

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

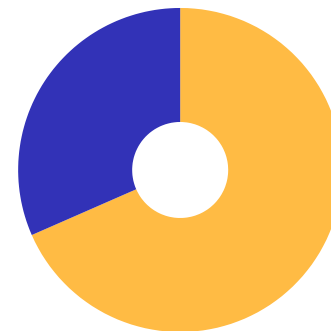
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	82.657.100,96	18,91%	885	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	14.815.337,53	3,39%	899	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	32.152.038,24	7,36%	922	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	136.327,52	0,03%	1.361	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	32.638.133,89	7,47%	1.005	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.736.162,61	3,83%	685	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	13.532.003,27	3,10%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	2.255.564,51	0,52%	5	15,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.817.903,28	3,62%	272	1,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÔTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	17.345.922,03	3,97%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	2.353.345,81	0,54%	31	1,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	25.884.925,62	5,92%	196	1,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	10.398.069,91	2,38%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.374.618,31	0,77%	269	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	1.504.281,11	0,34%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.595.170,21	2,20%	110	1,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.534.963,18	0,58%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	5.105.118,29	1,17%	8	18,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	12.295.775,72	2,81%	6	4,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.412.081,55	2,38%	941	3,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	13.279.644,53	3,04%	162	11,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	10.642.848,84	2,44%	1.055	5,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.728.770,78	1,77%	3.065	1,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	21.639.397,17	4,95%	183	6,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	12.338.276,31	2,82%	291	11,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	10.180.707,48	2,33%	7.090	0,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.854.952,86	1,57%	3.143	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	3.840.491,66	0,88%	30	5,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	1.489.844,20	0,34%		6,49%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	11.237.325,46	2,57%	28	8,38%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	4.982.385,10	1,14%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.515.471,54	1,72%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.299.470,60	0,30%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	2.258.064,20	0,52%		1,85%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	4.336.908,86	0,99%	10	7,61%	Desenquadrado - RF
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.879.677,65	1,35%	7	23,86%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			437.049.080,79				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	43.704.908,08
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	192.667.104,02	44,08%	20,00%	32,50%	81,00%	161.342.651,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	262.229.448,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	45,00%	88.529.800,79	20,26%	10,00%	25,00%	40,00%	86.289.831,53
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	65.557.362,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	7.640.081,47	1,75%	0,00%	2,50%	5,00%	14.212.372,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.852.454,04
Desenquadrado - RF	0,00%	10.216.586,51	2,34%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.216.586,51
Total Renda Fixa	100,00%	299.053.572,79	68,43%	30,00%	60,00%	216,00%	



RENDA FIXA 299.053.572,79

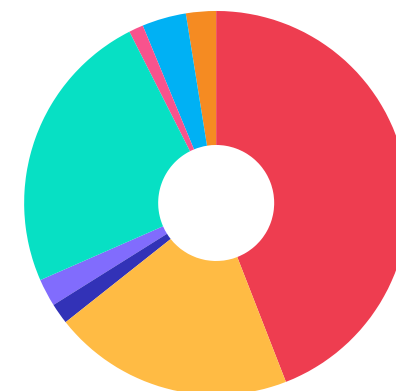
RENDA VARIÁVEL 137.995.508,00

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!

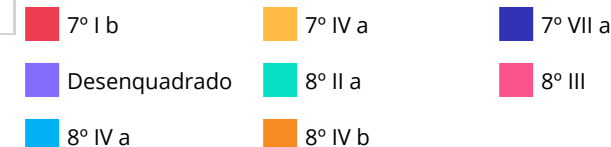


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.852.454,04
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.852.454,04
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	25,00%	105.372.455,24	24,11%	7,00%	20,00%	25,00%	3.889.814,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.330.335,86	1,22%	0,00%	5,00%	10,00%	38.374.572,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	16.219.710,56	3,71%	0,00%	5,00%	5,00%	5.632.743,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	11.073.006,34	2,53%	0,00%	5,00%	5,00%	10.779.447,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.852.454,04
Total Renda Variável	35,00%	137.995.508,00	31,57%	7,00%	35,00%	60,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	21.852.454,04
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	21.852.454,04
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	130.246.899,90	29,80	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	78.238.107,40	17,90	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	27.743.991,94	6,35	5,91
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	25.884.925,62	5,92	0,00
META ASSET MANAGEMENT	21.639.397,17	4,95	6,16
MULTINVEST CAPITAL	20.473.518,47	4,68	2,45
ITAÚ UNIBANCO	16.810.280,18	3,85	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	15.155.553,01	3,47	7,25
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	13.279.644,53	3,04	2,66
TRÍGONO CAPITAL	12.295.775,72	2,81	1,44
KPTL	11.237.325,46	2,57	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	10.642.848,84	2,44	0,20
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	10.412.081,55	2,38	0,32
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	10.180.707,48	2,33	0,55
PERFIN INVESTIMENTOS	7.728.770,78	1,77	0,08
NAVI CAPITAL	6.854.952,86	1,57	0,42
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	4.982.385,10	1,14	0,00
AURORA CAPITAL	4.336.908,86	0,99	2,61
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	2.353.345,81	0,54	0,04
ZION INVEST	2.258.064,20	0,52	0,46
RJI CORRETORA DE VALORES	1.504.281,11	0,34	0,29
CAPITÂNIA	1.489.844,20	0,34	0,01
CREDIT SUISSE HEDGING-GRIFFO C...	1.299.470,60	0,30	0,11

