

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
TÍTULOS PÚBLICOS			235.889.376,41	17,87%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	45.510.808,36	3,45%	976	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	15.343.649,83	1,16%	19.025	1,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	26.772.798,16	2,03%	28	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	16.689.068,70	1,26%	8.283	1,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	28.387.990,65	2,15%	685	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	18.553.753,38	1,41%	885	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	29.455.760,00	2,23%	189	2,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	30.107.244,96	2,28%	701	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.774.892,63	1,57%	588	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	44.866.674,19	3,40%	164	3,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	45.456.634,07	3,44%	445	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	21.691.499,34	1,64%	93	1,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIA...	D+3	Não há	2.548.030,87	0,19%	2.184	1,94%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	15.272.591,12	1,16%	301	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	23.313.435,77	1,77%	269	0,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	24.239.596,99	1,84%	272	1,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	30.469.050,54	2,31%	136	3,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCI...	D+0	Não há	7.490.838,46	0,57%	488	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.503.114,99	2,08%	28	3,15%	Artigo 7º, Inciso IV, 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
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.712.140,87	0,51%	4.840	2,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	48.972.799,76	3,71%	117	2,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	D+45 a ...	Não há	8.311.824,75	0,63%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	25.906,76	0,00%	28	4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	10.488.361,87	0,79%	35	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.623.312,27	0,20%	6.310	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.678.898,97	1,11%	2.979	1,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	14.422.161,87	1,09%	359	2,94%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.513.648,26	0,49%	2.939	2,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	48.414.203,45	3,67%	5.816	2,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.447.163,63	0,34%	1.400	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.427.955,80	0,56%	55	0,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	31.051.926,85	2,35%	42.737	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	15.117.473,26	1,15%	160	1,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	29.771.137,59	2,25%	138	1,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.163.965,26	0,77%	9.682	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	36.382.228,72	2,76%	118	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	36.564.506,17	2,77%	5	4,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.952.025,96	0,15%	3.065	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

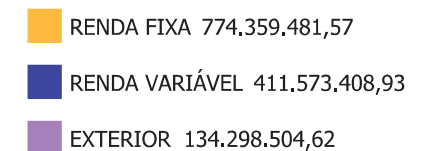
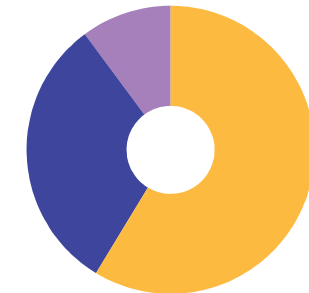
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	34.889.105,47	2,64%	15.223	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.678.898,97	1,11%	2.979	1,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC ...	D+2	27 meses	4.246.653,28	0,32%	723	4,12%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.626.561,50	0,20%	11	4,43%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	32.157.460,22	2,44%	22.197	2,68%	Artigo 8º, Inciso III
MAG FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.777.312,80	0,44%	52	4,29%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	5.276.981,72	0,40%	3.816	2,91%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC...	D+2	22 meses	4.829.272,26	0,37%	668	4,38%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se ...	Não se aplica	295.154,52	0,02%	19	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FI...	Não se ...	Não se aplica	2.466.438,05	0,19%	46	3,13%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.040.276,43	0,38%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.161.603,24	0,16%	39	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I M...	Não se ...	Não se aplica	13.500.912,20	1,02%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.784.731,93	0,21%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	8.519.151,69	0,65%		5,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.650.000,00	0,35%		4,16%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO N...	D+5 du	Não há	11.014.222,74	0,83%	61	1,04%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR I...	D+5 du	Não há	13.396.515,84	1,01%	1.664	10,79%	Artigo 9º - A, Inciso II
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVES...	D+5 du	Não há	13.203.279,22	1,00%	2.544	7,05%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	15.996.984,06	1,21%	7.150	1,52%	Artigo 9º - A, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	29.988.426,30	2,27%	14.090	2,35%	Artigo 9º - A, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	5.206.932,21	0,39%	14	7,02%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	18.026.042,30	1,37%	48	1,30%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	27.466.101,95	2,08%	102.763	1,19%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.320.231.395,12				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			31.354.085,13				Artigo 6º
PL Total			1.351.585.480,25				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	235.889.376,41	17,87%	17,00%	17,00%	40,00%	292.203.181,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	343.610.774,27	26,03%	20,00%	20,00%	50,00%	316.504.923,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	17.820.621,99	1,35%	5,00%	20,00%	35,00%	444.260.366,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	168.700.977,38	12,78%	4,00%	4,00%	25,00%	161.356.871,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	26.404.627,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	13.202.313,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	8.337.731,52	0,63%	0,50%	0,50%	3,00%	31.269.210,33
Total Renda Fixa	100,00%	774.359.481,57	58,65%	46,50%	61,50%	156,00%	



