

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

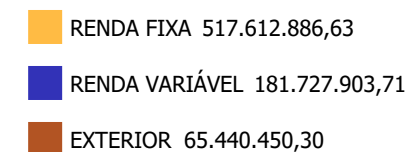
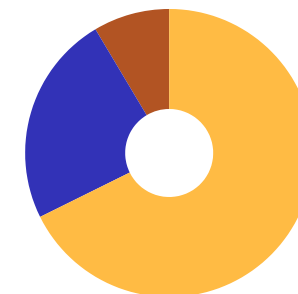
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	77.821.666,28	10,18%	892	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	28.025.579,39	3,66%	10.348	2,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.134.603,82	0,28%	1.212	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	5.408.056,60	0,71%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.039.631,04	0,79%	1.348	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	57.604.334,44	7,53%	321	3,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	14.092.390,47	1,84%	926	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	108.445.683,58	14,18%	677	1,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	108.388.060,23	14,17%	117	5,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	D+1	Não há	25.709.196,57	3,36%	6.297	5,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.566.759,53	3,60%	19.353	4,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	22.438.944,62	2,93%	263	4,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.813.408,07	3,11%	45	10,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	1	0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	207.256,12	0,03%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.917.315,86	1,30%	74	1,58%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.328.054,19	0,83%	39	0,97%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	16.690.497,26	2,18%	96	1,48%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	29.707.279,20	3,88%	18.040	4,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.773.707,27	0,62%	21.082	1,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	24.553.744,30	3,21%	13.969	3,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	29.699.373,24	3,88%	8.840	1,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	16.013.869,06	2,09%	14.571	1,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	13.493.395,41	1,76%	10.322	1,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	16.004.701,23	2,09%	44.564	1,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	22.430.324,36	2,93%	24.942	1,82%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	7.917,83	0,00%	105	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	86.802,72	0,01%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	854.249,19	0,11%		1,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.083.988,45	0,14%		2,87%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	21.238.903,56	2,78%	7.869	1,83%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	19.332.974,47	2,53%	17.343	1,31%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	24.868.572,27	3,25%	109.569	0,97%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			764.781.240,64				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	299.571.945,62	39,17%	5,00%	40,58%	100,00%	465.209.295,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	764.781.240,64
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.239.062,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	458.868.744,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	458.868.744,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	207.916.369,02	27,19%	0,00%	23,00%	40,00%	97.996.127,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	305.912.496,26
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	152.956.248,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	114.717.186,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	207.256,13	0,03%	0,00%	0,03%	5,00%	38.031.805,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	9.917.315,86	1,30%	0,00%	1,39%	5,00%	28.321.746,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.239.062,03
Total Renda Fixa	100,00%	517.612.886,63	67,68%	5,00%	65,00%	455,00%	

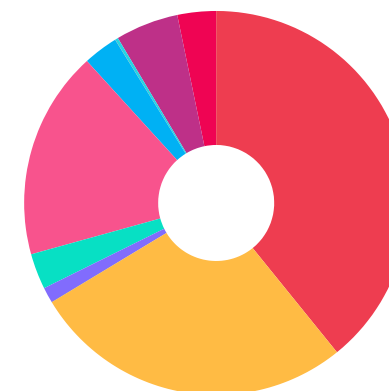


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

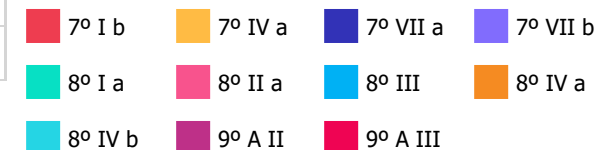


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)

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%	23.018.551,45	3,01%	0,00%	3,00%	30,00%	206.415.820,74
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	229.434.372,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	134.246.069,71	17,55%	2,00%	18,68%	20,00%	18.710.178,42
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	152.956.248,13
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	22.430.324,36	2,93%	0,00%	3,00%	10,00%	54.047.799,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	94.720,55	0,01%	0,00%	0,01%	5,00%	38.144.341,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.938.237,64	0,25%	0,00%	0,31%	5,00%	36.300.824,39
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.239.062,03
Total Renda Variável	35,00%	181.727.903,71	23,76%	2,00%	25,00%	125,00%	



