

CRÉDITO E MERCADO

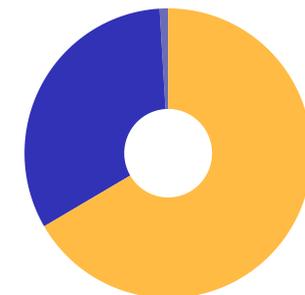
Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|---|------------|------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 4.319.207,13 | 2,29% | 93 | 0,38% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 18.094.399,47 | 9,60% | 685 | 0,36% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 16.065.105,68 | 8,52% | 885 | 0,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 322.176,79 | 0,17% | 1.361 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 16.547.465,44 | 8,78% | 1.005 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID... | D+0 | 15/08/2024 | 3.279.660,69 | 1,74% | 31 | 1,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 4.348.765,37 | 2,31% | 123 | 0,67% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 8.292.597,17 | 4,40% | 976 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 8.975.475,21 | 4,76% | 679 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1 | Não há | 11.199.646,88 | 5,94% | 269 | 0,29% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 5.459.675,86 | 2,90% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L... | D+1 | Não há | 6.495.383,42 | 3,45% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 1.411.429,54 | 0,75% | 297 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 1.373.855,44 | 0,73% | 743 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX... | D+1 | Não há | 5.181.598,45 | 2,75% | 142 | 0,25% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 9.173.847,43 | 4,87% | 196 | 0,64% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BBIF MASTER FIDC LP | Não se ... | 27 meses | 214.582,42 | 0,11% | 13 | 0,93% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | D+1601 | 29 dias | 4.721.771,66 | 2,51% | 33 | 3,03% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' |
| PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 3.027.065,99 | 1,61% | 3.065 | 0,67% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | D+15 | Não há | 4.025.808,11 | 2,14% | 7.090 | 0,33% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução Pró Gestão - Nivel 2 | 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% | 18.847.369,25 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 80.244.852,95 | 42,58% | 15,00% | 36,00% | 76,00% | 62.995.153,33 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 70,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 60,00% | 113.084.215,49 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 50,00% | 40.295.437,02 | 21,38% | 10,00% | 20,00% | 40,00% | 35.094.039,97 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 15,00% | 28.271.053,87 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 10,00% | 4.936.354,08 | 2,62% | 0,00% | 4,00% | 5,00% | 4.487.330,54 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 9.423.684,62 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 9.423.684,62 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 125.476.644,05 | 66,58% | 25,00% | 60,00% | 216,00% | |



RENDA FIXA 125.476.644,05
RENDA VARIÁVEL 61.196.460,17
EXTERIOR 1.800.588,26

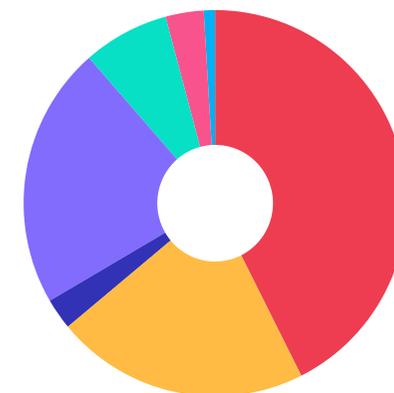
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

| Artigos - Renda Variável | Resolução Pró Gestão - Nivel 2 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2020 | | | GAP Superior |
|------------------------------------|-----------------------------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' | 40,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 18.847.369,25 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 40,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 18.847.369,25 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 30,00% | 41.439.019,70 | 21,99% | 7,00% | 25,00% | 30,00% | 15.103.088,04 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 13.692.579,28 | 7,26% | 7,00% | 8,00% | 10,00% | 5.154.789,97 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00% | 6.064.861,19 | 3,22% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 3.358.823,43 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 9.423.684,62 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 9.423.684,62 |
| Total Renda Variável | 40,00% | 61.196.460,17 | 32,47% | 14,00% | 40,00% | 75,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução Pró Gestão - Nivel 2 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2020 | | | GAP Superior |
|---------------------------|-----------------------------------|---------------------|--------------|--|--------------|---------------|-----------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º - A, Inciso I | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 9.423.684,62 |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 18.847.369,25 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00% | 1.800.588,26 | 0,96% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 7.623.096,36 |
| Total Exterior | 10,00% | 1.800.588,26 | 0,96% | 0,00% | 0,00% | 20,00% | |



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

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 49.232.102,01 | 26,12 | 0,01 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 37.302.650,18 | 19,79 | 0,00 |
| ITAÚ UNIBANCO | 19.185.898,89 | 10,18 | 0,00 |
| BRANCO ASSET MANAGEMENT | 13.522.612,80 | 7,17 | 0,00 |
| INFINITY ASSET MANAGEMENT | 11.955.059,28 | 6,34 | 2,55 |
| BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S... | 9.536.682,62 | 5,06 | 0,00 |
| BANCO J. SAFRA S/A | 7.931.773,36 | 4,21 | 0,00 |
| TRÍGONO CAPITAL | 6.061.350,03 | 3,22 | 0,71 |
| DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT | 5.287.273,92 | 2,81 | 0,10 |
| AURORA CAPITAL | 4.721.771,66 | 2,51 | 2,84 |
| VINCI PARTNERS | 4.117.491,85 | 2,18 | 0,00 |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS | 4.025.808,11 | 2,14 | 0,22 |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT | 3.400.297,73 | 1,80 | 0,01 |
| A5 CAPITAL PARTNERS | 3.256.324,30 | 1,73 | - |
| PERFIN INVESTIMENTOS | 3.027.065,99 | 1,61 | 0,03 |
| FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA | 2.886.410,44 | 1,53 | 0,58 |
| BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO... | 2.808.536,89 | 1,49 | 0,00 |
| BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT... | 214.582,42 | 0,11 | 0,00 |