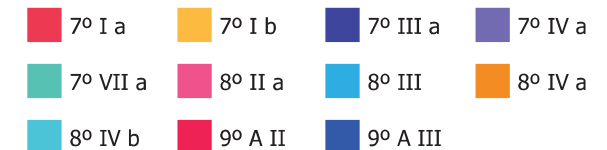
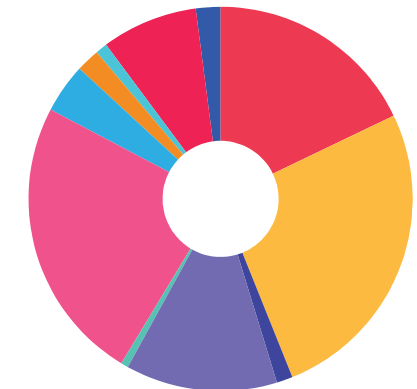
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (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%	5,00%	6,00%	15,00%	198.034.709,27
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	317.240.899,09	24,03%	6,00%	25,00%	30,00%	78.828.519,45
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	54.914.241,78	4,16%	5,00%	10,00%	10,00%	77.108.897,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	26.249.116,37	1,99%	1,00%	2,00%	4,00%	26.560.139,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	13.169.151,69	1,00%	1,00%	2,00%	3,00%	26.437.790,16
Total Renda Variável	35,00%	411.573.408,93	31,17%	18,00%	45,00%	62,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	10,00%	132.023.139,51
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	106.832.402,67	8,09%	5,00%	10,00%	10,00%	25.190.736,84
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	27.466.101,95	2,08%	5,00%	10,00%	10,00%	104.557.037,56
Total Exterior	10,00%	134.298.504,62	10,17%	15,00%	30,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	235.889.376,41	17,87	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	133.869.712,47	10,14	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	124.583.054,87	9,44	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	121.535.767,53	9,21	0,01
WESTERN ASSET	113.926.648,67	8,63	0,23
ITAÚ UNIBANCO	101.185.223,58	7,66	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	83.224.511,60	6,30	0,28
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	79.441.850,30	6,02	0,01
VINCI PARTNERS	55.946.865,61	4,24	0,04
ICATU VANGUARDA	37.667.080,25	2,85	0,09
ARX INVESTIMENTOS	36.564.506,17	2,77	0,13
MOAT CAPITAL	34.889.105,47	2,64	0,23
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	29.988.426,30	2,27	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	21.691.499,34	1,64	0,00
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	18.541.188,63	1,40	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	15.343.649,83	1,16	0,05
BRASIL PLURAL	14.678.898,97	1,11	0,26
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	8.519.151,69	0,65	1,11
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	8.325.343,67	0,63	0,12
OLIVEIRA TRUST	8.311.824,75	0,63	0,07
ITAÚ DTVM	7.427.955,80	0,56	0,00
XP GESTÃO DE RECURSOS	6.513.648,26	0,49	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.206.932,21	0,39	0,12
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.650.000,00	0,35	0,04
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	4.628.041,29	0,35	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.623.312,27	0,20	0,00
PERFIN INVESTIMENTOS	1.952.025,96	0,15	0,02

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 '	235.889.376,41	17,87	17,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	343.610.774,27	26,03	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	17.820.621,99	1,35	5,00	35,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	168.700.977,38	12,78	4,00	25,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	8.337.731,52	0,63	0,50	3,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	15,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	317.240.899,09	24,03	6,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	54.914.241,78	4,16	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	26.249.116,37	1,99	1,00	4,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	13.169.151,69	1,00	1,00	3,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	106.832.402,67	8,09	5,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	27.466.101,95	2,08	5,00	10,00

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
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	0,27%	3,99%	0,77%	1,60%	3,99%	11,51%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	0,38%	4,78%	1,09%	2,37%	4,78%	12,24%	-	-
IMA Geral ex-C (Benchmark)	2,12%	4,85%	2,83%	3,09%	4,85%	18,09%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,38%	5,09%	3,18%	3,28%	5,09%	18,83%	0,01%	0,04%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,47%	6,34%	1,34%	2,77%	6,34%	16,64%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,07%	-2,45%	7,62%	16,83%	-2,45%	-6,51%	-	0,53%
120% do CDI (Benchmark)	0,20%	3,32%	0,57%	1,18%	3,32%	10,75%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	-	-	-
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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,81%	7,83%	3,32%	4,59%	7,83%	21,74%	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%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,78%	7,86%	3,23%	4,48%	7,86%	21,79%	0,01%	0,04%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,24%	10,18%	4,43%	5,13%	10,18%	27,76%	0,01%	0,05%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	1,81%	7,65%	3,30%	4,47%	7,65%	21,57%	0,01%	0,04%

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
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%	0,02%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,94%	6,30%	7,16%	8,14%	6,30%	30,60%	0,02%	0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4,85%	6,05%	7,10%	8,06%	6,05%	29,88%	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%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	4,83%	5,85%	7,10%	8,05%	5,85%	29,76%	0,02%	0,11%
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	5,01%	6,40%	7,14%	7,88%	6,40%	30,82%	0,02%	0,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	4,59%	4,97%	7,00%	8,14%	4,97%	28,95%	0,02%	0,10%

IRF-M (Benchmark)	1,95%	6,69%	1,99%	1,75%	6,69%	19,53%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,96%	6,40%	1,99%	1,64%	6,40%	18,94%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,96%	6,43%	1,93%	1,62%	6,43%	18,87%	0,01%	0,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,98%	6,28%	2,08%	1,66%	6,28%	18,84%	0,01%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,27%	2,10%	0,62%	1,18%	2,10%	8,03%	0,00%	0,00%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,44%	3,07%	0,46%	0,76%	3,07%	12,12%	0,00%	0,01%