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%	76.478.124,06
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	40.571.878,03	5,31%	0,00%	6,00%	10,00%	35.906.246,03
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	24.868.572,27	3,25%	0,00%	4,00%	10,00%	51.609.551,79
Total Exterior	10,00%	65.440.450,30	8,56%	0,00%	10,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	198.723.742,38	25,98	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	190.483.738,03	24,91	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	132.201.468,30	17,29	0,01
WESTERN ASSET	123.472.617,21	16,14	0,25
ICATU VANGUARDA	57.266.132,77	7,49	0,14
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	27.566.957,75	3,60	0,01
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	19.332.974,47	2,53	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	13.493.395,41	1,76	0,05
REDITUS INVESTIMENTOS	1.083.988,45	0,14	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	854.249,19	0,11	0,19
VILA RICA CAPITAL	207.256,12	0,03	1,57
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	86.802,73	0,01	-
PÁTRIA INVESTIMENTOS	7.917,83	0,00	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 Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,42%	0,42%	1,32%	2,68%	6,07%	16,15%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,07%	0,07%	-0,55%	1.226,37%	1.004,83%	4.155,46%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,39%	-1,39%	2,09%	-0,60%	5,77%	20,12%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-1,97%	-1,97%	3,13%	-1,45%	5,58%	22,33%	0,04%	0,07%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,69%	-1,69%	8,43%	2,01%	3,68%	26,83%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,67%	-1,67%	8,30%	1,77%	2,81%	25,26%	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%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	0,54%	0,79%	3,07%	9,59%	0,00%	0,01%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,66%	-0,66%	4,04%	2,59%	8,48%	24,20%	0,02%	0,06%

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
110% do CDI (Benchmark)	0,16%	0,16%	0,51%	1,04%	2,78%	9,34%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-
IMA-B (Benchmark)	-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%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,02%	-1,02%	5,96%	2,45%	4,93%	23,74%	0,03%	0,11%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	-1,73%	-1,73%	6,90%	1,55%	6,13%	27,83%	0,04%	0,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,08%	3,28%	3,54%	7,00%	20,22%	0,01%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,10%	0,10%	3,47%	4,22%	7,17%	19,51%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,01%	0,02%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	-1,50%	-1,50%	2,49%	-0,97%	6,19%	18,33%	0,03%	0,06%

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,05%	1,05%	5,06%	9,60%	15,40%	32,92%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,46%	-0,46%	-3,29%	-	-	-97,02%	-	0,83%
S&P 500 (Benchmark)	-1,11%	-1,11%	13,59%	13,55%	15,15%	37,36%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-0,16%	-0,16%	14,05%	13,28%	11,59%	37,59%	0,08%	0,27%
IBX-50 (Benchmark)	-2,78%	-2,78%	23,61%	13,27%	2,67%	17,81%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-2,87%	-2,87%	22,56%	11,72%	0,21%	15,36%	0,12%	0,43%
IMOB (Benchmark)	-7,03%	-7,03%	13,22%	-6,47%	-32,20%	8,78%	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-7,08%	-7,08%	12,83%	-7,15%	-33,08%	7,18%	0,19%	0,54%
ICON (Benchmark)	-1,28%	-1,28%	12,91%	3,78%	-3,99%	37,57%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-1,38%	-1,38%	12,38%	2,94%	-5,14%	35,42%	0,15%	0,43%
IDIV (Benchmark)	-5,08%	-5,08%	18,30%	8,08%	-4,52%	21,27%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,92%	-3,92%	17,82%	4,29%	-13,53%	10,48%	0,10%	0,39%
Ibovespa (Benchmark)	-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%

