

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

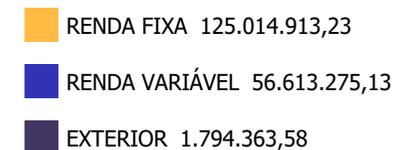
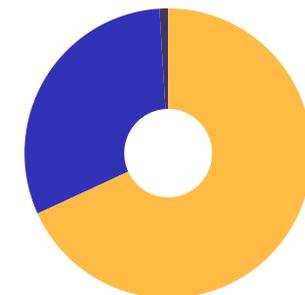
em novembro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.084.803,46	8,77%	998	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.226.196,09	1,76%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.222.536,13	3,94%	122	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.478.685,43	5,71%	967	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.561.457,46	4,67%	675	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	17.773.256,51	9,69%	666	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	15.855.705,24	8,64%	879	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.092.781,82	2,23%	94	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	321.262,05	0,18%	1.359	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	32.827,81	0,02%	757	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	296.174,84	0,16%	298	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.007.886,09	2,73%	53	5,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.177.051,37	6,09%	272	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	6.000.744,49	3,27%	55	11,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.166.647,80	2,82%	138	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.951.862,83	4,88%	195	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.549.492,41	2,48%	33	6,69%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	215.541,40	0,12%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.646.085,12	1,44%	6	0,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3 du	Não há	2.706.369,17	1,48%	160	2,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 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%	18.342.255,19
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	83.616.684,19	45,59%	15,00%	36,00%	76,00%	55.784.455,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	110.053.531,16
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	36.633.195,23	19,97%	10,00%	20,00%	40,00%	36.735.825,55
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	27.513.382,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	4.765.033,81	2,60%	0,00%	4,00%	5,00%	4.406.093,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.171.127,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.171.127,60
Total Renda Fixa	100,00%	125.014.913,23	68,16%	25,00%	60,00%	216,00%	



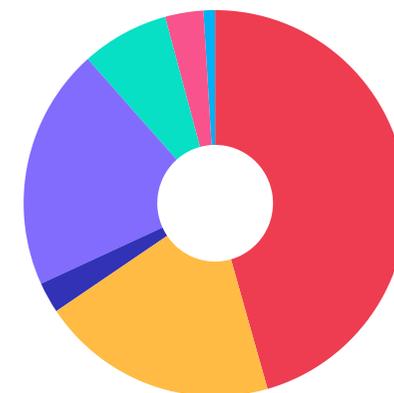
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 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%	18.342.255,19
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.342.255,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30,00%	37.162.610,41	20,26%	7,00%	25,00%	30,00%	17.864.155,17
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.525.869,37	7,37%	7,00%	8,00%	10,00%	4.816.385,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	5.924.795,35	3,23%	0,00%	5,00%	5,00%	3.246.332,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	9.171.127,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.171.127,60
Total Renda Variável	40,00%	56.613.275,13	30,86%	14,00%	40,00%	75,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 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%	9.171.127,60
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.342.255,19
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.794.363,58	0,98%	0,00%	0,00%	5,00%	7.376.764,02
Total Exterior	10,00%	1.794.363,58	0,98%	0,00%	0,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	49.519.707,96	27,00	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.375.001,53	17,65	0,00
ITAÚ UNIBANCO	18.982.247,18	10,35	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	16.174.398,96	8,82	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	11.008.630,58	6,00	2,33
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	9.062.319,05	4,94	0,01
BANCO J. SAFRA S/A	7.645.186,36	4,17	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.284.751,47	2,88	0,10
AURORA CAPITAL	4.549.492,41	2,48	2,97
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.787.789,56	2,07	0,22
VINCI PARTNERS	3.774.816,48	2,06	0,00
HIX CAPITAL	3.739.247,89	2,04	0,12
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.132.350,20	1,71	0,01
A5 CAPITAL PARTNERS	3.110.068,14	1,70	-
PERFIN INVESTIMENTOS	2.893.821,27	1,58	0,04
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.814.727,21	1,53	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.706.369,17	1,48	0,69
TRÍGONO CAPITAL	2.646.085,12	1,44	0,36
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	215.541,40	0,12	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 '	83.616.684,19	45,59	15,00	76,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	36.633.195,23	19,97	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.765.033,81	2,60	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 '	37.162.610,41	20,26	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	13.525.869,37	7,37	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.924.795,35	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	1.794.363,58	0,98	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,46%	6,40%	-0,72%	0,50%	7,04%	21,03%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,48%	6,16%	-0,82%	0,38%	6,73%	20,45%	0,01%	0,02%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,25%	6,77%	1,31%	4,33%	8,05%	20,89%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	6,28%	1,41%	4,27%	7,44%	19,53%	0,01%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,43%	9,66%	4,13%	6,87%	11,55%	23,27%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,07%	-23,05%	0,04%	-8,61%	-22,69%	-30,12%	-	0,56%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,59%	-1,87%	0,14%	6,53%	0,68%	30,33%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,04%	-1,74%	-5,38%	0,32%	-0,97%	7,61%	0,02%	0,11%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,23%	3,52%	0,54%	1,19%	3,95%	11,13%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,22%	3,34%	0,49%	1,09%	3,75%	10,71%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,32%	6,10%	1,40%	3,99%	7,41%	21,69%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	5,82%	1,31%	3,83%	7,10%	21,07%	0,01%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,31%	5,87%	1,35%	3,81%	7,13%	21,12%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	2,00%	1,48%	0,67%	5,31%	3,52%	26,83%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,99%	1,24%	0,60%	5,13%	3,24%	26,17%	0,02%	0,10%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,14%	1,62%	-0,31%	4,44%	3,87%	28,14%	0,03%	0,10%