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	192.667.104,02	44,08	20,00	81,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	88.529.800,79	20,26	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	7.640.081,47	1,75	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	105.372.455,24	24,11	7,00	25,00
Artigo 8º, Inciso III	5.330.335,86	1,22	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	16.219.710,56	3,71	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	11.073.006,34	2,53	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	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	2,03%	12,84%	5,13%	8,58%	12,84%	27,16%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-26,62%	-28,30%	-25,90%	-26,32%	-28,30%	-20,67%	44,67%	0,69%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	7,92%	3,22%	4,89%	7,92%	20,01%	0,66%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,71%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,95%	11,80%	4,89%	8,07%	11,80%	24,81%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,48%	-4,72%	1,08%	-1,81%	-4,72%	-3,95%	1,61%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,87%	10,76%	4,64%	7,55%	10,76%	22,49%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,97%	8,65%	2,92%	4,45%	8,65%	25,73%	0,81%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,51%	5,50%	10,53%	11,36%	5,50%	37,54%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	8,24%	6,36%	8,93%	7,37%	6,36%	15,58%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,10%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,27%	-70,19%	-54,42%	-56,65%	-70,19%	-68,73%	0,19%	0,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,81%	7,78%	3,34%	4,56%	7,78%	21,67%	0,75%	0,03%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,27%	-3,60%	1,79%	2,23%	-3,60%	7,97%	1,12%	0,06%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,07%	3,46%	3,88%	4,74%	3,46%	22,00%	1,95%	0,05%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,60%	-37,11%	-21,93%	-23,24%	-37,11%	-34,65%	0,42%	0,26%

IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,81%	5,92%	7,04%	8,01%	5,92%	29,81%	2,04%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,84%	6,06%	7,13%	8,09%	6,06%	30,02%	2,04%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	4,94%	7,53%	7,12%	7,90%	7,53%	33,84%	2,07%	0,10%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	-2,22%	-7,83%	-2,90%	-1,17%	-7,83%	3,99%	1,67%	0,07%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	9,02%	7,59%	10,47%	6,28%	7,59%	14,29%	-	-

IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,20%	2,86%	0,39%	0,58%	2,86%	15,12%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,55%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,48%	4,66%	3,00%	2,83%	4,66%	17,68%	1,14%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,24%	15,45%	5,74%	9,85%	15,45%	33,11%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	0,02%	-	-0,33%	-0,91%	-	-	-	0,00%

IDIV (Benchmark)	8,94%	-1,00%	25,44%	21,29%	-1,00%	43,71%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,26%	-5,60%	21,31%	16,33%	-5,60%	35,93%	5,47%	0,37%

IBX (Benchmark)	9,15%	3,50%	25,34%	25,28%	3,50%	38,06%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	7,50%	4,76%	18,15%	20,09%	4,76%	40,67%	6,83%	0,52%

