

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

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

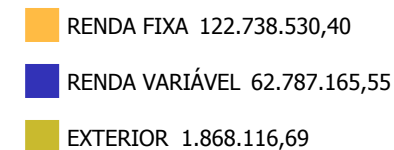
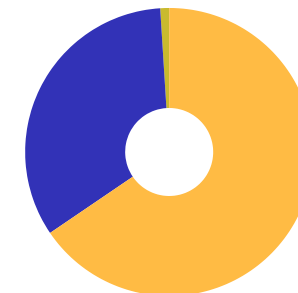
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	16.069.168,72	8,58%	892	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.897.949,24	4,75%	677	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.246.024,85	2,27%	91	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	322.258,05	0,17%	1.348	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	17.333.196,39	9,25%	1.004	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.284.063,57	1,75%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.109.529,74	1,66%	122	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	8.270.453,90	4,41%	977	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	18.111.851,93	9,67%	689	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.214.646,98	5,98%	264	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.175.614,75	2,76%	143	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.120.705,69	4,87%	196	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	6.500.625,82	3,47%	81	6,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	534.542,27	0,29%	299	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	86.755,66	0,05%	763	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.489.991,89	2,93%	53	5,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	248.166,67	0,13%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.722.984,28	2,52%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	2.787.040,65	1,49%	165	2,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.763.593,43	1,47%	41.775	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.988.185,77	2,13%	121	0,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.907.358,79	1,55%	2.222	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.917.524,44	1,56%	2.993	0,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	9.477.976,85	5,06%	6.283	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.866.882,91	2,06%	6.805	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.289.914,10	1,76%	1.385	1,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.375.659,01	1,27%	18.040	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.002.211,03	1,60%	6	0,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.171.267,05	1,69%	2.702	6,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.500.000,00	1,33%	4.187	1,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.286.378,49	2,82%	1.508	2,28%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.587.504,11	3,52%	18.477	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.808.794,03	0,97%	115	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.804.298,68	1,50%	15	3,28%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.252.576,21	1,74%	28	2,35%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.868.116,69	1,00%	733	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>187.393.812,64</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.739.381,26
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	79.644.496,39	42,50%	15,00%	36,00%	76,00%	62.774.801,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	112.436.287,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	38.122.883,06	20,34%	5,00%	20,00%	40,00%	36.834.642,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	4.971.150,95	2,65%	0,00%	4,00%	10,00%	13.768.230,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.369.690,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.369.690,63
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>122.738.530,40</b>	<b>65,50%</b>	<b>20,00%</b>	<b>60,00%</b>	<b>206,00%</b>	



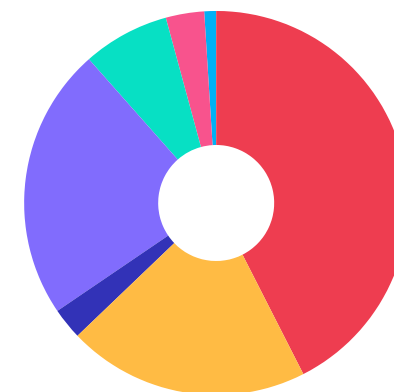
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.739.381,26
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.739.381,26
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30,00%	43.047.614,03	22,97%	7,00%	27,00%	30,00%	13.170.529,76
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.682.676,63	7,30%	5,00%	8,00%	10,00%	5.056.704,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	6.056.874,89	3,23%	0,00%	5,00%	5,00%	3.312.815,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.369.690,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.369.690,63
<b>Total Renda Variável</b>	<b>40,00%</b>	<b>62.787.165,55</b>	<b>33,51%</b>	<b>12,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>75,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.369.690,63
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.739.381,26
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.868.116,69	1,00%	0,00%	0,00%	10,00%	16.871.264,57
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.868.116,69</b>	<b>1,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>25,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	49.117.123,44	26,21	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.163.638,20	20,37	0,00
ITAÚ UNIBANCO	19.153.855,16	10,22	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	12.230.235,43	6,53	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	11.990.617,71	6,40	2,64
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	9.477.976,85	5,06	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	7.922.935,57	4,23	0,00
TRÍGONO CAPITAL	6.173.478,08	3,29	0,68
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.286.378,49	2,82	0,11
AURORA CAPITAL	4.722.984,28	2,52	2,67
VINCI PARTNERS	3.988.185,77	2,13	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.866.882,91	2,06	0,22
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.289.914,10	1,76	0,01
KPTL	3.252.576,21	1,74	-
PERFIN INVESTIMENTOS	2.917.524,44	1,56	0,03
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.804.298,68	1,50	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.787.040,65	1,49	0,56
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	248.166,67	0,13	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		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 '	79.644.496,39	42,50	15,00	76,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	38.122.883,06	20,34	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.971.150,95	2,65	0,00	10,00
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 '	43.047.614,03	22,97	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	13.682.676,63	7,30	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.056.874,89	3,23	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	1.868.116,69	1,00	0,00	10,00