CDI (Benchmark)	0,15%	2,59%	0,46%	1,03%	2,97%	9,24%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,57%	-1,31%	-5,50%	-2,15%	-0,76%	5,37%	0,00%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,54%	0,11%	0,42%	1,83%	6,86%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,08%	1,81%	0,26%	0,61%	2,12%	7,43%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,22%	3,81%	0,39%	1,25%	4,44%	-	0,00%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,89%	3,13%	2,41%	3,29%	4,31%	7,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	6,68%	1,43%	4,28%	8,05%	24,98%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,11%	2,65%	-0,05%	0,82%	3,01%	16,62%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	5,27%	0,21%	1,37%	5,90%	24,20%	0,01%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	2,13%	-0,49%	1,30%	3,00%	16,24%	0,01%	0,04%

Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	0,17%	10,09%	-0,74%	13,28%	9,46%	14,63%	0,01%	0,16%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,69%	12,92%	4,96%	8,62%	15,17%	31,43%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	10,75%	12,10%	3,47%	18,96%	15,30%	31,21%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	10,59%	9,23%	2,87%	17,11%	12,10%	32,33%	0,09%	0,26%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,51%	10,60%	4,37%	7,38%	12,59%	25,58%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	15,90%	-5,84%	9,58%	24,59%	0,61%	21,66%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,80%	-11,83%	-4,51%	9,47%	-4,21%	26,08%	0,08%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13,88%	1,11%	11,39%	31,11%	13,84%	37,90%	0,09%	0,41%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,68%	2,51%	3,63%	23,31%	9,88%	46,84%	0,11%	0,43%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	13,48%	-11,77%	6,55%	15,93%	-1,09%	35,53%	0,09%	0,42%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14,44%	-5,48%	7,84%	20,99%	0,85%	35,57%	0,10%	0,41%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	16,98%	-4,28%	13,87%	25,52%	4,15%	34,45%	0,11%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	12,28%	-10,51%	7,24%	25,78%	-3,23%	29,97%	0,10%	0,43%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,28%	-	5,21%	-	-	-	0,09%	-
CDI (Benchmark)	0,15%	2,59%	0,46%	1,03%	2,97%	9,24%	-	-

