

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021



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

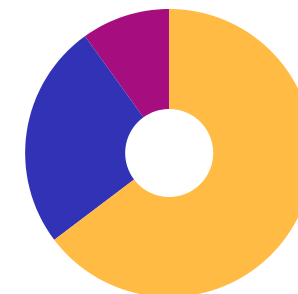
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	74.968.293,37	9,96%	903	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.331.223,50	0,31%	1.211	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	45.659,80	0,01%	1.341	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	14.015.130,52	1,86%	933	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	27.638.559,64	3,67%	11.427	2,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	5.235.313,37	0,70%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	106.783.375,79	14,18%	677	1,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	42.398.269,97	5,63%	321	2,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	106.519.356,96	14,15%	120	5,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.287.540,39	3,09%	44	10,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	D+1	Não há	25.231.419,03	3,35%	6.192	5,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	26.796.342,26	3,56%	17.568	5,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	21.885.938,56	2,91%	315	4,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	202.104,41	0,03%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.810.946,33	1,30%	74	1,58%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	7.200.418,71	0,96%	41	1,20%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	16.100.342,04	2,14%	97	1,47%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.288.759,03	0,57%	20.391	1,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	23.237.368,19	3,09%	13.555	3,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	28.267.723,02	3,75%	19.147	4,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	28.569.236,41	3,79%	8.091	1,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	15.694.481,10	2,08%	14.145	1,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	19.942.865,22	2,65%	9.885	2,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	22.547.355,99	2,99%	44.822	1,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	23.028.544,28	3,06%	27.594	1,77%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	7.846,77	0,00%	106	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	86.515,46	0,01%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	851.173,58	0,11%		1,66%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.081.415,68	0,14%		2,86%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	7.127.433,19	0,95%	35	5,47%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	22.215.615,59	2,95%	8.896	1,64%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	20.187.235,49	2,68%	19.795	1,18%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	25.374.457,41	3,37%	118.461	0,92%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>752.958.261,07</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	273.415.825,96	36,31%	5,00%	40,58%	100,00%	479.542.435,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	752.958.261,07
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	37.647.913,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	451.774.956,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	451.774.956,64
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	203.720.597,20	27,06%	0,00%	23,00%	40,00%	97.462.707,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	301.183.304,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	150.591.652,21
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	112.943.739,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	202.104,42	0,03%	0,00%	0,03%	5,00%	37.445.808,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	9.810.946,33	1,30%	0,00%	1,39%	5,00%	27.836.966,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	37.647.913,05
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>487.149.473,91</b>	<b>64,70%</b>	<b>5,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>455,00%</b>	



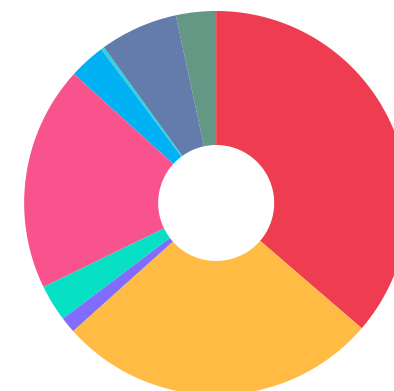
RENDA FIXA 487.149.473,91  
RENDA VARIÁVEL 190.904.045,48  
EXTERIOR 74.904.741,68