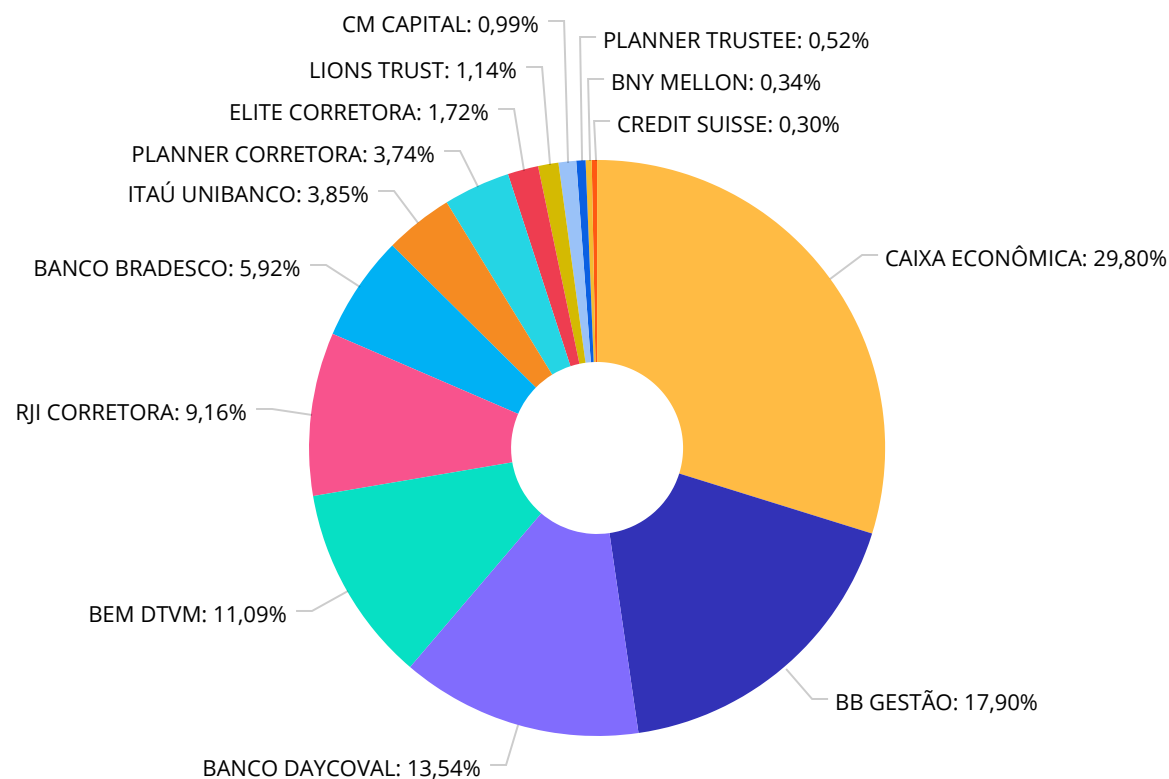
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,60%	-7,77%	6,66%	5,99%	-7,77%	29,68%	5,70%	0,43%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8,85%	1,23%	22,78%	24,35%	1,23%	35,86%	6,02%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	6,65%	7,83%	22,30%	25,58%	7,83%	48,57%	5,91%	0,39%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,28%	-6,23%	18,58%	15,16%	-6,23%	41,49%	6,52%	0,41%
MULTINVEST FI AÇÕES	7,79%	1,27%	22,22%	19,38%	1,27%	38,12%	6,88%	0,45%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,36%	3,38%	22,46%	20,17%	3,38%	46,10%	7,30%	0,41%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,32%	-	22,82%	22,75%	-	-	6,80%	-

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,35%	3,30%	0,69%	1,14%	3,30%	10,52%	0,11%	0,01%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

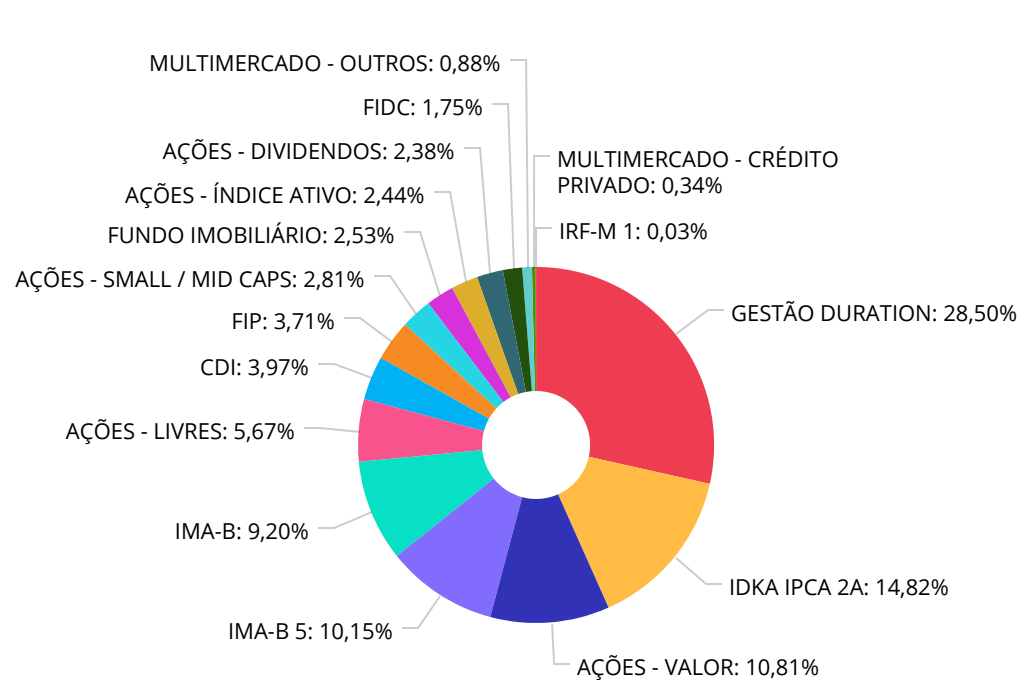
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-	-	-	-	-	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,10%	-	-13,25%	-13,69%	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-2,06%	-3,47%	-2,32%	-2,69%	-3,47%	-	0,00%	0,00%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	3,31%	-27,95%	2,31%	0,76%	-27,95%	-9,19%	8,42%	0,25%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-11,39%	-45,74%	-10,26%	-1,41%	-45,74%	-59,30%	7,42%	0,51%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2020)