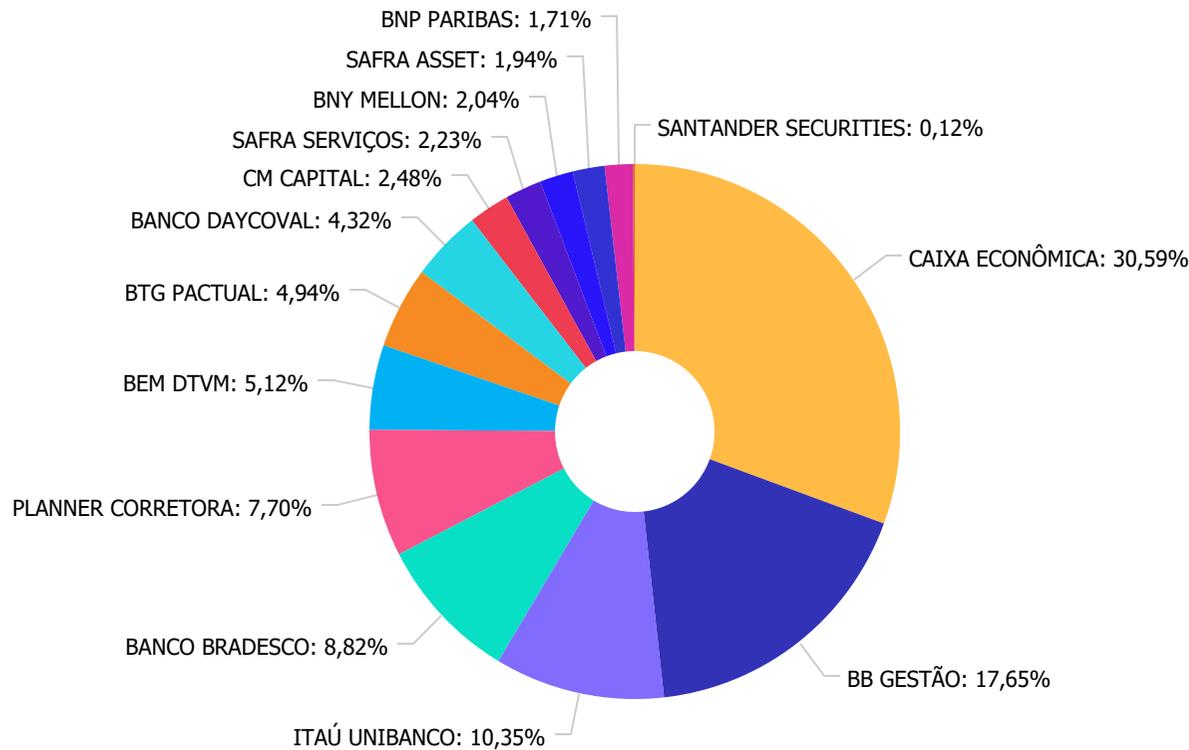
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,43%	3,37%	-0,19%	0,80%	3,80%	12,27%	0,01%	0,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,84%	1,79%	1,56%	4,14%	3,91%	21,35%	0,02%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	12,96%	-6,14%	7,74%	22,05%	5,33%	48,18%	0,10%	0,43%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13,02%	-0,58%	4,69%	18,42%	13,62%	72,51%	0,10%	0,42%

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

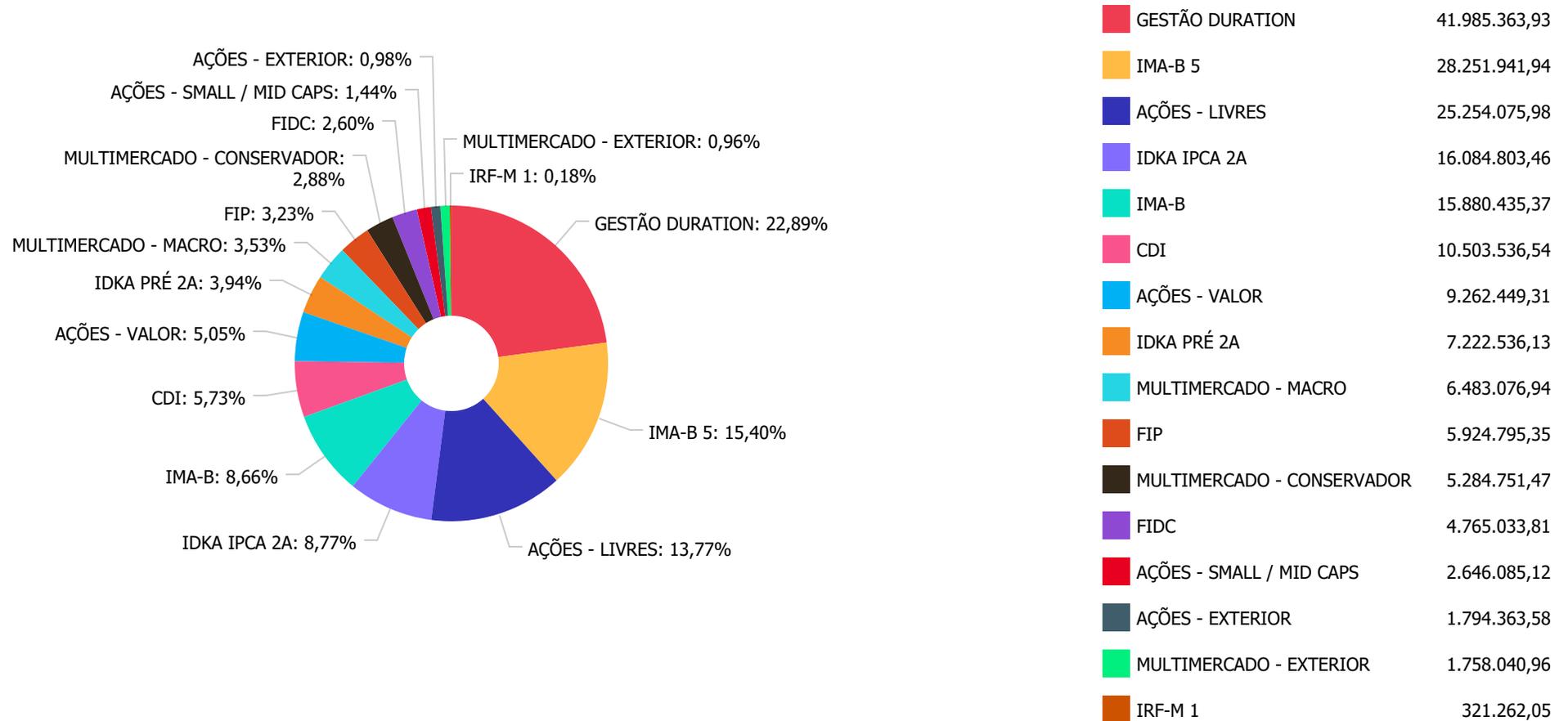
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,55%	52,59%	-1,23%	20,39%	50,26%	91,01%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,44%	43,95%	-1,58%	17,55%	42,19%	83,95%	0,10%	0,24%