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%	0,00%	0,01%

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,01%	0,02%

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 + 15,00% ao ano (Benchmark)	2,59%	20,13%	6,80%	12,10%	20,13%	44,18%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	2,37%	-	2,13%	6,04%	-	51,12%	0,06%	0,27%
S&P 500 (Benchmark)	3,71%	16,26%	11,69%	21,15%	16,26%	49,83%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,19%	12,17%	11,55%	19,85%	12,17%	48,40%	0,04%	0,27%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,95%	11,80%	4,89%	8,07%	11,80%	24,81%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	3,10%	-21,85%	6,16%	-7,92%	-21,85%	-20,10%	0,06%	0,17%
IDIV (Benchmark)	8,94%	-1,00%	25,44%	21,29%	-1,00%	43,71%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	9,37%	3,05%	25,04%	23,84%	3,05%	46,40%	0,06%	0,38%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,22%	-15,40%	16,37%	11,48%	-15,40%	29,55%	0,08%	0,38%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,97%	-9,45%	20,15%	13,27%	-9,45%	29,15%	0,06%	0,39%
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,37%	2,14%	21,63%	22,49%	2,14%	37,94%	0,06%	0,43%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,60%	-7,77%	6,66%	5,99%	-7,77%	29,68%	0,06%	0,43%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	9,27%	-3,03%	25,59%	22,17%	-3,03%	31,81%	0,07%	0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,23%	7,88%	12,39%	17,68%	7,88%	50,20%	0,07%	0,43%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,67%	-3,87%	16,79%	16,90%	-3,87%	23,63%	0,06%	0,46%

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
OCCAM FIC AÇÕES	10,11%	7,87%	22,82%	24,40%	7,87%	46,10%	0,08%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,97%	-21,23%	17,87%	10,19%	-21,23%	10,15%	0,07%	0,53%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,30%	-4,87%	19,94%	22,34%	-4,87%	38,19%	0,06%	0,42%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	9,20%	3,48%	21,18%	22,19%	3,48%	54,75%	0,06%	0,42%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO	1,22%	5,22%	1,73%	1,37%	5,22%	-	0,01%	0,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	1,34%	-	2,02%	-	-	-	0,01%	-
SMLL (Benchmark)	7,52%	-0,65%	22,54%	25,33%	-0,65%	57,16%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6,93%	-3,16%	16,95%	21,44%	-3,16%	44,95%	0,06%	0,49%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
MAG FI MULTIMERCADO	1,08%	2,66%	2,14%	2,35%	2,66%	8,83%	0,01%	0,02%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,60%	-2,44%	-0,50%	-1,48%	-2,44%	4,20%	0,00%	0,03%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,96%	-2,95%	1,89%	3,09%	-2,95%	-	0,01%	0,07%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	2,16%	14,41%	5,50%	9,34%	14,41%	30,72%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-4,89%	-	-2,97%	-21,14%	-	-	0,04%	0,33%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-6,00%	-25,90%	12,95%	-21,48%	-25,90%	-12,37%	0,15%	0,65%

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
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,08%	2,38%	21,02%	21,77%	2,38%	54,11%	0,06%	0,42%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,10%	-	-13,25%	-13,69%	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FI...	0,37%	-	-0,65%	-22,47%	-	-	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	62,10%	-	58,66%	56,64%	-	-	-	0,63%
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,24%	-	-	-	-	-	0,07%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,93%	-4,03%	16,98%	21,32%	-4,03%	-	0,06%	0,49%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	7,05%	-	21,86%	21,98%	-	-	0,07%	-