CAIXA ECONÔMICA	130.246.899,90
BB GESTÃO	78.238.107,40
BANCO DAYCOVAL	59.171.862,55
BEM DTVM	48.456.157,20
RJI CORRETORA	40.016.259,69
BANCO BRADESCO	25.884.925,62
ITAÚ UNIBANCO	16.810.280,18
PLANNER CORRETORA	16.342.443,75
ELITE CORRETORA	7.515.471,54
LIONS TRUST	4.982.385,10
CM CAPITAL	4.336.908,86
PLANNER TRUSTEE	2.258.064,20
BNY MELLON	1.489.844,20
CREDIT SUISSE	1.299.470,60

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)

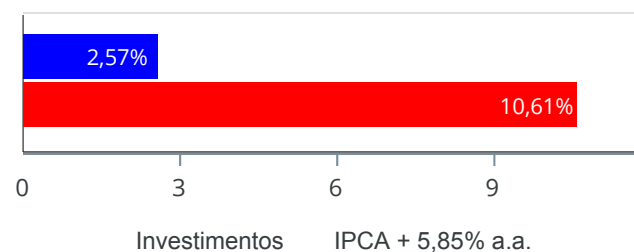


GESTÃO DURATION	124.570.279,31
IDKA IPCA 2A	64.790.172,13
AÇÕES - VALOR	47.257.318,01
IMA-B 5	44.342.379,31
IMA-B	40.228.411,02
AÇÕES - LIVRES	24.764.431,12
CDI	17.345.922,03
FIP	16.219.710,56
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	12.295.775,72
FUNDO IMOBILIÁRIO	11.073.006,34
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	10.642.848,84
AÇÕES - DIVIDENDOS	10.412.081,55
FIDC	7.640.081,47
MULTIMERCADO - OUTROS	3.840.491,66
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	1.489.844,20
IRF-M 1	136.327,52