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 ' | 80.244.852,95 | 42,58 | 15,00 | 76,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 60,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40.295.437,02 | 21,38 | 10,00 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 4.936.354,08 | 2,62 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 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 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 41.439.019,70 | 21,99 | 7,00 | 30,00 |
| Artigo 8º, Inciso III | 13.692.579,28 | 7,26 | 7,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 6.064.861,19 | 3,22 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 9º - A, Inciso I | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 1.800.588,26 | 0,96 | 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 |
|---|--------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark) | 1,97% | 8,49% | 1,71% | 1,77% | 8,49% | 21,39% | - | - |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 1,96% | 8,24% | 1,69% | 1,63% | 8,24% | 20,80% | 0,01% | 0,03% |
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 1,73% | 8,62% | 3,05% | 5,10% | 8,62% | 21,46% | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,65% | 8,03% | 3,05% | 4,76% | 8,03% | 20,12% | 0,01% | 0,03% |
| IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark) | 1,95% | 11,80% | 4,89% | 8,07% | 11,80% | 24,81% | - | - |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | -0,08% | -23,11% | 0,08% | -8,89% | -23,11% | -30,71% | - | 0,03% |
| 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% | 0,00% | 0,01% |
| IMA-B 5 (Benchmark) | 1,83% | 8,04% | 3,38% | 4,72% | 8,04% | 22,25% | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,82% | 7,75% | 3,32% | 4,57% | 7,75% | 21,60% | 0,01% | 0,03% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1,81% | 7,78% | 3,34% | 4,56% | 7,78% | 21,67% | 0,01% | 0,03% |
| IMA-B (Benchmark) | 4,85% | 6,41% | 7,18% | 8,21% | 6,41% | 30,83% | - | - |

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 |
|--|--------|-------|--------|--------|-------|--------|---------|------------------|
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4,84% | 6,14% | 7,14% | 8,03% | 6,14% | 30,17% | 0,02% | 0,11% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 5,53% | 7,24% | 7,48% | 7,97% | 7,24% | 32,38% | 0,03% | 0,11% |
| 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% | - | - |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,10% | 1,64% | 0,22% | 0,40% | 1,64% | 6,54% | 0,00% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 0,09% | 1,90% | 0,26% | 0,55% | 1,90% | 7,07% | 0,00% | 0,00% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP | 0,29% | 4,11% | 0,78% | 1,20% | 4,11% | - | 0,00% | 0,01% |
| IPCA (Benchmark) | 1,35% | 4,52% | 3,13% | 4,42% | 4,52% | 9,02% | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,66% | 8,45% | 3,25% | 4,75% | 8,45% | 24,95% | 0,01% | 0,04% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,20% | 2,86% | 0,39% | 0,58% | 2,86% | 15,12% | 0,00% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1,32% | 6,67% | 2,04% | 1,95% | 6,67% | 24,19% | 0,01% | 0,02% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2,48% | 4,66% | 3,00% | 2,83% | 4,66% | 17,68% | 0,01% | 0,04% |
| Não Possui (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BBIF MASTER FIDC LP | -0,45% | 9,60% | -0,72% | 13,43% | 9,60% | 14,76% | 0,00% | 0,16% |

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% |
| S&P 500 (Benchmark) | 3,71% | 16,26% | 11,69% | 21,15% | 16,26% | 49,83% | - | - |
| SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO | 3,07% | 12,58% | 11,36% | 19,62% | 12,58% | 48,60% | 0,05% | 0,26% |
| IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark) | 2,03% | 12,84% | 5,13% | 8,58% | 12,84% | 27,16% | - | - |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | -0,22% | - | -0,44% | - | - | - | - | 0,01% |
| 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% | 0,06% | 0,43% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 6,65% | 7,83% | 22,30% | 25,58% | 7,83% | 48,57% | 0,06% | 0,39% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 5,23% | 7,88% | 12,39% | 17,68% | 7,88% | 50,20% | 0,07% | 0,43% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 6,28% | -6,23% | 18,58% | 15,16% | -6,23% | 41,49% | 0,07% | 0,41% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 8,55% | 2,60% | 22,63% | 21,85% | 2,60% | 45,60% | 0,07% | 0,41% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | 10,72% | 5,98% | 32,39% | 29,35% | 5,98% | 49,89% | 0,08% | 0,40% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 6,30% | -4,87% | 19,94% | 22,34% | -4,87% | 38,19% | 0,06% | 0,42% |
| TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 11,32% | - | 22,82% | 22,75% | - | - | 0,07% | - |
| CDI (Benchmark) | 0,16% | 2,76% | 0,47% | 0,99% | 2,76% | 8,88% | - | - |

