

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

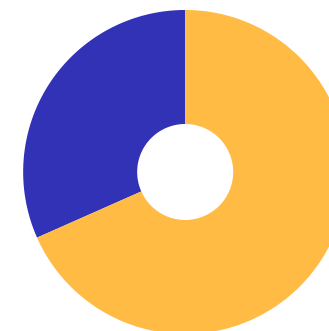
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.686.075,99	3,45%	899	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	136.361,91	0,03%	1.348	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	30.008.944,38	7,05%	926	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	32.257.300,80	7,58%	1.004	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	13.535.342,47	3,18%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.752.305,01	3,94%	689	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	81.186.793,35	19,08%	892	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	21.726.426,54	5,10%	196	1,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.494.019,25	2,23%	114	1,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	17.442.239,04	4,10%	53	18,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	2.153.894,47	0,51%	31	1,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	10.406.462,17	2,45%	81	9,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.379.138,02	0,79%	264	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	1.502.410,44	0,35%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	2.300.976,28	0,54%	5	15,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.682.049,00	3,68%	271	1,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.535.750,30	0,60%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	5.057.051,64	1,19%	8	18,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	20.312.912,68	4,77%	179	6,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	12.532.062,70	2,94%	6	3,88%	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
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	12.071.345,26	2,84%	291	13,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.563.503,54	1,54%	3.051	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.115.502,61	2,38%	911	3,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	20.312.912,68	4,77%	179	6,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	12.532.062,70	2,94%	6	3,88%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.449.086,94	1,75%	2.993	1,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	10.398.231,39	2,44%	1.022	6,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	3.843.191,43	0,90%	29	5,56%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	1.481.728,18	0,35%		0,00%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.039.322,57	1,18%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	11.224.391,08	2,64%	28	8,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.505.801,64	1,76%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.294.439,00	0,30%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	2.225.806,14	0,52%		1,85%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.917.387,81	1,39%	6	27,25%	Desenquadrado - RF
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	4.798.378,10	1,13%	10	7,61%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			425.617.909,15				

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%	188.563.123,91	44,30%	9,96%	49,81%	62,26%	76.426.586,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	84.087.615,21	19,76%	3,86%	9,29%	40,00%	86.159.548,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	7.592.801,94	1,78%	0,00%	2,28%	2,28%	2.111.286,39
Desenquadrado - RF	0,00%	10.715.765,91	2,52%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.715.765,91
Total Renda Fixa	100,00%	290.959.306,97	68,36%	13,82%	61,38%	104,54%	