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

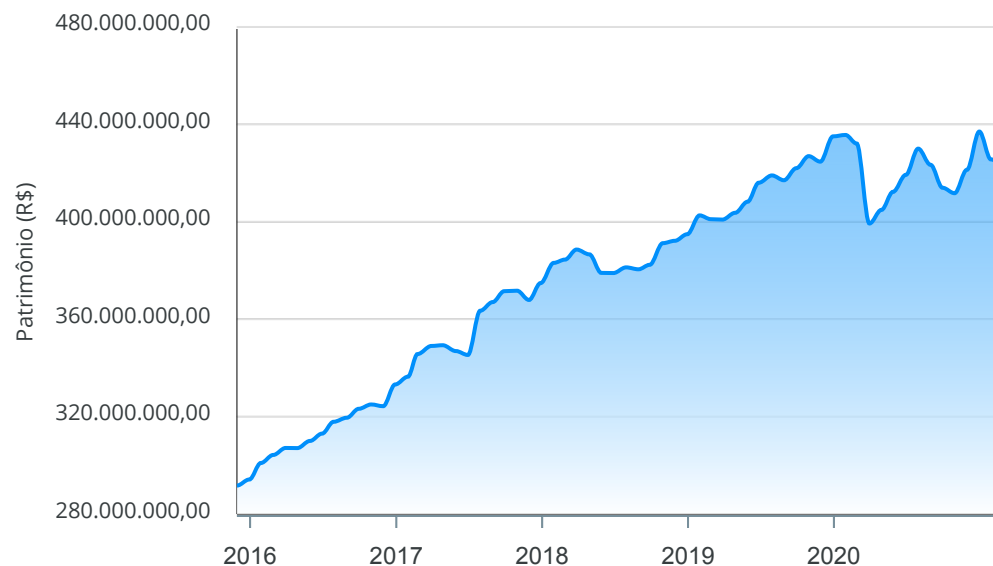
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	435.083.987,15	5.418.202,43	6.293.697,59	435.654.897,26	1.446.405,27	1.446.405,27	0,33%	0,33%	0,71%	0,71%	46,91%	2,17%
Fevereiro	435.654.897,26	26.147.187,06	26.889.815,73	432.155.043,44	-2.757.225,15	-1.310.819,88	-0,63%	-0,30%	0,66%	1,37%	-22,06%	3,46%
Março	432.155.043,44	10.899.560,63	11.531.032,28	399.293.679,60	-32.229.892,19	-33.540.712,07	-7,46%	-7,74%	0,57%	1,95%	-397,45%	15,87%
Abril	399.293.679,60	3.184.673,95	3.931.952,59	404.881.678,44	6.335.277,48	-27.205.434,59	1,59%	-6,27%	0,14%	2,09%	-300,13%	7,41%
Mai	404.881.678,44	3.484.311,43	4.288.306,99	412.303.314,74	8.225.631,86	-18.979.802,73	2,03%	-4,37%	0,07%	2,16%	-202,08%	4,22%
Junho	412.303.314,74	4.735.468,15	5.522.255,49	419.262.773,89	7.746.246,49	-11.233.556,24	1,88%	-2,57%	0,74%	2,91%	-88,29%	3,54%
Julho	419.262.773,89	8.374.230,07	9.213.525,93	430.035.391,04	11.611.913,01	378.356,77	2,77%	0,13%	0,88%	3,82%	3,27%	4,90%
Agosto	430.035.391,04	6.664.499,10	9.460.014,97	423.392.330,27	-3.847.544,90	-3.469.188,13	-0,89%	-0,77%	0,72%	4,57%	-16,88%	4,99%
Setembro	423.392.330,27	3.197.108,91	4.100.653,32	413.969.501,49	-8.519.284,37	-11.988.472,50	-2,01%	-2,77%	1,12%	5,73%	-48,26%	5,01%
Outubro	413.969.501,49	29.931.145,48	31.011.208,62	411.735.625,36	-1.153.812,99	-13.142.285,49	-0,28%	-3,04%	1,34%	7,15%	-42,49%	3,49%
Novembro	411.735.625,36	5.051.283,19	6.079.827,51	421.347.365,33	10.640.284,29	-2.502.001,20	2,58%	-0,53%	1,35%	8,59%	-6,20%	4,60%
Dezembro	421.347.365,33	22.373.633,19	19.877.988,79	437.049.080,79	13.206.071,06	10.704.069,86	3,12%	2,57%	1,85%	10,61%	24,20%	3,02%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