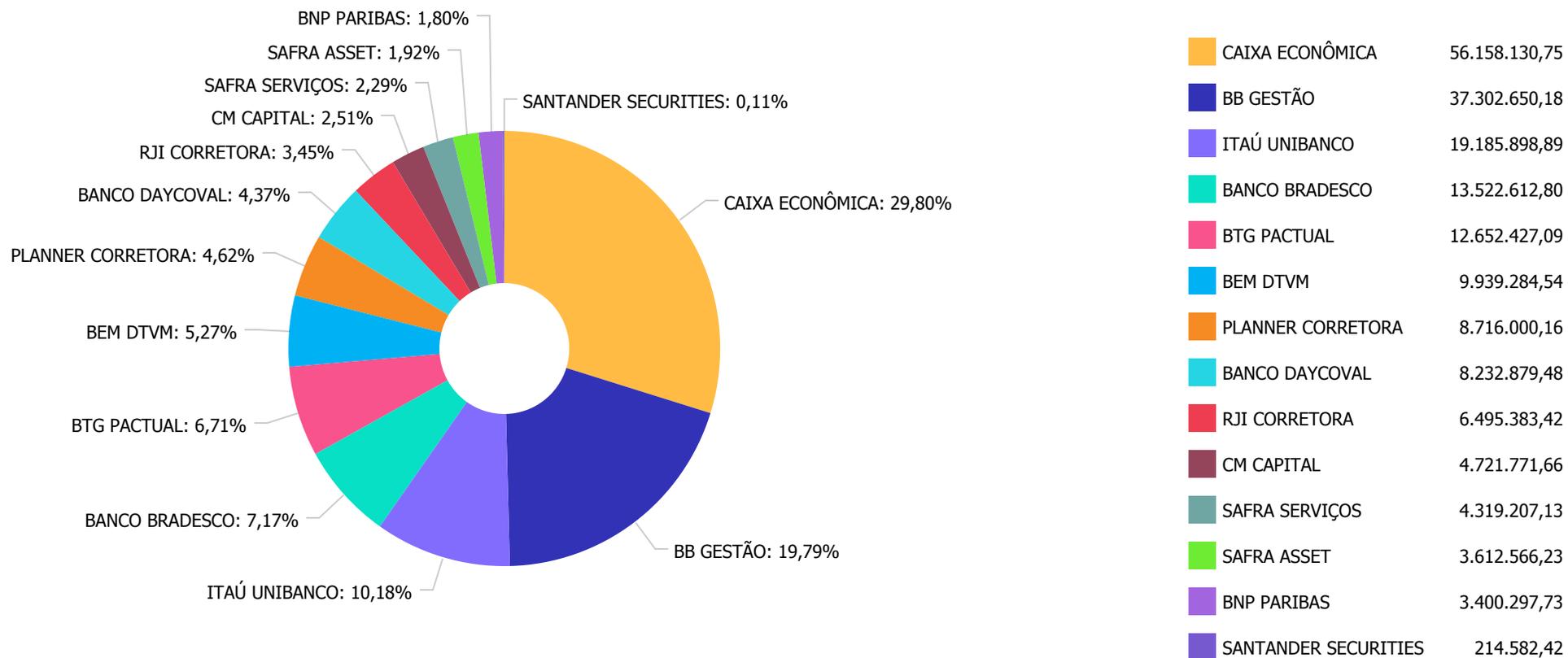
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO | 0,05% | 3,42% | 0,07% | 0,48% | 3,42% | 11,59% | 0,00% | 0,01% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 1,70% | 3,52% | 4,23% | 4,60% | 3,52% | 22,23% | 0,01% | 0,08% |
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES | 9,08% | 2,38% | 21,02% | 21,77% | 2,38% | 54,11% | 0,06% | 0,42% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES | 10,33% | 16,49% | 28,41% | 34,71% | 16,49% | 75,73% | 0,04% | 0,40% |
| Não definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 10,42% | 14,03% | 28,14% | 32,00% | 14,03% | 67,13% | 0,08% | 0,46% |