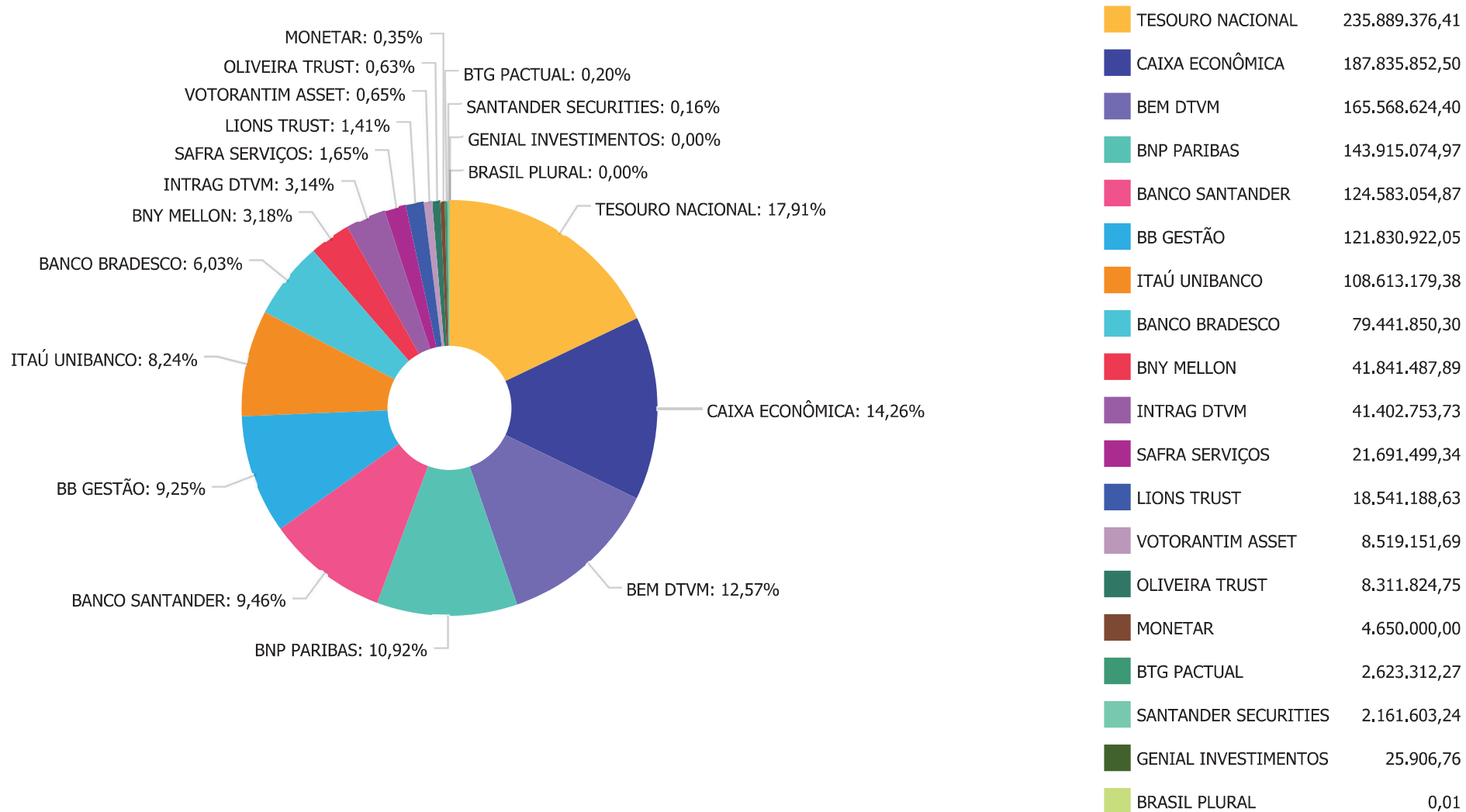
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,22%	66,02%	0,44%	18,11%	66,02%	125,04%	0,07%	0,24%

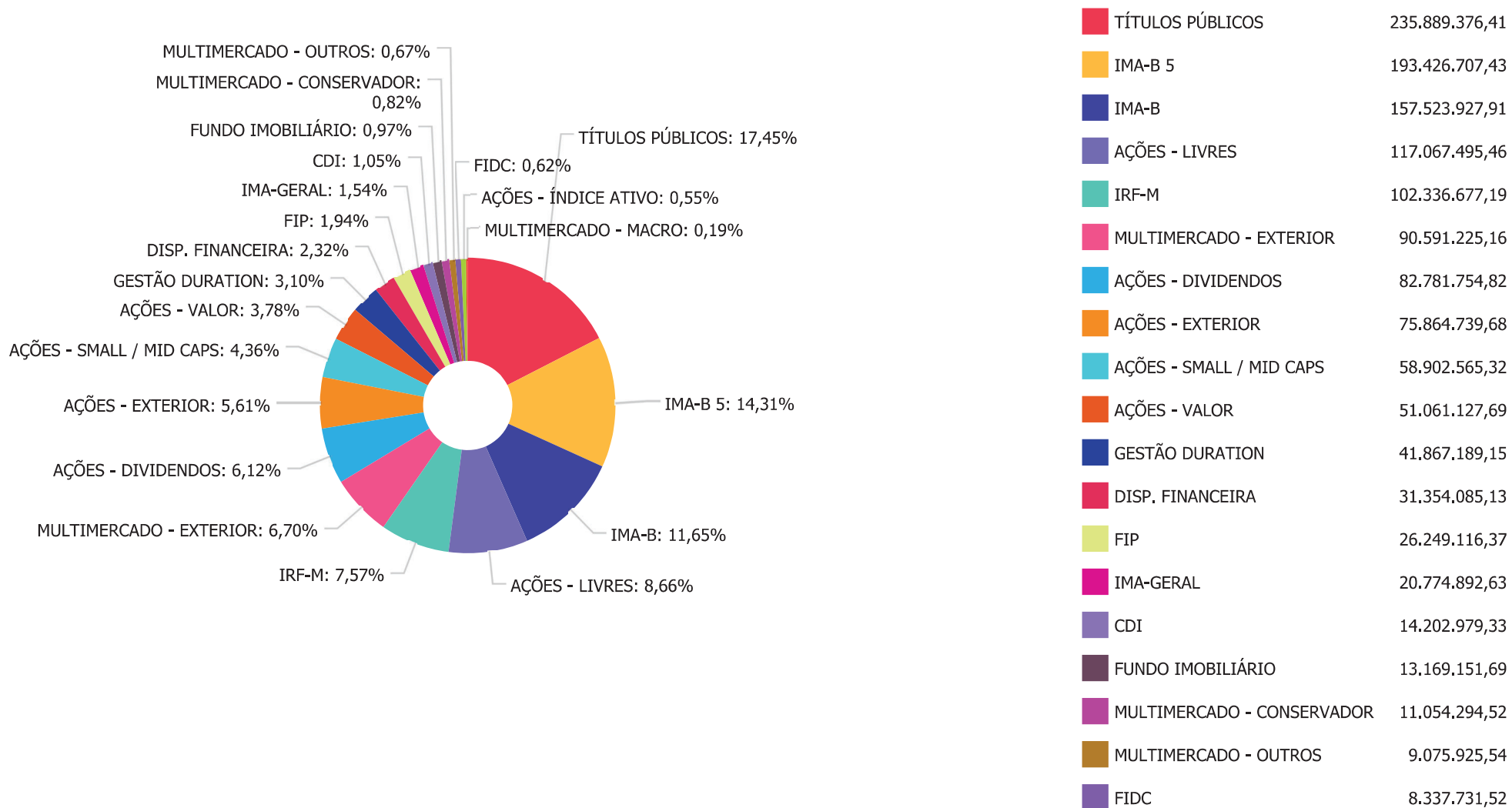
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	0,18%	91,31%	2,71%	25,96%	91,31%	-	0,09%	0,21%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MUL...	1,23%	5,49%	5,72%	9,18%	5,49%	25,39%	0,02%	0,15%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INVESTIMENTO NO EX...	-2,06%	34,29%	-2,64%	3,98%	34,29%	61,26%	0,08%	0,11%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,48%	61,34%	4,21%	19,17%	61,34%	103,17%	0,09%	0,20%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	1,09%	51,88%	7,76%	21,48%	51,88%	101,94%	0,11%	0,22%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	0,23%	-	7,75%	-	-	-	0,11%	-
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERI...	2,22%	27,64%	7,55%	20,18%	27,64%	67,23%	0,04%	0,25%