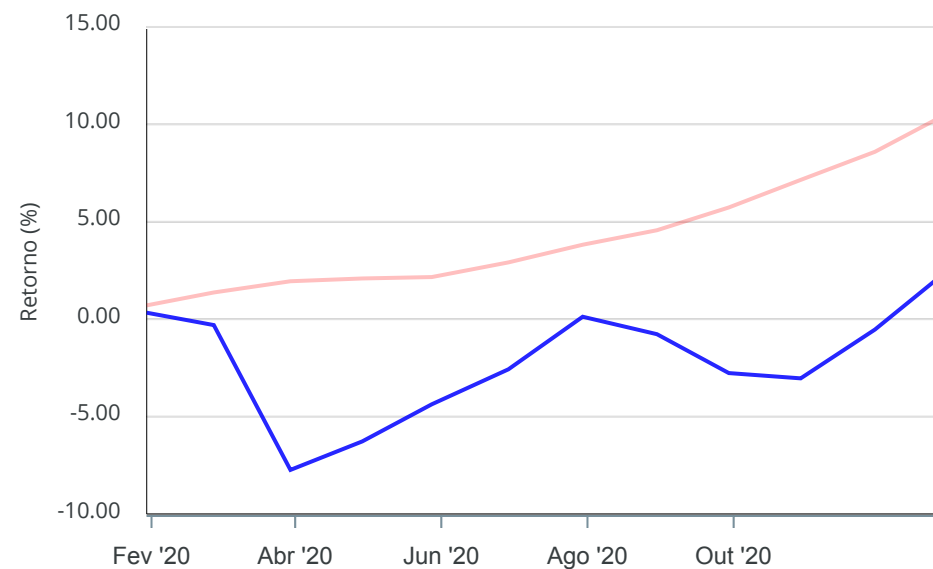
Evolução do Patrimônio



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 Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	15.910.541,92	0,00	0,00	17.345.922,03	1.435.380,11	9,02%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.399.224,73	3.473.849,43	0,00	10.398.069,91	524.995,75	5,32%	-	-
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.143.630,88	0,00	0,00	9.595.170,21	451.539,33	4,94%	4,94%	2,07%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.092.419,82	0,00	0,00	15.817.903,28	725.483,46	4,81%	4,81%	2,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	22.047.890,19	0,00	8.000.000,00	14.815.337,53	767.447,34	3,48%	4,84%	2,04%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	25.258.573,94	0,00	0,00	25.884.925,62	626.351,68	2,48%	2,48%	1,14%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.249.102,98	0,00	0,00	4.336.908,86	87.805,88	2,07%	2,07%	1,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.270.679,63	0,00	0,00	13.532.003,27	261.323,64	1,97%	1,97%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.439.125,89	0,00	0,00	16.736.162,61	297.036,72	1,81%	1,81%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	32.107.505,04	0,00	0,00	32.638.133,89	530.628,85	1,65%	1,65%	0,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	31.779.647,37	0,00	111.835,61	32.152.038,24	484.226,48	1,52%	1,53%	0,66%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.805.902,41	0,00	0,00	5.879.677,65	73.775,24	1,27%	1,27%	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	81.010.477,76	8.893.757,93	8.307.779,89	82.657.100,96	1.060.645,16	1,18%	1,32%	0,55%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.495.337,61	0,00	0,00	1.504.281,11	8.943,50	0,60%	0,60%	0,42%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.522.824,88	0,00	0,00	2.534.963,18	12.138,30	0,48%	0,48%	1,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	135.940,46	0,00	0,00	136.327,52	387,06	0,28%	0,28%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.367.809,91	0,00	0,00	3.374.618,31	6.808,40	0,20%	0,20%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.359.815,67	0,00	0,00	2.353.345,81	-6.469,86	-0,27%	-0,27%	0,19%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2.306.806,25	0,00	0,00	2.255.564,51	-51.241,74	-2,22%	-2,22%	1,67%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	6.957.168,73	0,00	0,00	5.105.118,29	-1.852.050,44	-26,62%	-26,62%	44,67%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	297.660.426,07	12.367.607,36	16.419.615,50	299.053.572,79	5.445.154,86	1,76%		1,76%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.155.958,70	0,00	0,00	6.854.952,86	698.994,16	11,35%	11,35%	7,30%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.045.494,22	0,00	0,00	12.295.775,72	1.250.281,50	11,32%	11,32%	6,80%
MULTINVEST FI AÇÕES	11.446.798,20	0,00	0,00	12.338.276,31	891.478,11	7,79%	7,79%	6,88%
META VALOR FI AÇÕES	20.129.700,34	0,00	0,00	21.639.397,17	1.509.696,83	7,50%	7,50%	6,83%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.707.214,71	0,00	0,00	10.412.081,55	704.866,84	7,26%	7,26%	5,47%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	12.451.320,14	0,00	0,00	13.279.644,53	828.324,39	6,65%	6,65%	5,91%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	10.642.848,84	642.848,84	6,43%	8,85%	6,02%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	9.578.791,75	0,00	0,00	10.180.707,48	601.915,73	6,28%	6,28%	6,52%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.255.294,68	0,00	3.445.042,68	0,00	189.748,00	5,83%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.732.606,66	0,00	0,00	11.237.325,46	504.718,80	4,70%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.388.567,48	0,00	0,00	7.728.770,78	340.203,30	4,60%	4,60%	5,70%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.254.126,30	0,00	3.594,00	1.299.470,60	48.938,30	3,90%	3,31%	8,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.821.074,30	6.025,83	0,00	3.840.491,66	13.391,53	0,35%	0,35%	0,11%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	4.987.379,48	0,00	0,00	4.982.385,10	-4.994,38	-0,10%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.511.047,20	0,00	9.736,61	1.489.844,20	-11.466,39	-0,76%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.673.178,36	0,00	0,00	7.515.471,54	-157.706,82	-2,06%	-2,06%	0,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.548.386,74	0,00	0,00	2.258.064,20	-290.322,54	-11,39%	-11,39%	7,42%