RENTA FIXA 290.959.306,97
RENTA VARIÁVEL 134.658.602,18

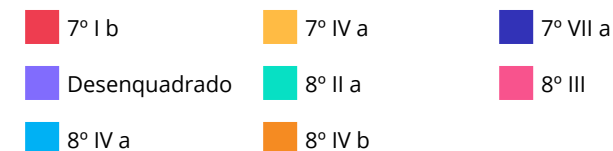
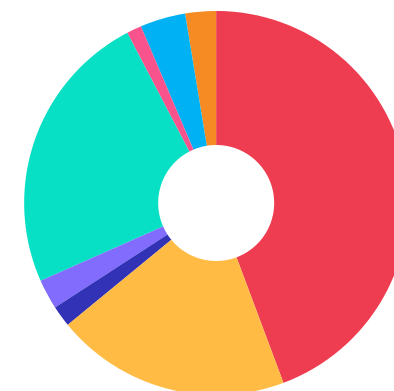
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REND A 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 II, Alínea 'a'	25,00%	102.043.922,14	23,98%	3,58%	17,91%	25,00%	4.360.555,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.324.919,61	1,25%	3,14%	3,14%	10,00%	37.236.871,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	16.263.713,65	3,82%	0,00%	3,91%	5,00%	5.017.181,81
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	11.026.046,78	2,59%	0,00%	2,80%	5,00%	10.254.848,68
Total Renda Variável	35,00%	134.658.602,18	31,64%	6,72%	27,76%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	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%	0,43%	5,00%	21.280.895,46
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,43%	5,00%	21.280.895,46
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,86%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	128.266.532,05	30,14	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	75.978.640,86	17,85	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	27.848.701,21	6,54	6,13
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	21.726.426,54	5,10	0,00
META ASSET MANAGEMENT	20.312.912,68	4,77	6,16
MULTINVEST CAPITAL	20.289.709,35	4,77	2,43
ITAÚ UNIBANCO	16.716.348,70	3,93	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	15.098.603,58	3,55	7,24
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	12.822.469,23	3,01	2,58
TRÍGONO CAPITAL	12.532.062,70	2,94	1,39
KPTL	11.224.391,08	2,64	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	10.398.231,39	2,44	0,21
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	10.115.502,61	2,38	0,32
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	9.778.807,79	2,30	0,55
PERFIN INVESTIMENTOS	7.449.086,94	1,75	0,07
NAVI CAPITAL	6.563.503,54	1,54	0,40
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	5.039.322,57	1,18	0,00
AURORA CAPITAL	4.798.378,10	1,13	2,71
ZION INVEST	2.225.806,14	0,52	0,27
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	2.153.894,47	0,51	-
RJI CORRETORA DE VALORES	1.502.410,44	0,35	0,29
CAPITÂNIA	1.481.728,18	0,35	0,01
CREDIT SUISSE HEDGING-GRIFFO C...	1.294.439,00	0,30	0,11

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 '	188.563.123,91	44,30	9,96	62,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	84.087.615,21	19,76	3,86	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	7.592.801,94	1,78	0,00	2,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	102.043.922,14	23,98	3,58	25,00
Artigo 8º, Inciso III	5.324.919,61	1,25	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	16.263.713,65	3,82	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	11.026.046,78	2,59	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	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
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,86%	0,86%	4,47%	8,36%	12,82%	26,99%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-0,94%	-0,94%	-27,29%	-29,37%	-30,86%	-22,10%	1,15%	0,69%
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%	0,95%	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%	1,02%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,79%	0,79%	4,23%	7,86%	11,79%	24,66%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	0,03%	0,11%	-1,37%	-4,58%	-4,73%	0,41%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,71%	0,71%	3,99%	7,36%	10,76%	22,35%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	3,33%	3,32%	7,96%	23,13%	1,20%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,69%	-1,69%	8,43%	2,01%	3,68%	26,83%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	8,38%	3,87%	6,55%	13,83%	2,47%	0,13%
IRF-M 1 (Benchmark)	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%	0,15%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-8,48%	-8,48%	-58,25%	-60,31%	-72,81%	-71,43%	14,19%	0,56%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	1,04%	0,04%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,64%	0,64%	2,40%	3,16%	-3,55%	6,22%	0,62%	0,06%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	10,64%	10,64%	14,16%	14,15%	15,48%	32,50%	15,32%	0,12%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,12%	-0,12%	-21,80%	-23,81%	-37,21%	-35,57%	0,57%	0,26%

IMA-B (Benchmark)	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,86%	-0,86%	5,93%	2,59%	4,73%	23,34%	2,59%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,87%	-0,87%	5,99%	2,66%	4,88%	23,46%	2,57%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,05%	-1,05%	5,99%	2,22%	6,18%	26,80%	2,72%	0,10%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2,01%	2,01%	-0,67%	2,52%	-6,31%	3,14%	2,34%	0,07%

CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,56%	0,56%	10,25%	4,62%	7,89%	14,06%	1,95%	0,12%

IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,13%	0,13%	0,44%	0,16%	2,65%	12,60%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,76%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,58%	-0,58%	2,68%	0,52%	3,61%	14,74%	1,40%	0,04%

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%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3,17%	3,17%	3,01%	-	-	-	-	0,03%

IDIV (Benchmark)	-5,08%	-5,08%	18,30%	8,08%	-4,52%	21,27%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,85%	-2,85%	17,47%	7,43%	-7,21%	17,69%	8,06%	0,37%