**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

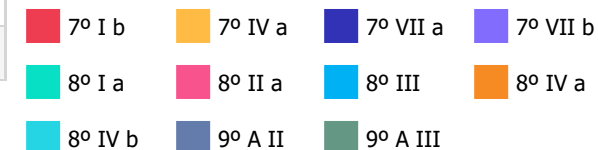


**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2021)**

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	23.300.760,75	3,09%	0,00%	3,00%	30,00%	202.586.717,57
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	225.887.478,32
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	142.547.788,96	18,93%	2,00%	18,68%	20,00%	8.043.863,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	150.591.652,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	23.028.544,28	3,06%	0,00%	3,00%	10,00%	52.267.281,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	94.362,23	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	37.553.550,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.932.589,26	0,26%	0,00%	0,31%	5,00%	35.715.323,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	37.647.913,05
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>190.904.045,48</b>	<b>25,35%</b>	<b>2,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>125,00%</b>	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	75.295.826,11
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	49.530.284,27	6,58%	0,00%	6,00%	10,00%	25.765.541,84
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	25.374.457,41	3,37%	0,00%	4,00%	10,00%	49.921.368,70
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>74.904.741,68</b>	<b>9,95%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	193.279.827,55	25,67	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	172.444.414,47	22,90	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	129.806.897,35	17,24	-
WESTERN ASSET	123.158.918,92	16,36	-
ICATU VANGUARDA	55.365.578,67	7,35	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	29.416.034,30	3,91	-
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	20.187.235,49	2,68	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	19.942.865,22	2,65	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	7.127.433,19	0,95	-
REDITUS INVESTIMENTOS	1.081.415,68	0,14	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	851.173,58	0,11	-
VILA RICA CAPITAL	202.104,41	0,03	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	86.515,47	0,01	-
PÁTRIA INVESTIMENTOS	7.846,77	0,00	-

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

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

**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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,38%	0,81%	1,28%	2,61%	5,90%	15,70%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,49%	-2,42%	-2,23%	30,37%	998,35%	1.460,16%	-	-
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-0,48%	-0,33%	1,40%	2,72%	6,95%	18,92%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,37%	1,15%	2,96%	6,43%	17,41%	1,09%	0,03%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	-2,01%	-3,37%	-0,43%	-1,48%	2,82%	17,44%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-2,80%	-4,71%	-0,24%	-2,16%	1,78%	18,78%	2,48%	0,08%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-2,33%	-3,98%	3,24%	3,38%	0,95%	23,20%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,35%	-4,01%	3,25%	3,33%	0,76%	22,39%	3,66%	0,17%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-2,21%	-3,84%	3,32%	3,38%	0,24%	21,86%	3,69%	0,18%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,04%	0,08%	0,39%	0,94%	3,08%	9,80%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02%	0,04%	0,33%	0,82%	2,87%	9,36%	0,10%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,04%	0,35%	0,70%	2,71%	9,12%	0,10%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,60%	-0,49%	1,33%	2,75%	6,23%	19,15%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-1,51%	-2,16%	1,01%	1,35%	5,76%	21,87%	1,92%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>110% do CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,31%	0,49%	1,01%	2,60%	8,91%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	-
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-1,52%	-2,36%	2,38%	3,07%	3,16%	21,74%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,53%	-2,38%	2,34%	2,96%	2,89%	21,16%	2,31%	0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,67%	-0,59%	1,22%	2,51%	5,65%	18,87%	1,20%	0,04%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,72%	-2,73%	2,08%	2,57%	2,65%	20,97%	2,88%	0,11%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	-2,46%	-4,15%	2,06%	1,71%	2,68%	24,20%	3,16%	0,13%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,86%	1,11%	2,48%	4,95%	5,20%	9,41%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-1,07%	-0,98%	0,89%	2,60%	5,69%	17,51%	1,54%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,51%	-0,48%	0,83%	1,04%	4,64%	19,53%	0,95%	0,03%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	-1,86%	-3,33%	0,05%	-1,59%	3,06%	15,84%	1,92%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,58%	2,65%	4,94%	10,14%	16,10%	33,38%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,33%	-0,79%	-3,18%	-4,45%	-	-97,02%	-	0,83%
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	2,61%	1,47%	5,23%	8,88%	29,01%	36,87%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,67%	2,50%	5,77%	8,77%	23,86%	36,61%	6,70%	0,25%
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	-3,80%	-6,48%	2,33%	12,81%	8,13%	15,27%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-3,54%	-6,30%	2,19%	11,39%	5,86%	13,61%	13,10%	0,42%
<b>IMOB (Benchmark)</b>	-10,11%	-16,42%	-12,61%	-8,70%	-31,84%	3,70%	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-10,16%	-16,52%	-12,81%	-9,22%	-32,58%	1,76%	12,47%	0,54%
<b>ICON (Benchmark)</b>	-5,29%	-6,50%	-1,83%	-0,23%	1,03%	36,15%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-5,36%	-6,66%	-2,10%	-1,00%	-0,20%	34,71%	9,61%	0,42%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-5,21%	-10,02%	-1,98%	7,65%	-3,53%	17,34%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,81%	-7,57%	-0,21%	5,04%	-10,56%	8,41%	8,10%	0,38%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,76%	-8,05%	-1,21%	5,43%	-3,79%	6,65%	13,00%	0,43%