Total Renda Variável	123.686.939,26	10.006.025,83	3.458.373,29	137.995.508,00	7.760.916,20	5,96%		5,86%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	72.404.096,53	23.537.971,09	14.937.440,09	82.657.100,96	1.652.473,43	1,72%	2,04%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	15.701.861,40	0,00	0,00	17.345.922,03	1.644.060,63	10,47%	10,47%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	21.576.264,27	0,00	8.000.000,00	14.815.337,53	1.239.073,26	5,74%	7,13%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.777.353,90	0,00	0,00	15.817.903,28	1.040.549,38	7,04%	7,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	30.994.795,82	335.316,80	182.227,29	32.152.038,24	1.004.152,91	3,21%	3,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	41.672.171,92	0,00	10.000.000,00	32.638.133,89	965.961,97	2,32%	3,05%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	25.132.133,01	0,00	0,00	25.884.925,62	752.792,61	3,00%	3,00%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	8.957.545,74	0,00	0,00	9.595.170,21	637.624,47	7,12%	7,12%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.358.667,21	3.473.849,43	0,00	10.398.069,91	565.553,27	5,75%	8,93%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.266.199,68	0,00	70.411,06	16.736.162,61	540.373,99	3,32%	3,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.480.636,35	0,00	335.316,80	13.532.003,27	386.683,72	2,87%	2,92%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.174.940,35	0,00	0,00	4.336.908,86	161.968,51	3,88%	3,88%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.776.373,34	0,00	0,00	5.879.677,65	103.304,31	1,79%	1,79%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.507.858,88	0,00	0,00	2.534.963,18	27.104,30	1,08%	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.361.682,82	0,00	0,00	3.374.618,31	12.935,49	0,38%	0,38%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.926.941,72	0,00	425.953,68	1.504.281,11	3.293,07	0,17%	-21,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	135.454,42	0,00	0,00	136.327,52	873,10	0,64%	0,64%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2.322.861,41	0,00	0,00	2.255.564,51	-67.296,90	-2,90%	-2,90%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.163.140,01	0,00	1.181.001,60	2.353.345,81	-1.628.792,60	-31,55%	-54,42%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	6.889.618,71	0,00	0,00	5.105.118,29	-1.784.500,42	-25,90%	-25,90%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
			Total Renda Fixa		7.258.188,50	2,22%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
META VALOR FI AÇÕES	18.316.017,90	0,00	0,00	21.639.397,17	3.323.379,27	18,14%	18,14%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	12.295.775,72	2.295.775,72	22,96%	22,82%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	5.119.308,19	6.000.000,00	0,00	13.279.644,53	2.160.336,34	19,43%	22,30%
MULTINVEST FI AÇÕES	6.304.896,83	4.000.000,00	0,00	12.338.276,31	2.033.379,48	19,73%	22,22%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.583.366,91	0,00	0,00	10.412.081,55	1.828.714,64	21,31%	21,31%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8.585.395,79	0,00	0,00	10.180.707,48	1.595.311,69	18,58%	18,58%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.597.531,26	0,00	0,00	6.854.952,86	1.257.421,60	22,46%	22,46%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	10.642.848,84	642.848,84	6,43%	22,78%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.246.342,36	0,00	0,00	7.728.770,78	482.428,42	6,66%	6,66%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.769.703,30	0,00	0,00	11.237.325,46	467.622,16	4,34%	-0,33%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.238.671,05	0,00	3.445.042,68	0,00	206.371,63	6,37%	-
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	9.321.532,07	0,00	9.432.053,82	0,00	110.521,75	1,19%	20,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.269.007,40	0,00	2.339.025,02	0,00	70.017,62	3,09%	17,87%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.263.830,10	0,00	7.787,00	1.299.470,60	43.427,50	3,44%	2,31%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4.376.796,27	0,00	4.414.473,25	0,00	37.676,98	0,86%	14,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.805.243,52	8.924,54	0,00	3.840.491,66	26.323,60	0,69%	0,69%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.122.546,93	0,00	2.118.383,24	0,00	-4.163,69	-0,20%	16,78%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.515.235,82	0,00	9.736,61	1.489.844,20	-15.655,01	-1,03%	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.694.283,84	0,00	0,00	7.515.471,54	-178.812,30	-2,32%	-2,32%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.516.128,68	0,00	0,00	2.258.064,20	-258.064,48	-10,26%	-10,26%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.743.065,78	0,00	70.172,78	4.982.385,10	-690.507,90	-12,02%	-13,25%