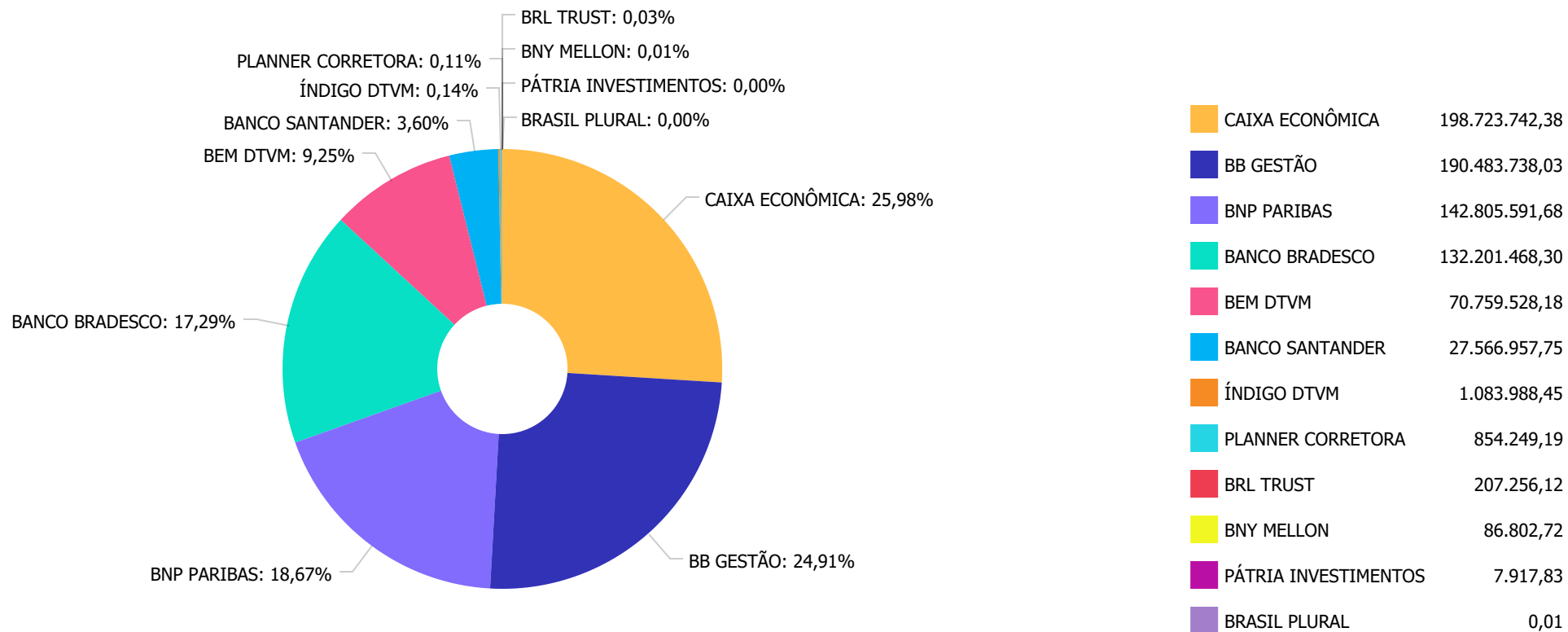
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,64%	-2,64%	14,42%	4,55%	-9,84%	12,05%	0,12%	0,46%
SMLL (Benchmark)	-3,43%	-3,43%	21,10%	10,52%	-4,50%	38,71%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-3,48%	-3,48%	20,19%	8,82%	-7,06%	31,28%	0,12%	0,47%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-1,53%	-1,53%	-19,99%	-3,99%	6,38%	-14,66%	0,03%	0,53%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-10,53%	-10,53%	-11,89%	-17,11%	-	-99,78%	0,14%	0,98%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	-1,91%	4,12%	-12,25%	83,15%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,18%	-3,18%	16,79%	6,58%	-7,53%	25,82%	0,13%	0,39%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,97%	-4,97%	22,58%	14,24%	5,75%	36,55%	0,12%	0,47%