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



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



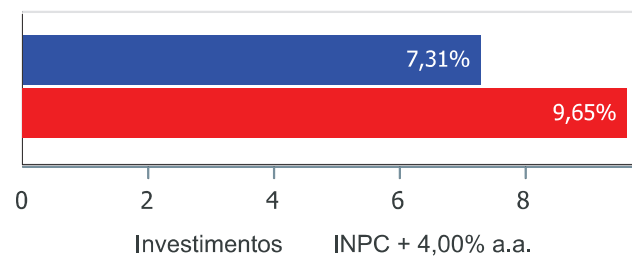
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	06/12/2016	3.450	2.926,773673	3.544,811898	10.097.369,17	12.229.601,05	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2.000	2.593,340767	3.862,801543	5.186.681,53	7.725.603,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7.600	3.031,376224	3.862,801543	23.038.459,30	29.357.291,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.160,540903	10.048.181,87	14.145.839,07	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8.500	3.097,511439	4.519,817601	26.328.847,23	38.418.449,61	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6.000	3.097,511438	4.519,817601	18.585.068,63	27.118.905,61	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.519,817601	7.520.551,00	14.463.416,32	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3.450	2.896,880939	4.519,817601	9.994.239,24	15.593.370,72	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	13.000	3.271,849021	4.519,817601	42.534.037,27	58.757.628,81	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.519,817601	13.087.396,08	18.079.270,40	Mercado

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	1.473.275.882,27	41.934.447,80	44.196.159,46	1.484.561.536,30	13.547.365,69	13.547.365,69	0,92%	0,92%	0,53%	0,53%	172,31%	3,72%
Fevereiro	1.484.561.536,30	25.677.725,35	14.996.350,08	1.470.304.077,42	-24.938.834,15	-11.391.468,46	-1,67%	-0,76%	0,45%	0,99%	-77,37%	6,27%
Março	1.470.304.077,42	67.927.415,20	66.666.012,68	1.311.453.781,60	-160.111.698,34	-171.503.166,80	-10,88%	-11,56%	0,52%	1,52%	-762,68%	20,78%
Abril	1.311.453.781,60	30.726.446,52	50.433.790,00	1.342.004.942,82	50.258.504,70	-121.244.662,10	3,83%	-8,17%	0,08%	1,60%	-511,34%	10,92%
Mai	1.342.004.942,82	37.373.599,78	53.752.125,94	1.366.704.228,89	41.077.812,23	-80.166.849,87	3,06%	-5,36%	0,06%	1,66%	-322,93%	6,83%
Junho	1.366.704.228,89	14.445.258,44	55.579.188,76	1.373.691.653,77	48.121.355,20	-32.045.494,67	3,52%	-2,03%	0,63%	2,30%	-88,25%	6,29%
Julho	1.373.691.653,77	16.587.737,57	45.044.519,09	1.401.278.636,52	56.043.764,27	23.998.269,60	4,08%	1,97%	0,80%	3,12%	63,14%	5,03%
Agosto	1.401.278.636,52	11.814.215,83	38.387.685,68	1.366.035.246,10	-8.669.920,57	15.328.349,03	-0,62%	1,34%	0,69%	3,83%	34,94%	5,17%
Setembro	1.366.035.246,10	42.300.788,20	69.285.229,76	1.312.276.986,47	-26.773.818,07	-11.445.469,04	-1,96%	-0,65%	1,20%	5,07%	-12,79%	6,10%
Outubro	1.312.276.986,47	5.853.744,29	36.523.631,94	1.273.926.528,19	-7.680.570,63	-19.126.039,67	-0,59%	-1,23%	1,22%	6,36%	-19,36%	5,23%
Novembro	1.273.926.528,19	41.618.080,46	69.582.976,10	1.301.683.608,46	55.721.975,91	36.595.936,24	4,37%	3,09%	1,26%	7,70%	40,12%	5,03%
Dezembro	1.301.683.608,46	45.589.209,67	80.290.864,88	1.320.231.395,12	53.249.441,87	89.845.378,11	4,09%	7,31%	1,81%	9,65%	75,74%	3,86%