			Total Renda Variável		15.434.353,86	12,59%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	70.006.018,78	51.572.228,17	43.883.834,29	82.657.100,96	4.962.688,30	4,08%	6,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	58.290.910,53	0,00	28.892.291,07	32.638.133,89	3.239.514,43	5,56%	8,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	37.025.835,35	665.236,09	8.182.227,29	32.152.038,24	2.643.194,09	7,01%	7,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.252.618,68	0,00	742.298,89	16.736.162,61	1.225.842,82	7,54%	7,78%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	19.745.017,06	0,00	3.600.000,00	17.345.922,03	1.200.904,97	6,08%	7,59%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	24.731.889,46	0,00	0,00	25.884.925,62	1.153.036,16	4,66%	4,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.095.968,63	0,00	665.236,09	13.532.003,27	1.101.270,73	8,41%	8,65%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.934.575,41	0,00	0,00	15.817.903,28	883.327,87	5,91%	5,91%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.961.030,40	9.000.000,00	8.000.000,00	14.815.337,53	854.307,13	3,89%	6,06%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	9.000.000,00	0,00	9.595.170,21	595.170,21	6,61%	7,53%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.512.492,50	3.473.849,43	0,00	10.398.069,91	411.727,98	4,12%	6,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	15.806.052,73	11.551,25	12.672.924,98	3.374.618,31	229.939,31	1,45%	2,86%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.191.914,50	0,00	0,00	4.336.908,86	144.994,36	3,46%	3,46%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.735.102,15	0,00	1.626.582,83	136.327,52	27.808,20	1,60%	3,63%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.660.411,10	0,00	0,00	2.534.963,18	-125.447,92	-4,72%	-4,72%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2.447.095,64	0,00	0,00	2.255.564,51	-191.531,13	-7,83%	-7,83%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	6.099.133,07	0,00	0,00	5.879.677,65	-219.455,42	-3,60%	-3,60%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.392.016,12	0,00	425.953,68	1.504.281,11	-461.781,33	-19,31%	-37,11%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	7.194.501,00	0,00	0,00	5.105.118,29	-2.089.382,71	-29,04%	-28,30%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.895.247,01	0,00	1.181.001,60	2.353.345,81	-4.360.899,60	-55,23%	-70,19%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
			Total Renda Fixa		11.225.228,45	2,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
MULTINVEST FI AÇÕES	0,00	9.000.000,00	0,00	12.338.276,31	3.338.276,31	37,09%	1,27%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	12.295.775,72	2.295.775,72	22,96%	-
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	11.000.000,00	0,00	13.279.644,53	2.279.644,53	20,72%	7,83%
META VALOR FI AÇÕES	7.086.029,79	13.000.000,00	0,00	21.639.397,17	1.553.367,38	7,73%	4,76%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	10.642.848,84	642.848,84	6,43%	1,23%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	10.938.587,48	0,00	0,00	11.237.325,46	298.737,98	2,73%	-
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.630.734,09	0,00	0,00	6.854.952,86	224.218,77	3,38%	3,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	2.485.832,70	1.238.438,65	0,00	3.840.491,66	116.220,31	3,12%	3,30%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.357.648,04	0,00	7.445.042,68	0,00	87.394,64	1,19%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	7.492.267,22	0,00	2.488.141,64	4.982.385,10	-21.740,48	-0,29%	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.769.974,10	0,00	0,00	7.515.471,54	-254.502,56	-3,28%	-3,47%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.785.619,00	0,00	47.620,50	1.299.470,60	-438.527,90	-24,56%	-27,95%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.578.494,53	0,00	2.118.383,24	0,00	-460.111,29	-17,84%	-3,87%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.529.991,66	1.500.000,00	0,00	10.412.081,55	-617.910,11	-5,60%	-5,60%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.379.914,30	0,00	0,00	7.728.770,78	-651.143,52	-7,77%	-7,77%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.856.847,92	0,00	0,00	10.180.707,48	-676.140,44	-6,23%	-6,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.395.322,19	0,00	2.339.025,02	0,00	-1.056.297,17	-31,11%	-21,23%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5.498.145,63	0,00	4.414.473,25	0,00	-1.083.672,38	-19,71%	-8,47%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.032.535,46	0,00	9.736,61	1.489.844,20	-1.532.954,65	-50,55%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	4.161.289,74	0,00	33.452,33	2.258.064,20	-1.869.773,21	-44,93%	-45,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	12.126.923,18	0,00	9.432.053,82	0,00	-2.694.869,36	-22,22%	-7,00%
			Total Renda Variável		-521.158,59	-0,38%	