IBX (Benchmark)	-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%	12,63%	0,52%

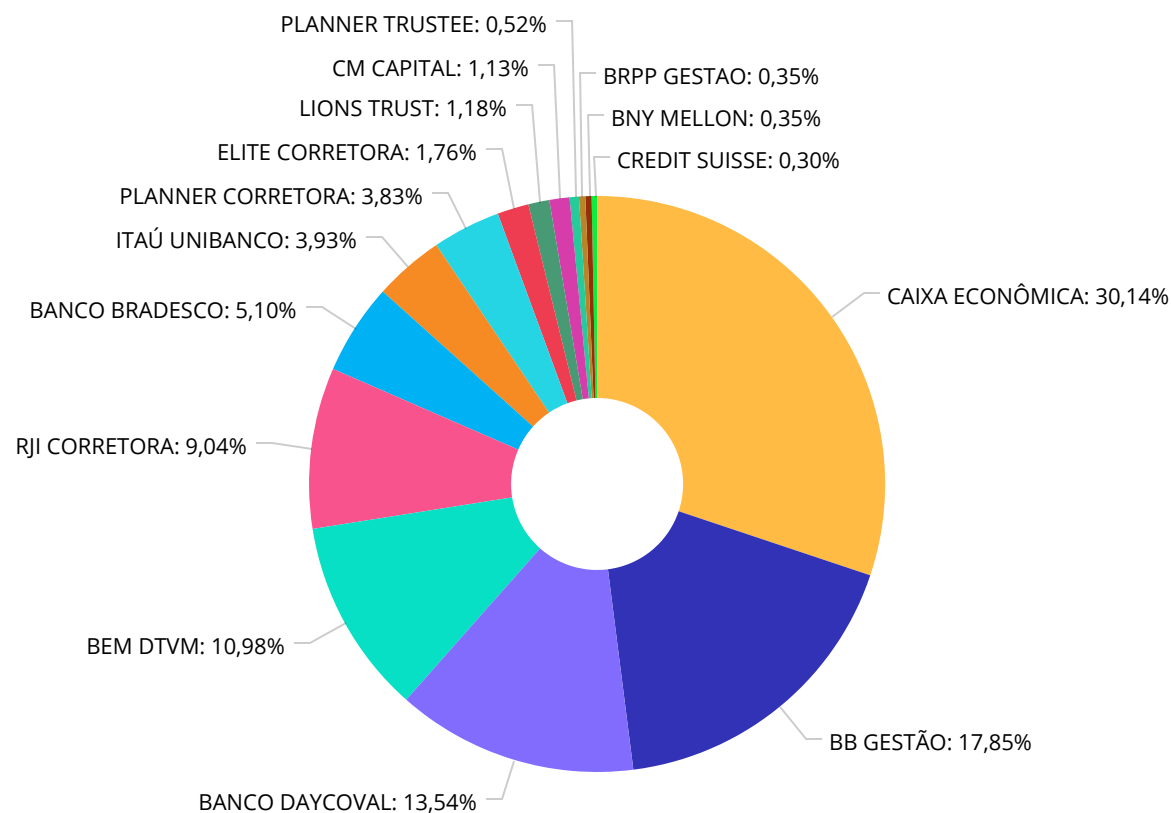
Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,62%	-3,62%	4,65%	-5,71%	-12,96%	15,42%	10,54%	0,43%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-2,30%	-2,30%	20,57%	11,81%	0,47%	20,10%	11,96%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-3,44%	-3,44%	17,28%	11,02%	7,31%	30,05%	9,94%	0,39%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,95%	-3,95%	15,85%	1,99%	-11,45%	21,54%	9,65%	0,41%
MULTINVEST FI AÇÕES	-2,16%	-2,16%	18,35%	6,36%	-2,36%	22,03%	10,50%	0,45%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,25%	-4,25%	20,75%	5,77%	1,31%	24,49%	10,17%	0,41%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,92%	1,92%	25,12%	20,55%	-	-	8,98%	-

CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,07%	0,07%	0,57%	0,91%	2,87%	9,84%	0,09%	0,01%

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

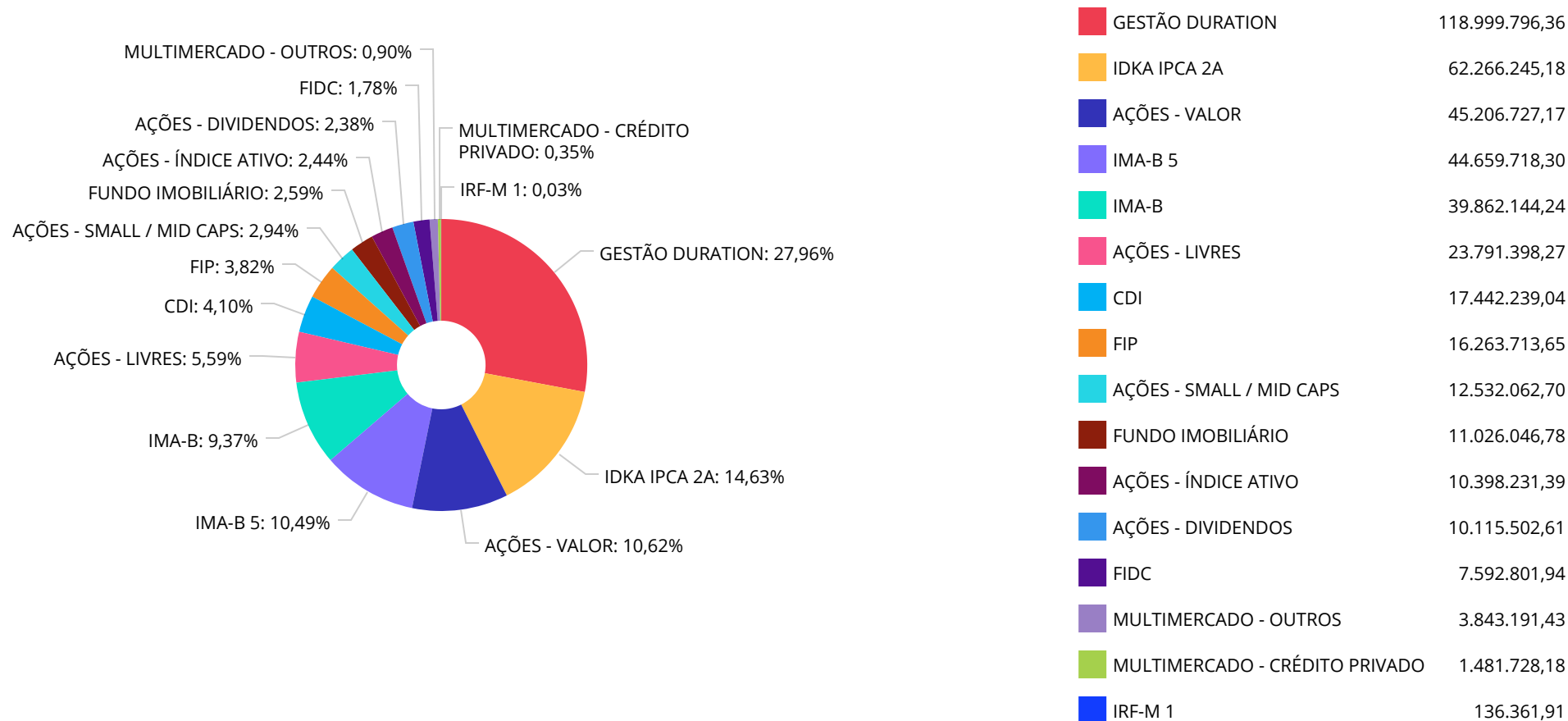
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,02%	-0,02%	-0,30%	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-0,13%	-0,13%	-2,45%	-2,70%	-3,40%	-	0,00%	0,00%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	0,10%	0,10%	4,06%	6,62%	-25,19%	-9,29%	4,14%	0,25%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,43%	-1,43%	-12,66%	-27,37%	-40,00%	-60,57%	7,37%	0,51%