Investimentos x Meta Atuarial



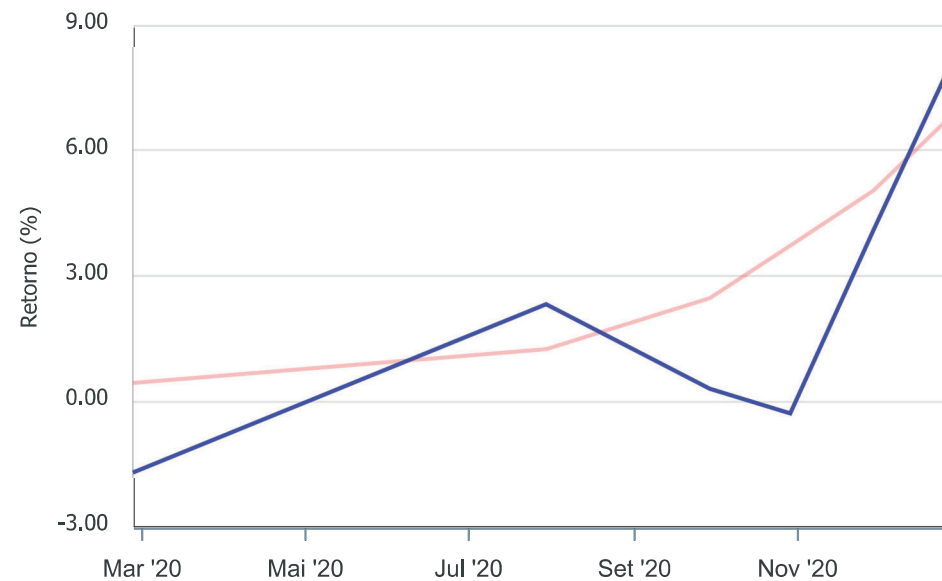
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TÍTULOS PÚBLICOS	222.485.416,53	0,00	0,00	235.889.376,41	13.403.959,88	6,02%	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	20.554.368,31	0,00	0,00	21.691.499,34	1.137.131,03	5,53%	5,53%	2,50%
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	2.426.473,69	0,00	0,00	2.548.030,87	121.557,18	5,01%	5,01%	2,09%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	14.565.611,78	0,00	0,00	15.272.591,12	706.979,34	4,85%	4,85%	2,04%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	28.099.070,73	0,00	0,00	29.455.760,00	1.356.689,27	4,83%	4,83%	2,03%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.127.855,03	0,00	0,00	24.239.596,99	1.111.741,96	4,81%	4,81%	2,04%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	52.785.188,19	0,00	6.287.965,05	48.972.799,76	2.475.576,62	4,69%	4,94%	2,09%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	14.671.010,05	0,00	0,00	15.343.649,83	672.639,78	4,58%	4,58%	1,99%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.164.805,98	0,00	0,00	16.689.068,70	524.262,72	3,24%	3,24%	1,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.292.136,47	0,00	0,00	20.774.892,63	482.756,16	2,38%	2,38%	1,02%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.527.203,62	0,00	0,00	30.107.244,96	580.041,34	1,96%	1,96%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	49.519.180,45	0,00	5.000.000,00	45.456.634,07	937.453,62	1,89%	1,96%	1,06%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	36.112.205,83	0,00	10.000.000,00	26.772.798,16	660.592,33	1,83%	1,98%	1,05%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	27.014.063,12	0,00	0,00	27.503.114,99	489.051,87	1,81%	1,81%	0,75%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	29.936.886,80	0,00	0,00	30.469.050,54	532.163,74	1,78%	1,78%	0,77%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	49.648.233,31	0,00	5.000.000,00	45.510.808,36	862.575,05	1,74%	1,82%	0,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	24.318.815,08	3.601.683,43	0,00	28.387.990,65	467.492,14	1,67%	1,81%	0,75%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	74.114.797,15	5.430.737,24	35.784.602,36	44.866.674,19	1.105.742,16	1,39%	1,81%	0,74%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.025.915,24	14.380.540,00	5.000.000,00	18.553.753,38	147.298,14	0,63%	1,32%	0,55%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.682.935,59	0,00	0,00	6.712.140,87	29.205,28	0,44%	0,44%	0,28%

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
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	8.280.309,08	0,00	0,00	8.311.824,75	31.515,67	0,38%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.266.400,45	0,00	0,00	23.313.435,77	47.035,32	0,20%	0,20%	0,02%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	809.797,42	19.890.000,00	13.218.297,47	7.490.838,46	9.338,51	0,05%	0,27%	0,02%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	26.454,92	0,00	0,00	25.906,76	-548,16	-2,07%	-	-
Total Renda Fixa	783.455.134,83	43.302.960,67	80.290.864,88	774.359.481,57	27.892.250,95	3,37%		1,19%