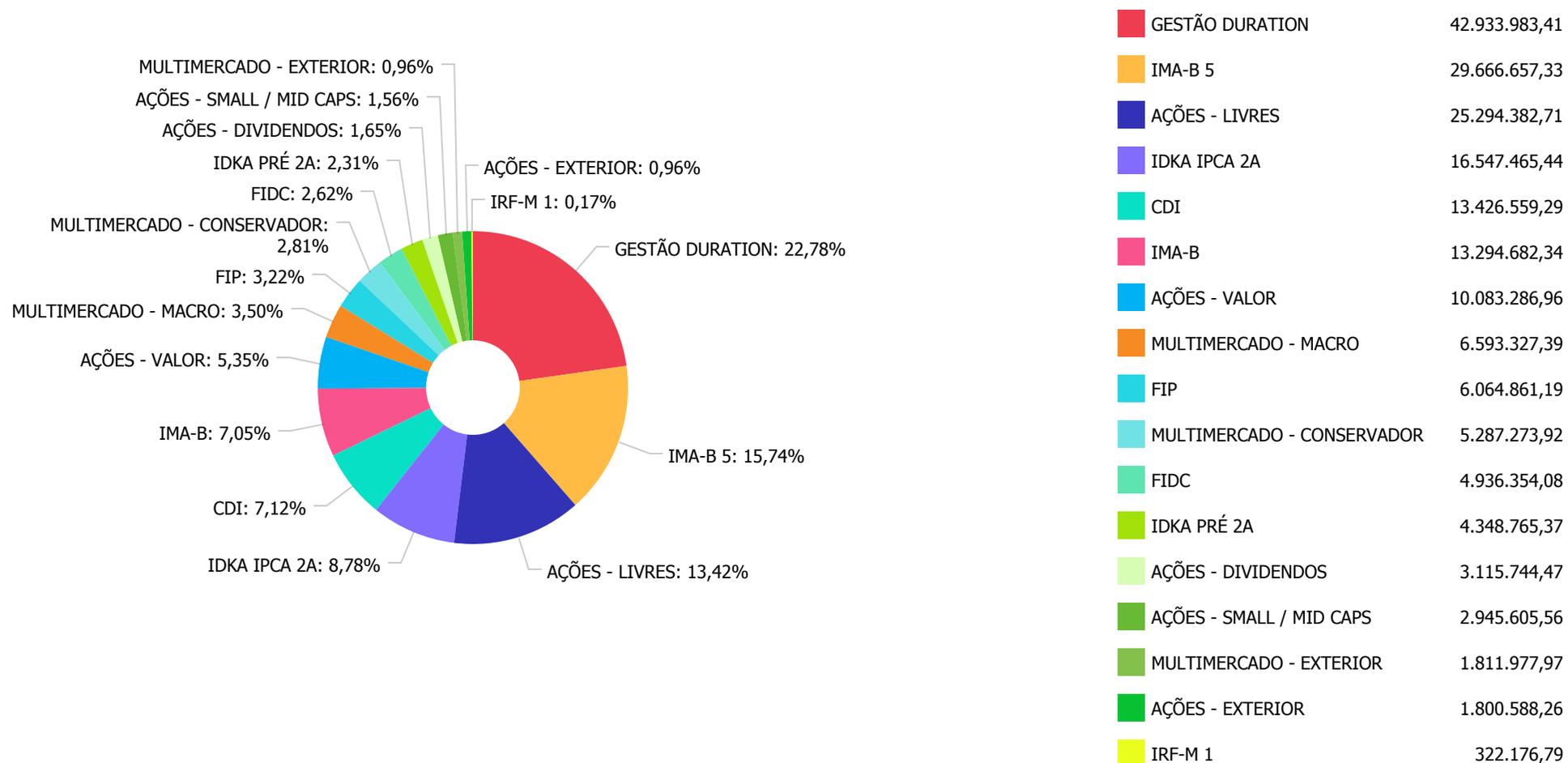
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|--------|-------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| Global BDRX (Benchmark) | 0,93% | 54,01% | 1,70% | 16,29% | 54,01% | 108,94% | - | - |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 0,35% | 44,45% | 1,33% | 16,88% | 44,45% | 98,40% | 0,08% | 0,24% |

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



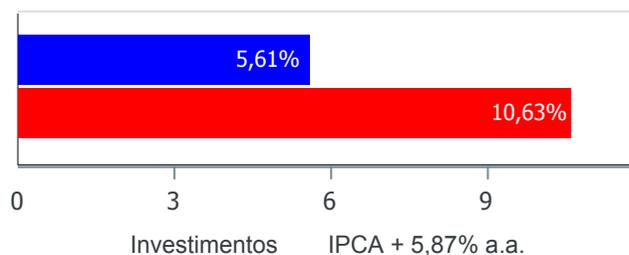
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



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 | 168.063.014,95 | 10.523.656,72 | 7.824.494,51 | 171.695.160,54 | 932.983,38 | 932.983,38 | 0,55% | 0,55% | 0,71% | 0,71% | 76,92% | 2,67% |
| Fevereiro | 171.695.160,54 | 6.072.870,73 | 4.082.600,70 | 171.902.257,18 | -1.783.173,39 | -850.190,01 | -1,03% | -0,49% | 0,66% | 1,37% | -35,36% | 4,00% |
| Março | 171.902.257,18 | 2.888.077,90 | 2.551.605,84 | 159.778.288,70 | -12.460.440,54 | -13.310.630,55 | -7,23% | -7,69% | 0,57% | 1,95% | -393,78% | 15,29% |
| Abril | 159.778.288,70 | 1.501.897,76 | 1.966.560,19 | 163.111.424,62 | 3.797.798,35 | -9.512.832,20 | 2,38% | -5,49% | 0,14% | 2,10% | -261,88% | 7,18% |
| Mai | 163.111.424,62 | 28.923.727,91 | 29.692.505,52 | 166.276.442,37 | 3.933.795,36 | -5.579.036,84 | 2,41% | -3,21% | 0,07% | 2,17% | -147,98% | 4,07% |
| Junho | 166.276.442,37 | 2.201.489,30 | 2.009.427,85 | 170.153.841,18 | 3.685.337,36 | -1.893.699,48 | 2,21% | -1,07% | 0,74% | 2,92% | -36,56% | 3,31% |
| Julho | 170.153.841,18 | 6.250.386,86 | 4.388.633,74 | 176.466.672,02 | 4.451.077,72 | 2.557.378,24 | 2,59% | 1,49% | 0,88% | 3,83% | 38,89% | 3,07% |
| Agosto | 176.466.672,02 | 7.642.715,60 | 6.857.615,80 | 176.577.511,68 | -674.260,14 | 1.883.118,10 | -0,38% | 1,10% | 0,72% | 4,58% | 24,13% | 2,64% |
| Setembro | 176.577.511,68 | 9.825.291,85 | 9.467.688,37 | 174.069.697,78 | -2.865.417,38 | -982.299,28 | -1,62% | -0,53% | 1,12% | 5,75% | -9,26% | 4,21% |
| Outubro | 174.069.697,78 | 10.971.423,76 | 8.710.757,57 | 175.934.690,07 | -395.673,90 | -1.377.973,18 | -0,22% | -0,76% | 1,34% | 7,17% | -10,54% | 3,19% |
| Novembro | 175.934.690,07 | 5.474.950,90 | 3.320.286,68 | 183.422.551,94 | 5.333.197,65 | 3.955.224,47 | 2,99% | 2,22% | 1,35% | 8,61% | 25,74% | 3,07% |
| Dezembro | 183.422.551,94 | 12.220.649,17 | 13.258.506,21 | 188.473.692,48 | 6.088.997,58 | 10.044.222,05 | 3,32% | 5,61% | 1,86% | 10,63% | 52,79% | 2,31% |