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
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	-0,87%	-0,87%	1,55%	0,00%	6,54%	18,79%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,85%	-0,85%	1,58%	-0,12%	6,32%	18,27%	0,02%	0,03%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,13%	3,03%	4,04%	7,68%	18,78%	0,01%	0,03%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,79%	0,79%	4,23%	7,86%	11,79%	24,66%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3,90%	3,90%	3,88%	3,74%	-15,81%	-26,90%	-	0,05%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-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%	0,02%	0,13%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	3,22%	3,64%	7,25%	19,86%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	0,01%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,86%	-0,86%	6,00%	2,62%	4,95%	23,66%	0,03%	0,11%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-1,69%	-1,69%	5,96%	1,30%	5,09%	23,95%	0,03%	0,12%
<b>CDI (Benchmark)</b>	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%	0,02%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,08%	0,24%	0,37%	1,43%	6,15%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	0,25%	0,52%	1,68%	6,66%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	-0,12%	-0,12%	0,39%	0,69%	3,66%	-	0,00%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	0,13%	3,12%	3,73%	7,85%	22,55%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,13%	0,13%	0,44%	0,16%	2,65%	12,60%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,01%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,58%	-0,58%	2,68%	0,52%	3,61%	14,74%	0,01%	0,04%
<b>Não Possui (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	15,65%	15,65%	15,34%	13,61%	27,42%	33,43%	0,27%	0,22%



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
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,05%	1,05%	5,06%	9,60%	15,40%	32,92%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3,17%	3,17%	3,01%	-	-	-	-	0,03%
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-1,11%	-1,11%	13,59%	13,55%	15,15%	37,36%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-0,18%	-0,18%	13,78%	13,09%	11,97%	37,88%	0,08%	0,26%
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,86%	0,86%	4,47%	8,36%	12,82%	26,99%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,15%	-0,15%	-0,55%	-	-	-	-	0,00%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-5,08%	-5,08%	18,30%	8,08%	-4,52%	21,27%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-3,68%	-3,68%	17,64%	13,93%	-5,49%	31,06%	0,10%	0,41%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-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%	0,11%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-3,44%	-3,44%	17,28%	11,02%	7,31%	30,05%	0,10%	0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,62%	-0,62%	13,66%	7,92%	5,08%	38,70%	0,13%	0,43%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,95%	-3,95%	15,85%	1,99%	-11,45%	21,54%	0,10%	0,41%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-3,25%	-3,25%	20,20%	9,42%	0,04%	22,84%	0,11%	0,41%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,59%	-5,59%	22,28%	14,81%	1,52%	22,76%	0,12%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,46%	-1,46%	17,60%	12,10%	-6,09%	23,46%	0,11%	0,43%