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
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	1.534.036,23	0,00	0,00	2.466.438,05	932.401,82	60,78%	-	-
OCCAM FIC AÇÕES	13.331.231,82	0,00	0,00	14.678.898,97	1.347.667,15	10,11%	10,11%	8,00%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	13.821.999,17	0,00	0,00	15.117.473,26	1.295.474,09	9,37%	9,37%	6,47%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.198.871,65	0,00	0,00	14.422.161,87	1.223.290,22	9,27%	9,27%	7,16%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	4.072.497,60	0,00	0,00	4.447.163,63	374.666,03	9,20%	9,20%	5,61%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	33.354.343,25	0,00	0,00	36.382.228,72	3.027.885,47	9,08%	9,08%	5,56%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.854.533,50	0,00	0,00	7.427.955,80	573.422,30	8,37%	8,37%	6,16%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	33.779.906,16	0,00	0,00	36.564.506,17	2.784.600,01	8,24%	8,24%	7,14%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.018.852,32	0,00	0,00	6.513.648,26	494.795,94	8,22%	8,22%	8,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	27.573.691,25	0,00	0,00	29.771.137,59	2.197.446,34	7,97%	7,97%	6,55%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.414.151,97	0,00	0,00	10.163.965,26	749.813,29	7,96%	7,96%	6,28%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.454.115,98	0,00	0,00	12.332.823,69	878.707,71	7,67%	7,67%	6,13%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	32.592.027,07	0,00	0,00	34.889.105,47	2.297.078,40	7,05%	7,05%	7,47%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.808.961,59	0,00	0,00	10.488.361,87	679.400,28	6,93%	6,93%	5,87%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	45.278.414,19	0,00	0,00	48.414.203,45	3.135.789,26	6,93%	6,93%	5,86%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	29.212.877,07	0,00	0,00	31.051.926,85	1.839.049,78	6,30%	6,30%	6,12%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.492.826,25	0,00	0,00	2.623.312,27	130.486,02	5,23%	5,23%	6,81%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.866.102,11	0,00	0,00	1.952.025,96	85.923,85	4,60%	4,60%	5,70%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	31.163.560,67	0,00	0,00	32.157.460,22	993.899,55	3,19%	3,19%	4,36%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.510.100,00	0,00	0,00	4.650.000,00	139.900,00	3,10%	3,10%	6,13%

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
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	2.111.504,12	0,00	0,00	2.161.603,24	50.099,12	2,37%	2,37%	5,90%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.765.279,32	0,00	0,00	4.829.272,26	63.992,94	1,34%	1,33%	0,92%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.195.397,12	0,00	0,00	4.246.653,28	51.256,16	1,22%	1,21%	0,60%
MAG FI MULTIMERCADO	5.715.392,14	0,00	0,00	5.777.312,80	61.920,66	1,08%	1,08%	0,54%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.601.649,20	0,00	0,00	2.626.561,50	24.912,30	0,96%	0,96%	0,88%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	11.109.561,57	2.286.249,00	0,00	13.500.912,20	105.101,63	0,78%	-	-
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	5.245.581,89	0,00	0,00	5.276.981,72	31.399,83	0,60%	0,60%	0,44%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.045.328,83	0,00	0,00	5.040.276,43	-5.052,40	-0,10%	-	-
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	2.805.045,50	0,00	0,00	2.784.731,93	-20.313,57	-0,72%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	310.332,59	0,00	0,00	295.154,52	-15.178,07	-4,89%	-2,58%	3,83%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	9.105.227,88	0,00	0,00	8.519.151,69	-586.076,19	-6,44%	-5,60%	14,74%
Total Renda Variável	384.343.400,01	2.286.249,00	0,00	411.573.408,93	24.943.759,92	6,45%		6,16%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE SÃO BERNARDO DO CAMPO - SBCPREV
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
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	12.916.762,88	0,00	0,00	13.203.279,22	286.516,34	2,22%	2,22%	3,95%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	10.880.208,46	0,00	0,00	11.014.222,74	134.014,28	1,23%	1,23%	2,21%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	17.831.008,38	0,00	0,00	18.026.042,30	195.033,92	1,09%	1,09%	10,67%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.921.254,84	0,00	0,00	15.996.984,06	75.729,22	0,48%	0,48%	8,64%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	5.194.919,58	0,00	0,00	5.206.932,21	12.012,63	0,23%	0,23%	11,38%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	29.935.812,91	0,00	0,00	29.988.426,30	52.613,39	0,18%	0,18%	9,18%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	27.527.366,99	0,00	0,00	27.466.101,95	-61.265,04	-0,22%	-0,22%	7,01%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	13.677.739,58	0,00	0,00	13.396.515,84	-281.223,74	-2,06%	-2,06%	8,19%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	222.710.941,43	0,00	5.097.967,55	235.889.376,41	18.276.402,53	8,21%	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	71.407.790,70	0,00	26.080.999,34	48.972.799,76	3.646.008,40	5,11%	7,16%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	84.793.300,24	7.576.878,62	49.817.967,04	44.866.674,19	2.314.462,37	2,51%	3,32%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	27.502.333,66	0,00	0,00	29.455.760,00	1.953.426,34	7,10%	7,10%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.464.747,84	0,00	15.000.000,00	24.239.596,99	1.774.849,15	4,74%	7,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	55.240.977,90	0,00	11.327.587,10	45.510.808,36	1.597.417,56	2,89%	3,32%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	20.181.465,80	0,00	0,00	21.691.499,34	1.510.033,54	7,48%	7,48%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	14.259.537,96	0,00	0,00	15.272.591,12	1.013.053,16	7,10%	7,10%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	14.339.954,65	0,00	0,00	15.343.649,83	1.003.695,18	7,00%	7,00%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	29.516.324,95	0,00	0,00	30.469.050,54	952.725,59	3,23%	3,23%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	49.533.758,51	0,00	5.000.000,00	45.456.634,07	922.875,56	1,86%	1,93%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	26.625.834,21	0,00	0,00	27.503.114,99	877.280,78	3,29%	3,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.316.140,80	9.299.321,62	0,00	28.387.990,65	772.528,23	2,80%	3,34%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	15.980.686,95	0,00	0,00	16.689.068,70	708.381,75	4,43%	4,43%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	36.077.464,17	0,00	10.000.000,00	26.772.798,16	695.333,99	1,93%	2,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.135.658,67	0,00	0,00	20.774.892,63	639.233,96	3,17%	3,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.519.174,24	0,00	0,00	30.107.244,96	588.070,72	1,99%	1,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.962.168,57	14.380.540,00	5.000.000,00	18.553.753,38	211.044,81	0,90%	2,04%
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	2.378.180,50	0,00	0,00	2.548.030,87	169.850,37	7,14%	7,14%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	8.221.893,85	0,00	0,00	8.311.824,75	89.930,90	1,09%	1,09%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.224.071,53	0,00	0,00	23.313.435,77	89.364,24	0,38%	0,38%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.681.510,22	0,00	0,00	6.712.140,87	30.630,65	0,46%	0,46%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	9.916.307,21	25.681.770,74	28.131.281,16	7.490.838,46	24.041,67	0,07%	0,62%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	24.072,45	0,00	0,00	25.906,76	1.834,31	7,62%	7,62%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
				Total Renda Fixa	39.862.475,76	4,48%	