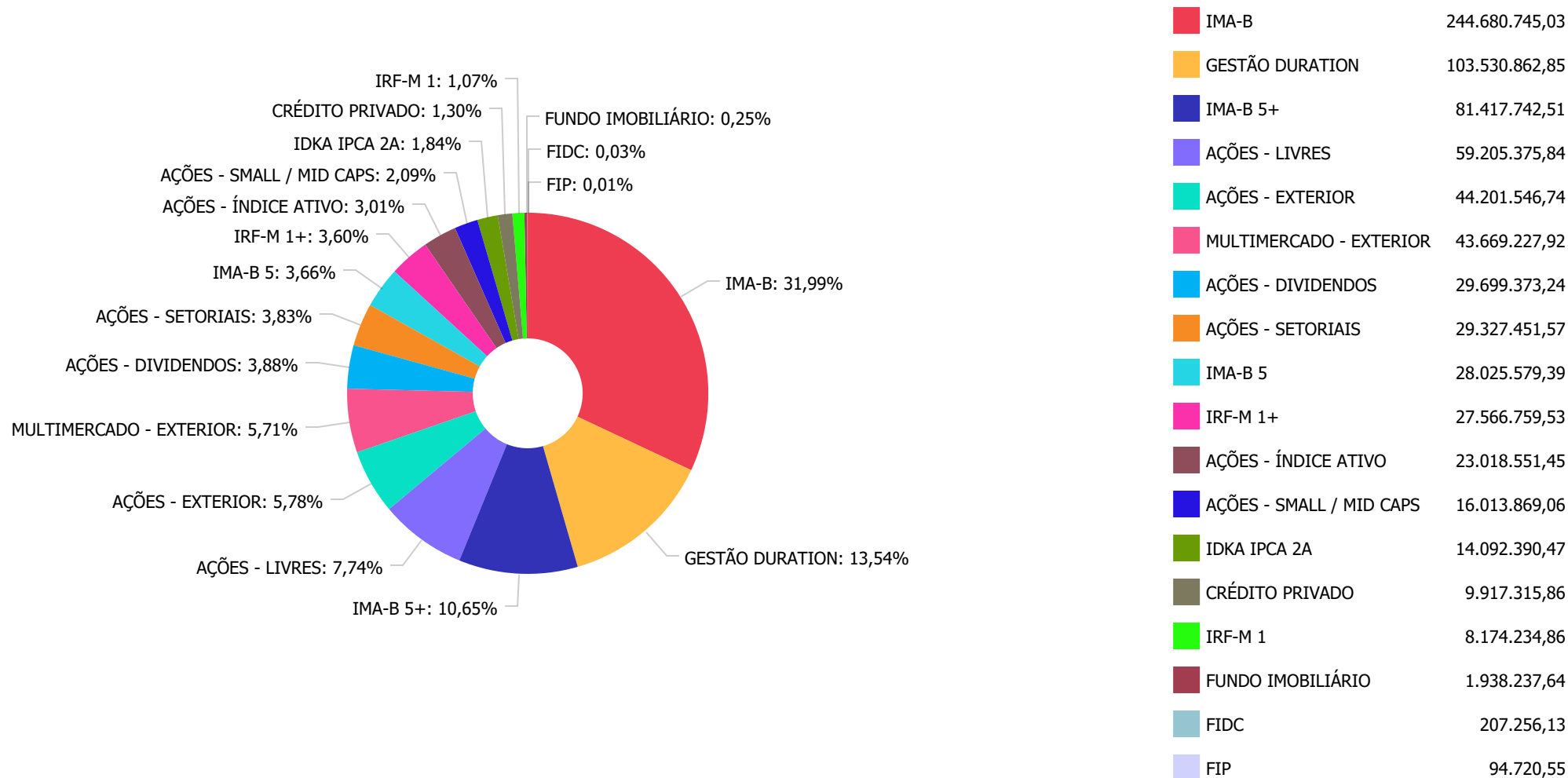
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,11%	6,11%	9,83%	21,25%	53,50%	120,12%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,89%	2,89%	5,70%	18,48%	59,07%	128,83%	0,12%	0,24%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	4,30%	4,30%	8,24%	27,17%	83,37%	-	0,13%	0,21%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	5,64%	5,64%	10,77%	23,80%	60,10%	112,76%	0,11%	0,20%

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



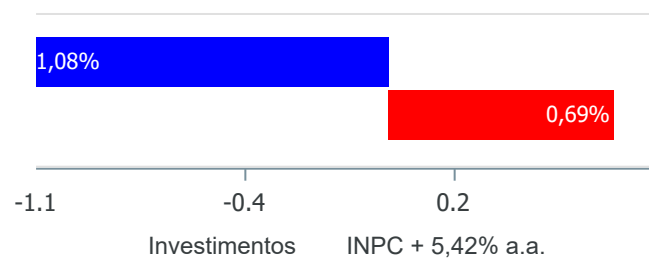
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



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	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%