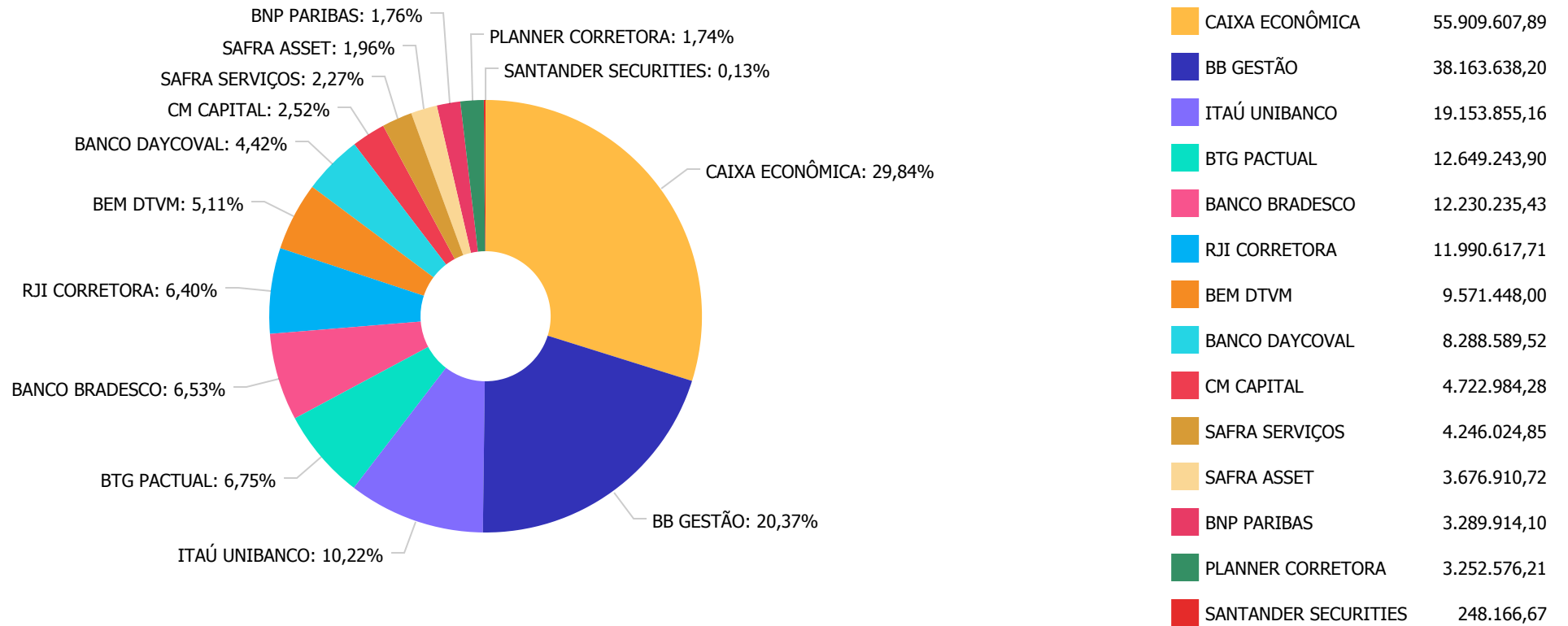
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,92%	1,92%	25,12%	20,55%	-	-	0,09%	-
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	-0,02%	-0,02%	0,46%	-0,02%	2,82%	10,68%	0,01%	0,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,09%	-0,09%	4,50%	3,05%	2,72%	17,79%	0,02%	0,08%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,14%	-3,14%	19,35%	8,34%	-2,73%	31,72%	0,12%	