,27	-524.367,04	-6,13%	-6,13%	12,63%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>51.642.496,25</b>	<b>0,00</b>	<b>4.500.000,02</b>	<b>45.694.632,54</b>	<b>-1.447.863,69</b>	<b>-2,80%</b>		<b>9,65%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPECERICA DA SERRA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

## Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2021)

## FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2.039.660,02	0,00	0,00	2.157.696,19	118.036,17	5,79%	5,79%	12,35%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.709.920,70	0,00	0,00	3.895.555,35	185.634,65	5,00%	5,00%	12,88%
<b>Total Exterior</b>	<b>5.749.580,72</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6.053.251,54</b>	<b>303.670,82</b>	<b>5,28%</b>		<b>12,69%</b>