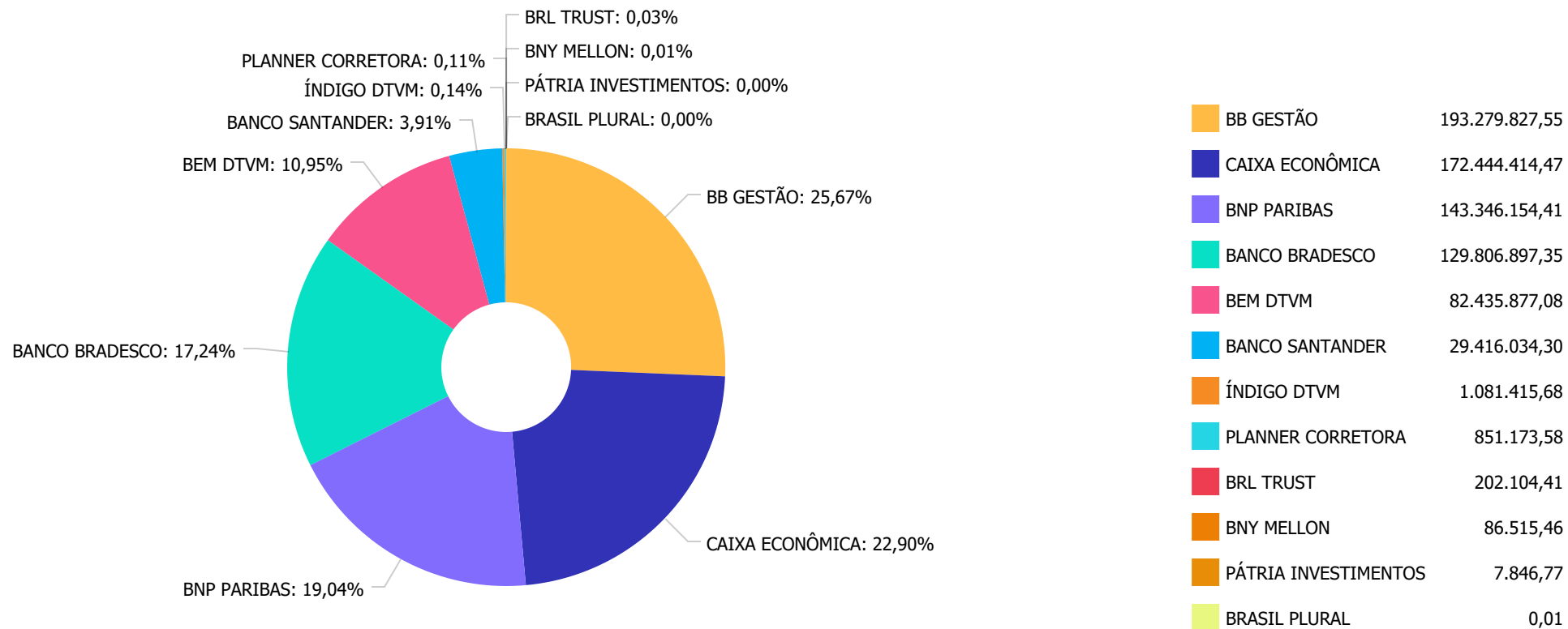
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,40%	-4,98%	2,32%	4,10%	-4,06%	12,03%	11,82%	0,45%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-1,84%	-5,21%	1,92%	9,84%	2,20%	38,68%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-1,99%	-5,40%	1,79%	8,15%	-0,35%	31,96%	10,85%	0,47%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-0,90%	-11,33%	-12,00%	-17,32%	-	-99,78%	1,09%	0,98%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1,61%	0,00%	1,91%	3,79%	-12,73%	83,15%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-1,35%	-4,48%	3,14%	8,77%	-0,99%	26,47%	11,75%	0,38%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,12%	-1,42%	-19,90%	-3,88%	6,50%	-7,36%	37,88%	0,53%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,85%	-9,57%	-0,15%	10,15%	9,93%	34,73%	13,04%	0,46%