Investimentos x Meta Atuarial



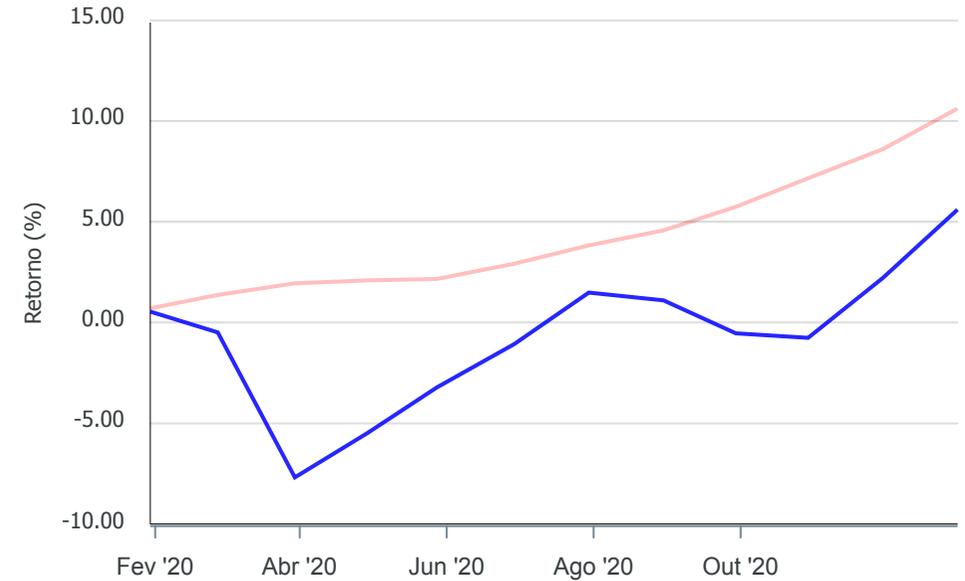
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 | 5.007.886,09 | 0,00 | 0,00 | 5.459.675,86 | 451.789,77 | 9,02% | - | - |
| INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP | 6.000.744,49 | 0,00 | 0,00 | 6.495.383,42 | 494.638,93 | 8,24% | - | - |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 4.092.781,82 | 0,00 | 0,00 | 4.319.207,13 | 226.425,31 | 5,53% | 5,53% | 2,50% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 8.561.457,46 | 0,00 | 0,00 | 8.975.475,21 | 414.017,75 | 4,84% | 4,84% | 2,03% |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | 4.549.492,41 | 0,00 | 0,00 | 4.721.771,66 | 172.279,25 | 3,79% | - | - |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 8.951.862,83 | 0,00 | 0,00 | 9.173.847,43 | 221.984,60 | 2,48% | 2,48% | 1,14% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 17.773.256,51 | 0,00 | 0,00 | 18.094.399,47 | 321.142,96 | 1,81% | 1,81% | 0,75% |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 7.222.536,13 | 0,00 | 3.000.000,00 | 4.348.765,37 | 126.229,24 | 1,75% | 1,96% | 1,19% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN... | 3.226.196,09 | 0,00 | 0,00 | 3.279.660,69 | 53.464,60 | 1,66% | 1,66% | 0,78% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 10.478.685,43 | 0,00 | 2.353.867,43 | 8.292.597,17 | 167.779,17 | 1,60% | 1,82% | 0,74% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 16.084.803,46 | 2.002.448,90 | 1.800.000,00 | 16.547.465,44 | 260.213,08 | 1,44% | 1,65% | 0,71% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 15.855.705,24 | 0,00 | 0,00 | 16.065.105,68 | 209.400,44 | 1,32% | 1,32% | 0,55% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 5.166.647,80 | 0,00 | 0,00 | 5.181.598,45 | 14.950,65 | 0,29% | 0,29% | 0,15% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 321.262,05 | 0,00 | 0,00 | 322.176,79 | 914,74 | 0,28% | 0,28% | 0,10% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 11.177.051,37 | 0,00 | 0,00 | 11.199.646,88 | 22.595,51 | 0,20% | 0,20% | 0,02% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 32.827,81 | 1.383.734,17 | 42.856,56 | 1.373.855,44 | 150,02 | 0,01% | 0,10% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 296.174,84 | 3.334.466,10 | 2.219.465,23 | 1.411.429,54 | 253,83 | 0,01% | 0,09% | 0,00% |
| BBIF MASTER FIDC LP | 215.541,40 | 0,00 | 0,00 | 214.582,42 | -958,98 | -0,44% | -0,44% | 0,00% |
| Total Renda Fixa | 125.014.913,23 | 6.720.649,17 | 9.416.189,22 | 125.476.644,05 | 3.157.270,87 | 2,40% | | 0,81% |