0,42%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	1,78%	1,78%	25,97%	35,47%	10,81%	70,41%	0,08%	0,40%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,97%	-4,97%	22,58%	14,24%	5,75%	36,55%	0,12%	0,47%

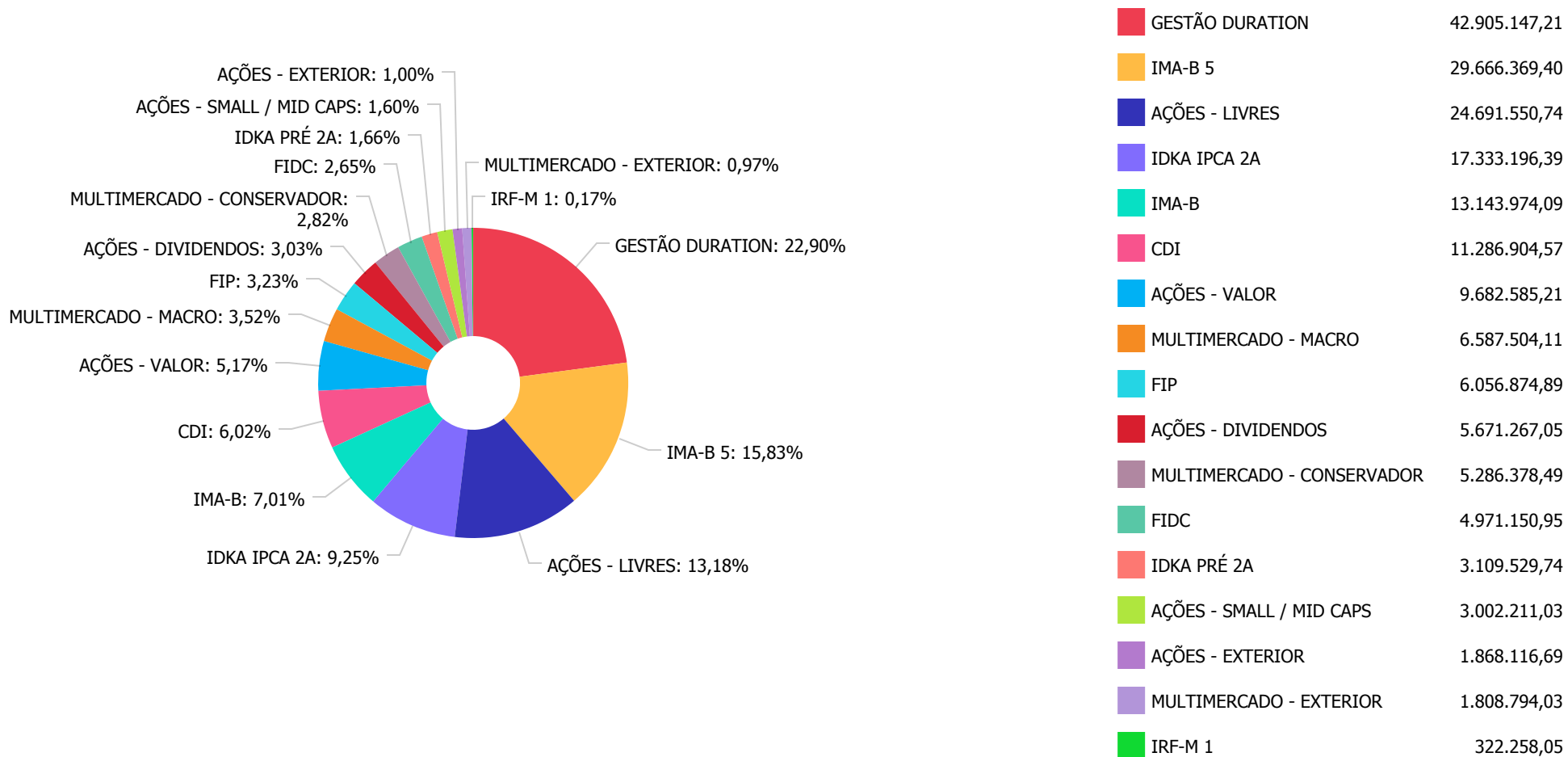
## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,11%	6,11%	9,83%	21,25%	53,50%	120,12%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,75%	3,75%	6,65%	18,86%	40,11%	102,40%	0,13%	0,23%