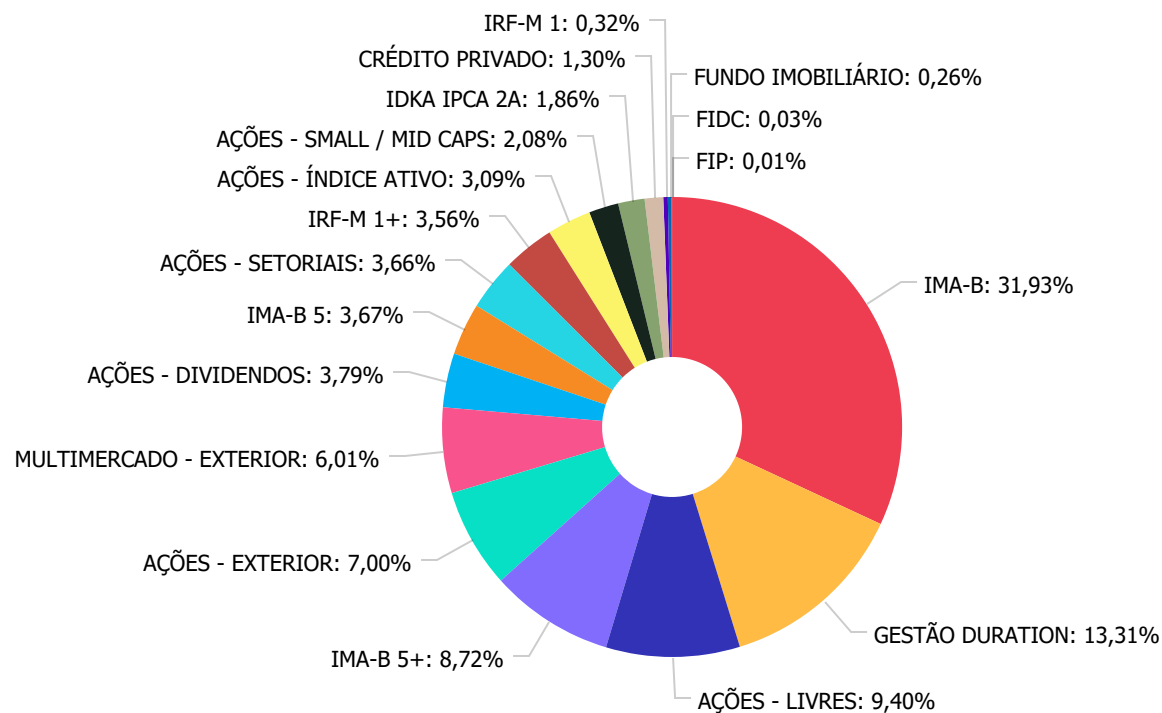
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	3,93%	10,28%	11,31%	9,94%	69,17%	115,88%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,03%	4,99%	4,75%	3,98%	65,57%	121,93%	6,37%	0,23%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	4,42%	8,91%	9,10%	15,21%	97,35%	-	11,13%	0,19%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,60%	10,50%	11,02%	15,78%	72,33%	111,26%	5,18%	0,18%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5,34%	11,94%	12,20%	19,88%	-	-	6,31%	-

**Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2021)**



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

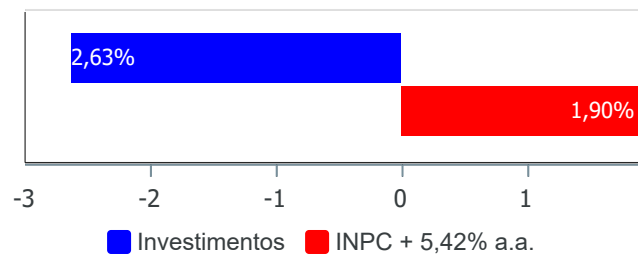


IMA-B	240.423.984,68
GESTÃO DURATION	100.199.712,40
AÇÕES - LIVRES	70.757.944,23
IMA-B 5+	65.685.810,36
AÇÕES - EXTERIOR	52.689.126,09
MULTIMERCADO - EXTERIOR	45.244.159,87
AÇÕES - DIVIDENDOS	28.569.236,41
IMA-B 5	27.638.559,64
AÇÕES - SETORIAIS	27.526.127,22
IRF-M 1+	26.796.342,26
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	23.300.760,75
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	15.694.481,10
IDKA IPCA 2A	14.015.130,52
CRÉDITO PRIVADO	9.810.946,33
IRF-M 1	2.376.883,30
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.932.589,26
FIDC	202.104,42
FIP	94.362,23

**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	772.758.420,48	8.926.995,34	8.588.634,39	764.781.240,64	-8.315.540,79	-8.315.540,79	-1,08%	-1,08%	0,69%	0,69%	-155,68%	5,55%
Fevereiro	764.781.240,64	23.080.818,18	22.847.241,26	752.958.261,07	-12.056.556,49	-20.372.097,28	-1,58%	-2,63%	1,20%	1,90%	-138,66%	4,97%