Investimentos x Meta Atuarial



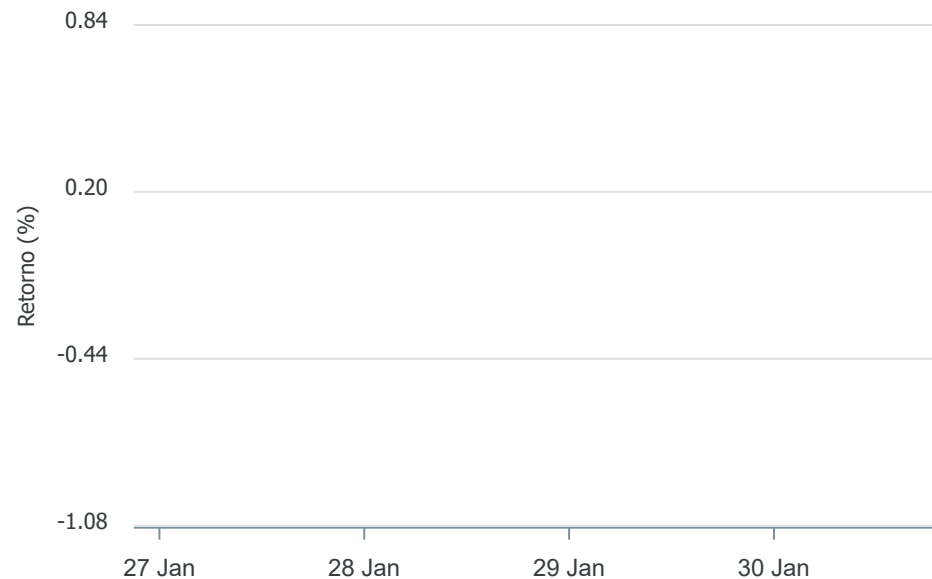
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 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...	14.067.492,31	0,00	0,00	14.092.390,47	24.898,16	0,18%	0,18%	0,95%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.907.615,53	0,00	0,00	9.917.315,86	9.700,33	0,10%	0,10%	1,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.403.817,55	0,00	0,00	5.408.056,60	4.239,05	0,08%	0,08%	1,05%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	207.105,64	0,00	0,00	207.256,12	150,48	0,07%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	77.801.989,29	0,00	0,00	77.821.666,28	19.676,99	0,03%	0,03%	0,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.092.174,95	440.500,48	398.637,16	2.134.603,82	565,55	0,02%	0,03%	0,15%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.213.553,61	17.230,54	8.189.997,23	6.039.631,04	-1.155,88	-0,01%	0,03%	0,15%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	28.211.968,76	0,00	0,00	28.025.579,39	-186.389,37	-0,66%	-0,66%	2,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	109.390.548,06	0,00	0,00	108.445.683,58	-944.864,48	-0,86%	-0,86%	2,59%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	109.506.176,94	0,00	0,00	108.388.060,23	-1.118.116,71	-1,02%	-1,02%	2,80%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	26.101.715,14	0,00	0,00	25.709.196,57	-392.518,57	-1,50%	-1,50%	2,81%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	24.218.024,67	0,00	0,00	23.813.408,07	-404.616,60	-1,67%	-1,67%	4,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	58.598.472,33	0,00	0,00	57.604.334,44	-994.137,89	-1,70%	-1,70%	4,11%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	22.833.420,13	0,00	0,00	22.438.944,62	-394.475,51	-1,73%	-1,73%	3,82%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	28.119.396,28	0,00	0,00	27.566.759,53	-552.636,75	-1,97%	-1,97%	3,79%
Total Renda Fixa	530.673.471,20	457.731,02	8.588.634,39	517.612.886,63	-4.929.681,20	-0,93%		2,58%

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
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.085.687,81	0,00	0,00	1.083.988,45	-1.699,36	-0,16%	-1,53%	2,58%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	22.466.086,29	0,00	0,00	22.430.324,36	-35.761,93	-0,16%	-0,16%	8,08%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	87.204,82	0,00	0,00	86.802,72	-402,10	-0,46%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	24.895.965,00	0,00	0,00	24.553.744,30	-342.220,70	-1,37%	-1,37%	14,59%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	867.663,98	0,00	0,00	854.249,19	-13.414,79	-1,55%	0,00%	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.859.019,92	0,00	0,00	13.493.395,41	-365.624,51	-2,64%	-2,64%	11,67%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	15.014.426,21	2.268.732,48	0,00	16.690.497,26	-592.661,43	-3,43%	-2,87%	12,32%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6.554.524,83	0,00	0,00	6.328.054,19	-226.470,64	-3,46%	-3,46%	11,79%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	16.591.069,00	0,00	0,00	16.013.869,06	-577.199,94	-3,48%	-3,48%	12,27%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	14.608.553,91	2.000.000,00	0,00	16.004.701,23	-603.852,68	-3,64%	-3,18%	13,37%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	30.910.072,00	0,00	0,00	29.699.373,24	-1.210.698,76	-3,92%	-3,92%	9,60%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	31.260.578,78	0,00	0,00	29.707.279,20	-1.553.299,58	-4,97%	-4,97%	11,79%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	5.137.460,74	0,00	0,00	4.773.707,27	-363.753,47	-7,08%	-7,08%	18,62%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	8.849,34	0,00	0,00	7.917,83	-931,51	-10,53%	-10,53%	14,13%
Total Renda Variável	183.347.162,63	4.268.732,48	0,00	181.727.903,71	-5.887.991,40	-3,14%		11,70%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE PRAIA GRANDE
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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	19.920.896,36	200.531,84	0,00	21.238.903,56	1.117.475,36	5,55%	5,64%	11,37%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	14.647.377,40	4.000.000,00	0,00	19.332.974,47	685.597,07	3,68%	4,30%	12,51%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	24.169.512,89	0,00	0,00	24.868.572,27	699.059,38	2,89%	2,89%	12,31%
Total Exterior	58.737.786,65	4.200.531,84	0,00	65.440.450,30	2.502.131,81	3,98%		12,06%