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



CAIXA ECONÔMICA	56.109.251,65
BB GESTÃO	32.375.001,53
ITAÚ UNIBANCO	18.982.247,18
BANCO BRADESCO	16.174.398,96
PLANNER CORRETORA	14.118.698,72
BEM DTVM	9.387.980,00
BTG PACTUAL	9.062.319,05
BANCO DAYCOVAL	7.930.836,59
CM CAPITAL	4.549.492,41
SAFRA SERVIÇOS	4.092.781,82
BNY MELLON	3.739.247,89
SAFRA ASSET	3.552.404,54
BNP PARIBAS	3.132.350,20
SANTANDER SECURITIES	215.541,40

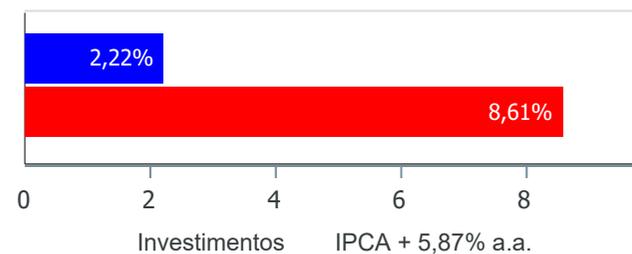
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Novembro / 2020)



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%

Investimentos x Meta Atuarial



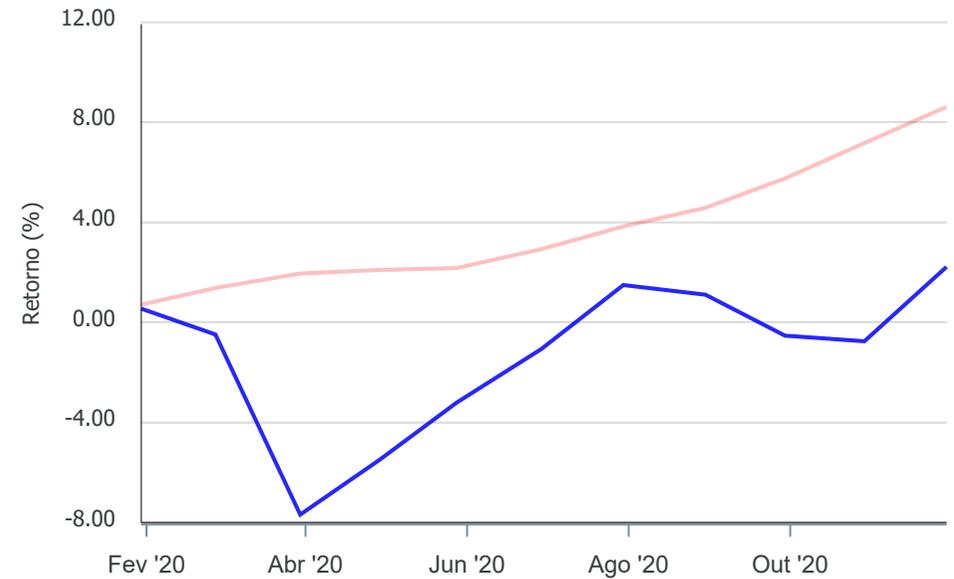
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Novembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.007.093,24	0,00	0,00	4.092.781,82	85.688,58	2,14%	2,14%	2,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.394.150,04	0,00	0,00	8.561.457,46	167.307,42	1,99%	1,99%	2,32%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.542.999,48	84.000,00	84.000,00	17.773.256,51	230.257,03	1,31%	1,31%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.184.747,31	0,00	0,00	3.226.196,09	41.448,78	1,30%	1,30%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.406.389,01	18.170,38	80.000,00	10.478.685,43	134.126,04	1,29%	1,29%	0,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.925.515,52	2.686.284,29	700.000,00	16.084.803,46	173.003,65	1,04%	1,22%	0,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.726.748,76	0,00	0,00	15.855.705,24	128.956,48	0,82%	0,82%	0,87%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.882.295,38	0,00	0,00	8.951.862,83	69.567,45	0,78%	0,78%	1,46%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	4.979.461,23	0,00	0,00	5.007.886,09	28.424,86	0,57%	0,57%	0,41%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.188.112,71	0,00	0,00	7.222.536,13	34.423,42	0,48%	0,48%	1,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.155.321,92	0,00	0,00	5.166.647,80	11.325,88	0,22%	0,22%	0,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	320.570,85	0,00	0,00	321.262,05	691,20	0,22%	0,22%	0,11%
BBIF MASTER FIDC LP	215.170,61	0,00	0,00	215.541,40	370,79	0,17%	0,17%	1,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.165.374,62	0,00	0,00	11.177.051,37	11.676,75	0,10%	0,10%	0,02%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.546.426,19	0,00	0,00	4.549.492,41	3.066,22	0,07%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	5.998.161,24	0,00	0,00	6.000.744,49	2.583,25	0,04%	0,04%	1,72%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.901,90	21.723,88	10.806,56	32.827,81	8,59	0,02%	0,06%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	76.687,70	2.664.772,35	2.445.480,12	296.174,84	194,91	0,01%	0,08%	0,00%