Investimentos x Meta Atuarial



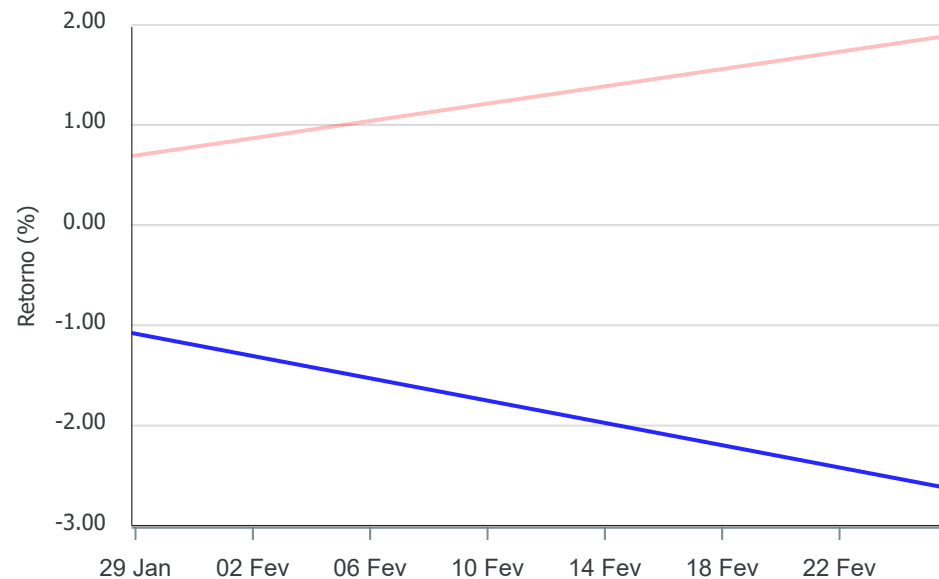
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.039.631,04	0,00	5.996.551,70	45.659,80	2.580,46	0,04%	0,02%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.134.603,82	440.335,45	243.834,87	2.331.223,50	119,10	0,00%	0,00%	0,10%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	77.821.666,28	0,00	2.464.962,28	74.968.293,37	-388.410,63	-0,50%	-0,51%	0,95%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	207.256,12	0,00	4.091,38	202.104,41	-1.060,33	-0,51%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.092.390,47	0,00	0,00	14.015.130,52	-77.259,95	-0,55%	-0,55%	1,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.408.056,60	0,00	137.801,03	5.235.313,37	-34.942,20	-0,65%	-0,67%	1,20%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.917.315,86	0,00	0,00	9.810.946,33	-106.369,53	-1,07%	-1,07%	1,54%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	28.025.579,39	36.727,30	0,00	27.638.559,64	-423.747,05	-1,51%	-1,51%	1,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	108.445.683,58	0,00	0,00	106.783.375,79	-1.662.307,79	-1,53%	-1,53%	2,31%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	108.388.060,23	0,00	0,00	106.519.356,96	-1.868.703,27	-1,72%	-1,72%	2,88%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	25.709.196,57	0,00	0,00	25.231.419,03	-477.777,54	-1,86%	-1,86%	1,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	57.604.334,44	0,00	14.000.000,00	42.398.269,97	-1.206.064,47	-2,09%	-2,35%	3,66%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	23.813.408,07	0,00	0,00	23.287.540,39	-525.867,68	-2,21%	-2,21%	3,69%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	22.438.944,62	0,00	0,00	21.885.938,56	-553.006,06	-2,46%	-2,46%	3,16%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	27.566.759,53	0,00	0,00	26.796.342,26	-770.417,27	-2,79%	-2,79%	2,48%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>517.612.886,63</b>	<b>477.062,75</b>	<b>22.847.241,26</b>	<b>487.149.473,91</b>	<b>-8.093.234,21</b>	<b>-1,56%</b>		<b>2,34%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	22.430.324,36	0,00	0,00	23.028.544,28	598.219,92	2,67%	2,67%	6,70%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.083.988,45	0,00	0,00	1.081.415,68	-2.572,77	-0,24%	0,11%	37,88%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	86.802,72	0,00	0,00	86.515,46	-287,26	-0,33%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	854.249,19	0,00	0,00	851.173,58	-3.075,61	-0,36%	1,60%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	7.917,83	0,00	0,00	7.846,77	-71,06	-0,90%	-0,90%	1,09%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	16.013.869,06	0,00	0,00	15.694.481,10	-319.387,96	-1,99%	-1,99%	10,85%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	16.004.701,23	7.137.801,03	0,00	22.547.355,99	-595.146,27	-2,57%	-1,35%	11,75%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	16.690.497,26	0,00	0,00	16.100.342,04	-590.155,22	-3,54%	-3,54%	13,10%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.493.395,41	7.187.050,09	0,00	19.942.865,22	-737.580,28	-3,57%	-2,40%	11,82%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	29.699.373,24	0,00	0,00	28.569.236,41	-1.130.136,83	-3,81%	-3,81%	8,10%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	29.707.279,20	0,00	0,00	28.267.723,02	-1.439.556,18	-4,85%	-4,85%	13,04%
SANTANDER IBOVESA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6.328.054,19	1.278.904,31	0,00	7.200.418,71	-406.539,79	-5,34%	-4,75%	13,00%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	24.553.744,30	0,00	0,00	23.237.368,19	-1.316.376,11	-5,36%	-5,36%	9,61%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.773.707,27	0,00	0,00	4.288.759,03	-484.948,24	-10,16%	-10,16%	12,47%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>181.727.903,71</b>	<b>15.603.755,43</b>	<b>0,00</b>	<b>190.904.045,48</b>	<b>-6.427.613,66</b>	<b>-3,26%</b>		<b>10,78%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE PRAIA GRANDE  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 26/02/2021

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

## FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	21.238.903,56	0,00	0,00	22.215.615,59	976.712,03	4,60%	4,60%	5,18%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	19.332.974,47	0,00	0,00	20.187.235,49	854.261,02	4,42%	4,42%	11,13%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	24.868.572,27	0,00	0,00	25.374.457,41	505.885,14	2,03%	2,03%	6,37%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	0,00	7.000.000,00	0,00	7.127.433,19	127.433,19	1,82%	5,34%	6,31%
<b>Total Exterior</b>	<b>65.440.450,30</b>	<b>7.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>74.904.741,68</b>	<b>2.464.291,38</b>	<b>3,40%</b>		<b>7,30%</b>