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 |
|--|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 2.646.085,12 | 0,00 | 0,00 | 2.945.605,56 | 299.520,44 | 11,32% | 11,32% | 6,80% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | 2.781.263,66 | 0,00 | 0,00 | 3.079.384,67 | 298.121,01 | 10,72% | 10,72% | 7,54% |
| CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES | 3.774.816,48 | 0,00 | 0,00 | 4.117.491,85 | 342.675,37 | 9,08% | 9,08% | 5,56% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 3.132.350,20 | 0,00 | 0,00 | 3.400.297,73 | 267.947,53 | 8,55% | 8,55% | 6,52% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 2.706.369,17 | 0,00 | 0,00 | 2.886.410,44 | 180.041,27 | 6,65% | 6,65% | 5,91% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 2.638.548,01 | 0,00 | 0,00 | 2.804.653,56 | 166.105,55 | 6,30% | 6,30% | 6,12% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 3.787.789,56 | 0,00 | 0,00 | 4.025.808,11 | 238.018,55 | 6,28% | 6,28% | 6,52% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 9.062.319,05 | 0,00 | 0,00 | 9.536.682,62 | 474.363,57 | 5,23% | 5,23% | 6,81% |
| W7 MULTIESTRATÉGIA FIP | 3.110.068,14 | 0,00 | 0,00 | 3.256.324,30 | 146.256,16 | 4,70% | - | - |
| PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 2.893.821,27 | 0,00 | 0,00 | 3.027.065,99 | 133.244,72 | 4,60% | 4,60% | 5,70% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES | 0,00 | 3.000.000,00 | 0,00 | 3.115.744,47 | 115.744,47 | 3,86% | 10,33% | 4,31% |
| SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO | 1.758.040,96 | 0,00 | 0,00 | 1.811.977,97 | 53.937,01 | 3,07% | 3,07% | 4,55% |
| HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 3.739.247,89 | 0,00 | 3.842.316,99 | 0,00 | 103.069,10 | 2,76% | 7,00% | 5,51% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 6.483.076,94 | 0,00 | 0,00 | 6.593.327,39 | 110.250,45 | 1,70% | 1,70% | 0,93% |
| DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO | 5.284.751,47 | 0,00 | 0,00 | 5.287.273,92 | 2.522,45 | 0,05% | 0,05% | 0,38% |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 0,00 | 2.500.000,00 | 0,00 | 2.499.874,70 | -125,30 | -0,01% | 10,42% | 7,54% |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | 2.814.727,21 | 0,00 | 0,00 | 2.808.536,89 | -6.190,32 | -0,22% | - | - |
| Total Renda Variável | 56.613.275,13 | 5.500.000,00 | 3.842.316,99 | 61.196.460,17 | 2.925.502,03 | 5,02% | | 5,07% |

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA - IMP
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-----------------|--------------|------------|--------------|
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1.794.363,58 | 0,00 | 0,00 | 1.800.588,26 | 6.224,68 | 0,35% | 0,35% | 8,10% |
| Total Exterior | 1.794.363,58 | 0,00 | 0,00 | 1.800.588,26 | 6.224,68 | 0,35% | | 8,10% |