Total Renda Fixa	121.737.127,71	5.474.950,90	3.320.286,68	125.014.913,23	1.123.121,30	0,91%		0,99%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.377.652,21	0,00	0,00	2.781.263,66	403.611,45	16,98%	16,98%	11,43%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.737.109,38	0,00	0,00	3.132.350,20	395.240,82	14,44%	14,44%	10,27%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.376.443,79	0,00	0,00	2.706.369,17	329.925,38	13,88%	13,88%	8,76%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.337.834,28	0,00	0,00	3.787.789,56	449.955,28	13,48%	13,48%	8,60%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.308.379,18	0,00	0,00	3.739.247,89	430.868,71	13,02%	13,02%	9,51%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.341.620,80	0,00	0,00	3.774.816,48	433.195,68	12,96%	12,96%	9,66%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.350.015,04	0,00	0,00	2.638.548,01	288.532,97	12,28%	12,28%	9,79%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.589.765,14	0,00	0,00	1.758.040,96	168.275,82	10,58%	10,58%	8,71%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.399.426,85	0,00	0,00	2.646.085,12	246.658,27	10,28%	10,28%	8,73%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.338.562,34	0,00	0,00	9.062.319,05	723.756,71	8,68%	8,68%	10,81%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.787.894,99	0,00	0,00	2.893.821,27	105.926,28	3,80%	3,80%	8,26%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.304.061,65	0,00	0,00	6.483.076,94	179.015,29	2,84%	2,84%	1,74%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.262.168,32	0,00	0,00	5.284.751,47	22.583,15	0,43%	0,43%	0,59%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.115.308,53	0,00	0,00	3.110.068,14	-5.240,39	-0,17%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.819.751,84	0,00	0,00	2.814.727,21	-5.024,63	-0,18%	-	-
Total Renda Variável	52.445.994,34	0,00	0,00	56.613.275,13	4.167.280,79	7,95%		7,75%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA - IMP
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/11/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Novembro / 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	1.751.568,02	0,00	0,00	1.794.363,58	42.795,56	2,44%	2,44%	10,34%
Total Renda Variável	1.751.568,02	0,00	0,00	1.794.363,58	42.795,56	2,44%		10,34%