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



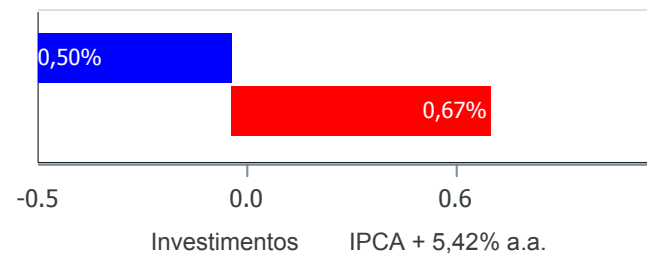
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	188.473.692,48	5.654.725,25	5.789.001,22	187.393.812,64	-945.603,87	-945.603,87	-0,50%	-0,50%	0,67%	0,67%	-74,79%	3,86%

Investimentos x Meta Atuarial



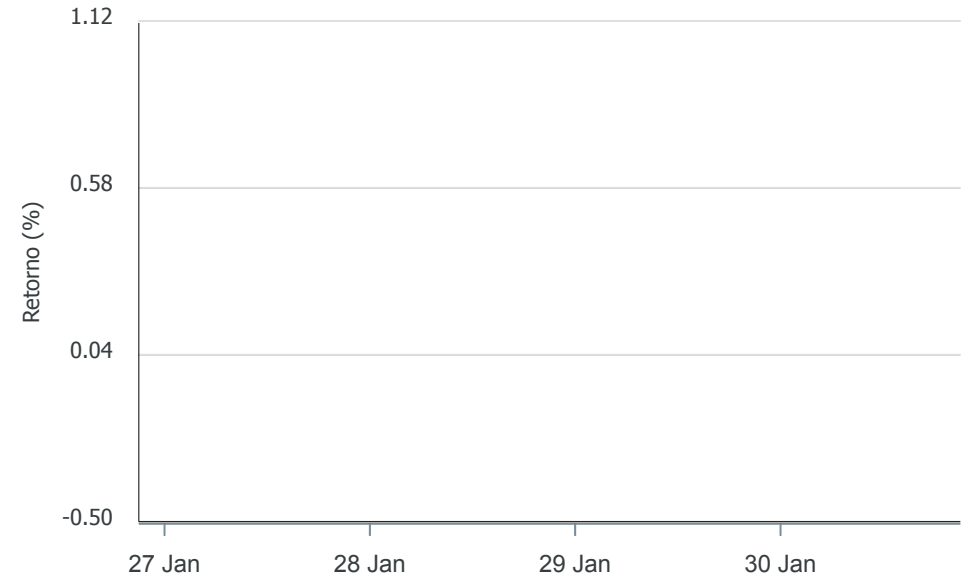
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BBIF MASTER FIDC LP	214.582,42	0,00	0,00	248.166,67	33.584,25	15,65%	15,65%	27,29%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	5.459.675,86	0,00	0,00	5.489.991,89	30.316,03	0,56%	0,56%	1,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.547.465,44	800.000,00	39.581,48	17.333.196,39	25.312,43	0,15%	0,13%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.279.660,69	0,00	0,00	3.284.063,57	4.402,88	0,13%	0,13%	0,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.199.646,88	0,00	0,00	11.214.646,98	15.000,10	0,13%	0,13%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.094.399,47	0,00	0,00	18.111.851,93	17.452,46	0,10%	0,10%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.292.597,17	0,00	29.000,00	8.270.453,90	6.856,73	0,08%	0,08%	1,04%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.495.383,42	0,00	0,00	6.500.625,82	5.242,40	0,08%	0,08%	2,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.373.855,44	1.203.958,30	2.492.186,42	86.755,66	1.128,34	0,04%	0,08%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.721.771,66	0,00	0,00	4.722.984,28	1.212,62	0,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.065.105,68	0,00	0,00	16.069.168,72	4.063,04	0,03%	0,03%	0,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	322.176,79	0,00	0,00	322.258,05	81,26	0,03%	0,03%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.411.429,54	1.150.766,95	2.028.233,32	534.542,27	579,10	0,02%	0,08%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.181.598,45	0,00	0,00	5.175.614,75	-5.983,70	-0,12%	-0,12%	0,28%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.173.847,43	0,00	0,00	9.120.705,69	-53.141,74	-0,58%	-0,58%	1,40%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.975.475,21	0,00	0,00	8.897.949,24	-77.525,97	-0,86%	-0,86%	2,59%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	4.348.765,37	0,00	1.200.000,00	3.109.529,74	-39.235,63	-0,90%	-0,84%	1,65%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.319.207,13	0,00	0,00	4.246.024,85	-73.182,28	-1,69%	-1,69%	3,11%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>125.476.644,05</b>	<b>3.154.725,25</b>	<b>5.789.001,22</b>	<b>122.738.530,40</b>	<b>-103.837,68</b>	<b>-0,08%</b>		<b>1,27%</b>



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	2.945.605,56	0,00	0,00	3.002.211,03	56.605,47	1,92%	1,92%	8,98%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	3.115.744,47	0,00	0,00	3.171.267,05	55.522,58	1,78%	1,78%	8,50%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.500.000,00	0,00	0,00%	-3,68%	10,41%
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.287.273,92	0,00	0,00	5.286.378,49	-895,43	-0,02%	-0,02%	0,75%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.593.327,39	0,00	0,00	6.587.504,11	-5.823,28	-0,09%	-0,09%	1,73%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.256.324,30	0,00	0,00	3.252.576,21	-3.748,09	-0,12%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.808.536,89	0,00	0,00	2.804.298,68	-4.238,21	-0,15%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.811.977,97	0,00	0,00	1.808.794,03	-3.183,94	-0,18%	-0,18%	7,97%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.536.682,62	0,00	0,00	9.477.976,85	-58.705,77	-0,62%	-0,62%	13,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.804.653,56	0,00	0,00	2.763.593,43	-41.060,13	-1,46%	-1,46%	10,78%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.117.491,85	0,00	0,00	3.988.185,77	-129.306,08	-3,14%	-3,14%	11,99%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.400.297,73	0,00	0,00	3.289.914,10	-110.383,63	-3,25%	-3,25%	11,36%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.886.410,44	0,00	0,00	2.787.040,65	-99.369,79	-3,44%	-3,44%	9,94%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.027.065,99	0,00	0,00	2.917.524,44	-109.541,55	-3,62%	-3,62%	10,54%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.025.808,11	0,00	0,00	3.866.882,91	-158.925,20	-3,95%	-3,95%	9,65%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.499.874,70	0,00	0,00	2.375.659,01	-124.215,69	-4,97%	-4,97%	11,79%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.079.384,67	0,00	0,00	2.907.358,79	-172.025,88	-5,59%	-5,59%	12,13%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>61.196.460,17</b>	<b>2.500.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>62.787.165,55</b>	<b>-909.294,62</b>	<b>-1,43%</b>		<b>8,97%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA - IMP  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.800.588,26	0,00	0,00	1.868.116,69	67.528,43	3,75%	3,75%	12,68%
<b>Total Exterior</b>	<b>1.800.588,26</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.868.116,69</b>	<b>67.528,43</b>	<b>3,75%</b>		<b>12,68%</b>