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 |
|---|----------------|--------------|--------------|-------------------------|---------------------|--------------|------------|
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 8.377.745,87 | 0,00 | 0,00 | 8.975.475,21 | 597.729,34 | 7,13% | 7,13% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 20.018.815,03 | 84.000,00 | 2.604.000,00 | 18.094.399,47 | 595.584,44 | 2,96% | 3,34% |
| INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP | 5.962.712,50 | 0,00 | 0,00 | 6.495.383,42 | 532.670,92 | 8,93% | 8,93% |
| INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP | 4.942.203,33 | 0,00 | 0,00 | 5.459.675,86 | 517.472,53 | 10,47% | 10,47% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 10.561.279,62 | 8.035.017,57 | 2.500.000,00 | 16.547.465,44 | 451.168,25 | 2,43% | 3,05% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 15.743.722,30 | 0,00 | 0,00 | 16.065.105,68 | 321.383,38 | 2,04% | 2,04% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 10.467.316,21 | 1.690.131,52 | 4.185.828,57 | 8.292.597,17 | 320.978,01 | 2,64% | 3,32% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 4.018.529,54 | 0,00 | 0,00 | 4.319.207,13 | 300.677,59 | 7,48% | 7,48% |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 8.907.051,06 | 0,00 | 0,00 | 9.173.847,43 | 266.796,37 | 3,00% | 3,00% |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | 4.542.059,39 | 0,00 | 0,00 | 4.721.771,66 | 179.712,27 | 3,96% | 0,08% |
| BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 7.241.862,00 | 0,00 | 3.000.000,00 | 4.348.765,37 | 106.903,37 | 1,48% | 1,69% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN... | 3.176.340,28 | 0,00 | 0,00 | 3.279.660,69 | 103.320,41 | 3,25% | 3,25% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 11.156.716,79 | 0,00 | 0,00 | 11.199.646,88 | 42.930,09 | 0,38% | 0,38% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 5.141.748,54 | 0,00 | 0,00 | 5.181.598,45 | 39.849,91 | 0,78% | 0,78% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.320.339,96 | 0,00 | 1.000.000,00 | 322.176,79 | 1.836,83 | 0,14% | 0,64% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 66.577,75 | 9.417.182,07 | 8.072.981,91 | 1.411.429,54 | 651,63 | 0,01% | 0,26% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 17.429,46 | 1.440.692,67 | 84.422,99 | 1.373.855,44 | 156,30 | 0,01% | 0,22% |
| BBIF MASTER FIDC LP | 216.147,96 | 0,00 | 0,00 | 214.582,42 | -1.565,54 | -0,72% | -0,72% |
| | | | | Total Renda Fixa | 4.378.256,10 | 3,07% | |

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 |
|--|----------------|--------------|--------------|--------------|---------------------|---------------|------------|
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 8.485.391,97 | 0,00 | 0,00 | 9.536.682,62 | 1.051.290,65 | 12,39% | 12,39% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | 2.325.922,09 | 0,00 | 0,00 | 3.079.384,67 | 753.462,58 | 32,39% | 32,39% |
| CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES | 3.402.351,61 | 0,00 | 0,00 | 4.117.491,85 | 715.140,24 | 21,02% | 21,02% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 3.394.966,02 | 0,00 | 0,00 | 4.025.808,11 | 630.842,09 | 18,58% | 18,58% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 2.772.764,67 | 0,00 | 0,00 | 3.400.297,73 | 627.533,06 | 22,63% | 22,63% |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 2.360.182,68 | 0,00 | 0,00 | 2.886.410,44 | 526.227,76 | 22,30% | 22,30% |
| HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 3.318.278,34 | 0,00 | 3.842.316,99 | 0,00 | 524.038,65 | 15,79% | 20,57% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 2.338.371,88 | 0,00 | 0,00 | 2.804.653,56 | 466.281,68 | 19,94% | 19,94% |
| TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 0,00 | 2.500.000,00 | 0,00 | 2.945.605,56 | 445.605,56 | 17,82% | 22,82% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 6.325.515,72 | 0,00 | 0,00 | 6.593.327,39 | 267.811,67 | 4,23% | 4,23% |
| PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 2.838.117,09 | 0,00 | 0,00 | 3.027.065,99 | 188.948,90 | 6,66% | 6,66% |
| SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO | 1.627.107,84 | 0,00 | 0,00 | 1.811.977,97 | 184.870,13 | 11,36% | 11,36% |
| W7 MULTIESTRATÉGIA FIP | 3.120.817,91 | 0,00 | 0,00 | 3.256.324,30 | 135.506,39 | 4,34% | -0,33% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES | 0,00 | 3.000.000,00 | 0,00 | 3.115.744,47 | 115.744,47 | 3,86% | 28,41% |
| DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO | 5.283.465,18 | 0,00 | 0,00 | 5.287.273,92 | 3.808,74 | 0,07% | 0,07% |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 0,00 | 2.500.000,00 | 0,00 | 2.499.874,70 | -125,30 | -0,01% | 28,14% |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | 2.820.888,97 | 0,00 | 0,00 | 2.808.536,89 | -12.352,08 | -0,44% | -0,44% |
| Total Renda Variável | | | | | 6.624.635,19 | 12,14% | |

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|------------|----------|-----------------------|------------------|--------------|------------|
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1.776.958,22 | 0,00 | 0,00 | 1.800.588,26 | 23.630,04 | 1,33% | 1,33% |
| | | | | Total Exterior | 23.630,04 | 1,33% | |