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



CAIXA ECONÔMICA	128.266.532,05
BB GESTÃO	75.978.640,86
BANCO DAYCOVAL	57.615.528,31
BEM DTVM	46.729.370,11
RJI CORRETORA	38.455.733,79
BANCO BRADESCO	21.726.426,54
ITAÚ UNIBANCO	16.716.348,70
PLANNER CORRETORA	16.281.442,72
ELITE CORRETORA	7.505.801,64
LIONS TRUST	5.039.322,57
CM CAPITAL	4.798.378,10
PLANNER TRUSTEE	2.225.806,14
BRPP GESTAO	1.502.410,44
BNY MELLON	1.481.728,18
CREDIT SUISSE	1.294.439,00

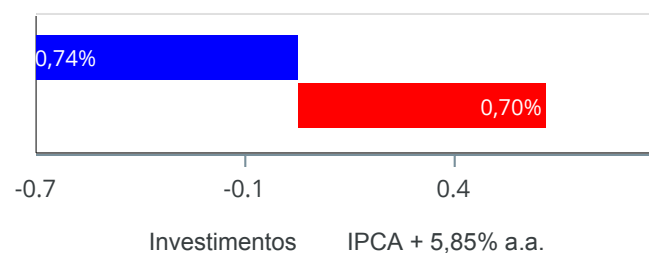
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade 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	437.049.080,79	413.240,53	8.625.466,75	425.617.909,15	-3.218.945,42	-3.218.945,42	-0,74%	-0,74%	0,70%	0,70%	-104,71%	3,83%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

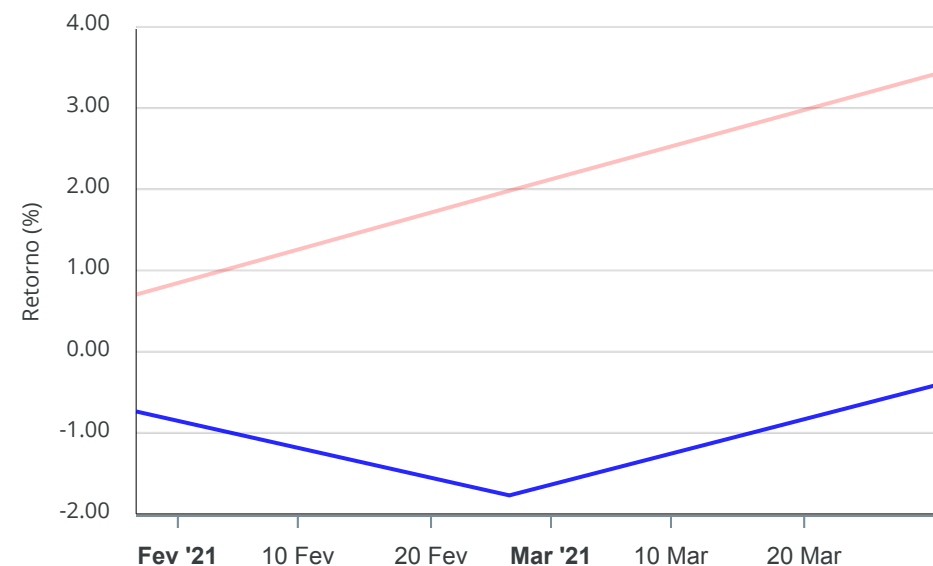
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ 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
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.336.908,86	0,00	0,00	4.798.378,10	461.469,24	10,64%	10,64%	15,32%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2.255.564,51	0,00	0,00	2.300.976,28	45.411,77	2,01%	2,01%	2,34%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.879.677,65	0,00	0,00	5.917.387,81	37.710,16	0,64%	0,64%	0,62%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	17.345.922,03	0,00	0,00	17.442.239,04	96.317,01	0,56%	0,56%	1,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	32.152.038,24	0,00	2.200.000,00	30.008.944,38	56.906,14	0,18%	0,18%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.374.618,31	0,00	0,00	3.379.138,02	4.519,71	0,13%	0,13%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	32.638.133,89	0,00	423.844,48	32.257.300,80	43.011,39	0,13%	0,13%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.736.162,61	0,00	0,00	16.752.305,01	16.142,40	0,10%	0,10%	1,04%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	10.398.069,91	0,00	0,00	10.406.462,17	8.392,26	0,08%	0,08%	2,47%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.534.963,18	0,00	0,00	2.535.750,30	787,12	0,03%	0,09%	0,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	136.327,52	0,00	0,00	136.361,91	34,39	0,03%	0,03%	0,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.532.003,27	0,00	0,00	13.535.342,47	3.339,20	0,02%	0,02%	1,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	82.657.100,96	311.328,76	1.800.834,67	81.186.793,35	19.198,30	0,02%	0,03%	0,76%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.353.345,81	0,00	196.833,60	2.153.894,47	-2.617,74	-0,11%	-8,48%	14,19%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.504.281,11	0,00	0,00	1.502.410,44	-1.870,67	-0,12%	-0,12%	0,57%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	25.884.925,62	0,00	4.000.000,00	21.726.426,54	-158.499,08	-0,61%	-0,58%	1,40%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.817.903,28	0,00	0,00	15.682.049,00	-135.854,28	-0,86%	-0,86%	2,59%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.815.337,53	0,00	0,00	14.686.075,99	-129.261,54	-0,87%	-0,87%	2,57%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	5.105.118,29	0,00	0,00	5.057.051,64	-48.066,65	-0,94%	-0,94%	1,15%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.595.170,21	0,00	0,00	9.494.019,25	-101.150,96	-1,05%	-1,05%	2,72%

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	299.053.572,79	311.328,76	8.621.512,75	290.959.306,97	215.918,17	0,07%		1,62%

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
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.295.775,72	0,00	0,00	12.532.062,70	236.286,98	1,92%	1,92%	8,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.840.491,66	0,00	0,00	3.843.191,43	2.699,77	0,07%	0,07%	0,09%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.299.470,60	0,00	3.954,00	1.294.439,00	-1.077,60	-0,08%	0,10%	4,14%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	11.237.325,46	0,00	0,00	11.224.391,08	-12.934,38	-0,12%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.515.471,54	0,00	0,00	7.505.801,64	-9.669,90	-0,13%	-0,13%	0,00%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.489.844,20	0,00	0,00	1.481.728,18	-8.116,02	-0,54%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	4.982.385,10	101.911,77	0,00	5.039.322,57	-44.974,30	-0,88%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.258.064,20	0,00	0,00	2.225.806,14	-32.258,06	-1,43%	-1,43%	7,37%
MULTINVEST FI AÇÕES	12.338.276,31	0,00	0,00	12.071.345,26	-266.931,05	-2,16%	-2,16%	10,50%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	10.642.848,84	0,00	0,00	10.398.231,39	-244.617,45	-2,30%	-2,30%	11,96%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.412.081,55	0,00	0,00	10.115.502,61	-296.578,94	-2,85%	-2,85%	8,06%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.279.644,53	0,00	0,00	12.822.469,23	-457.175,30	-3,44%	-3,44%	9,94%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.728.770,78	0,00	0,00	7.449.086,94	-279.683,84	-3,62%	-3,62%	10,54%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.180.707,48	0,00	0,00	9.778.807,79	-401.899,69	-3,95%	-3,95%	9,65%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.854.952,86	0,00	0,00	6.563.503,54	-291.449,32	-4,25%	-4,25%	10,17%
META VALOR FI AÇÕES	21.639.397,17	0,00	0,00	20.312.912,68	-1.326.484,49	-6,13%	-6,13%	12,63%
Total Renda Variável	137.995.508,00	101.911,77	3.954,00	134.658.602,18	-3.434.863,59	-2,49%		9,33%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.