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 |
|---|----------------|---------------|---------------|-------------------------|---------------------|--------------|------------|
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 16.881.941,76 | 2.561.067,62 | 2.768.000,00 | 18.094.399,47 | 1.419.390,09 | 7,30% | 7,78% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 15.061.332,94 | 0,00 | 0,00 | 16.065.105,68 | 1.003.772,74 | 6,66% | 6,66% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 12.834.058,65 | 2.716.142,35 | 8.048.732,22 | 8.292.597,17 | 791.128,39 | 5,09% | 7,75% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.977.249,79 | 28.129.667,90 | 14.283.905,45 | 16.547.465,44 | 724.453,20 | 2,41% | 8,03% |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 6.803.210,87 | 0,00 | 3.000.000,00 | 4.348.765,37 | 545.554,50 | 8,02% | 8,24% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 8.456.231,76 | 0,00 | 0,00 | 8.975.475,21 | 519.243,45 | 6,14% | 6,14% |
| INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP | 11.634.616,18 | 0,00 | 6.600.000,00 | 5.459.675,86 | 425.059,68 | 3,65% | 7,59% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 8.765.201,17 | 0,00 | 0,00 | 9.173.847,43 | 408.646,26 | 4,66% | 4,66% |
| INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP | 6.106.959,08 | 0,00 | 0,00 | 6.495.383,42 | 388.424,34 | 6,36% | 6,36% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 10.888.054,05 | 0,00 | 0,00 | 11.199.646,88 | 311.592,83 | 2,86% | 2,86% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 4.027.490,15 | 0,00 | 0,00 | 4.319.207,13 | 291.716,98 | 7,24% | 7,24% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN... | 3.176.509,48 | 0,00 | 157.067,62 | 3.279.660,69 | 260.218,83 | 8,19% | 8,45% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ... | 0,00 | 5.100.547,39 | 0,00 | 5.181.598,45 | 81.051,06 | 1,59% | 4,11% |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1 | 5.912.113,91 | 0,00 | 1.254.430,96 | 4.721.771,66 | 64.088,71 | 1,08% | -23,11% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 0,00 | 2.325.000,00 | 2.031.000,00 | 322.176,79 | 28.176,79 | 1,21% | 3,63% |
| BBIF MASTER FIDC LP | 195.784,39 | 0,00 | 0,00 | 214.582,42 | 18.798,03 | 9,60% | 9,60% |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA | 1.039.168,41 | 28.159.335,64 | 27.790.691,09 | 1.411.429,54 | 3.616,58 | 0,01% | 1,90% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.334.593,56 | 8.626.152,22 | 9.588.140,44 | 1.373.855,44 | 1.250,10 | 0,01% | 1,64% |
| ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES | 0,00 | 5.100.000,00 | 5.100.547,39 | 0,00 | 547,39 | 0,01% | 2,48% |
| | | | | Total Renda Fixa | 7.286.729,95 | 6,17% | |

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 |
|--|----------------|--------------|--------------|-----------------------------|---------------------|--------------|------------|
| CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES | 0,00 | 3.000.000,00 | 0,00 | 4.117.491,85 | 1.117.491,85 | 37,25% | 2,38% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 8.840.371,56 | 0,00 | 0,00 | 9.536.682,62 | 696.311,06 | 7,88% | 7,88% |
| TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 0,00 | 2.500.000,00 | 0,00 | 2.945.605,56 | 445.605,56 | 17,82% | - |
| FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES | 0,00 | 2.500.000,00 | 0,00 | 2.886.410,44 | 386.410,44 | 15,46% | 7,83% |
| SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO | 0,00 | 1.500.000,00 | 0,00 | 1.811.977,97 | 311.977,97 | 20,80% | 12,58% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 6.369.386,16 | 0,00 | 0,00 | 6.593.327,39 | 223.941,23 | 3,52% | 3,52% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES | 2.905.623,45 | 0,00 | 0,00 | 3.079.384,67 | 173.761,22 | 5,98% | 5,98% |
| TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES | 0,00 | 3.000.000,00 | 0,00 | 3.115.744,47 | 115.744,47 | 3,86% | 16,49% |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP | 3.169.756,75 | 0,00 | 0,00 | 3.256.324,30 | 86.567,55 | 2,73% | - |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 3.314.019,31 | 0,00 | 0,00 | 3.400.297,73 | 86.278,42 | 2,60% | 2,60% |
| HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 3.761.082,61 | 0,00 | 3.842.316,99 | 0,00 | 81.234,38 | 2,16% | 6,38% |
| INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO | 6.683.142,98 | 0,00 | 6.736.321,69 | 0,00 | 53.178,71 | 0,80% | - |
| DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO | 0,00 | 5.236.321,69 | 0,00 | 5.287.273,92 | 50.952,23 | 0,97% | 3,42% |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 0,00 | 2.500.000,00 | 0,00 | 2.499.874,70 | -125,30 | -0,01% | 14,03% |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | 2.825.466,54 | 42.903,65 | 0,00 | 2.808.536,89 | -59.833,30 | -2,09% | - |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 2.948.345,35 | 0,00 | 0,00 | 2.804.653,56 | -143.691,79 | -4,87% | -4,87% |
| PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 3.282.094,17 | 0,00 | 0,00 | 3.027.065,99 | -255.028,18 | -7,77% | -7,77% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES | 4.293.177,71 | 0,00 | 0,00 | 4.025.808,11 | -267.369,60 | -6,23% | -6,23% |
| FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES | 3.576.032,21 | 0,00 | 2.929.529,13 | 0,00 | -646.503,08 | -18,08% | -6,08% |
| | | | | Total Renda Variável | 2.456.903,84 | 4,18% | |

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|--------------|----------|-----------------------|-------------------|---------------|------------|
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 0,00 | 1.500.000,00 | 0,00 | 1.800.588,26 | 300.588,26 | 20,04% | 44,45% |
| | | | | Total Exterior | 300.588,26 | 20,04% | |