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	41.399.246,25	0,00	0,00	48.414.203,45	7.014.957,20	16,94%	16,94%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	30.063.237,27	0,00	0,00	36.382.228,72	6.318.991,45	21,02%	21,02%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	28.630.024,05	0,00	0,00	34.889.105,47	6.259.081,42	21,86%	21,86%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	30.935.194,75	0,00	36.564.506,17	5.629.311,42	18,20%	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	25.889.455,12	0,00	0,00	31.051.926,85	5.162.471,73	19,94%	19,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	25.257.458,06	0,00	0,00	29.771.137,59	4.513.679,53	17,87%	17,87%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	28.827.019,96	0,00	0,00	32.157.460,22	3.330.440,26	11,55%	11,55%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	12.090.638,84	0,00	0,00	15.117.473,26	3.026.834,42	25,03%	25,03%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	11.484.025,96	0,00	0,00	14.422.161,87	2.938.135,91	25,58%	25,58%
OCCAM FIC AÇÕES	11.952.040,24	0,00	0,00	14.678.898,97	2.726.858,73	22,82%	22,82%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.560.304,10	0,00	0,00	12.332.823,69	1.772.519,59	16,78%	16,78%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.459.326,30	0,00	0,00	10.163.965,26	1.704.638,96	20,15%	20,15%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.966.255,26	0,00	0,00	10.488.361,87	1.522.106,61	16,98%	16,98%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.107.020,70	0,00	0,00	7.427.955,80	1.320.935,10	21,63%	21,63%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	7.552.072,01	0,00	6.475,98	8.519.151,69	973.555,66	12,89%	12,95%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.597.552,58	0,00	0,00	6.513.648,26	916.095,68	16,37%	16,37%
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTISTRATÉGIA II FIP	1.567.216,89	0,00	0,00	2.466.438,05	899.221,16	57,38%	58,66%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	3.669.914,80	0,00	0,00	4.447.163,63	777.248,83	21,18%	21,18%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.334.127,47	0,00	0,00	2.623.312,27	289.184,80	12,39%	12,39%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.390.000,00	0,00	0,00	4.650.000,00	260.000,00	5,92%	6,16%

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
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.830.180,87	0,00	0,00	1.952.025,96	121.845,09	6,66%	6,66%
MAG FI MULTIMERCADO	5.656.045,20	0,00	0,00	5.777.312,80	121.267,60	2,14%	2,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.733.740,78	0,00	0,00	4.829.272,26	95.531,48	2,02%	2,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.174.421,52	0,00	0,00	4.246.653,28	72.231,76	1,73%	1,73%
ARX INCOME FIC AÇÕES	30.881.968,25	0,00	30.935.194,75	0,00	53.226,50	0,17%	18,43%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.577.870,12	0,00	0,00	2.626.561,50	48.691,38	1,89%	1,89%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	2.116.454,51	0,00	0,00	2.161.603,24	45.148,73	2,13%	2,13%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	11.210.322,51	2.286.249,00	0,00	13.500.912,20	4.340,69	0,03%	-0,65%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	304.180,09	0,00	0,00	295.154,52	-9.025,57	-2,97%	-2,97%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	5.303.547,99	0,00	0,00	5.276.981,72	-26.566,27	-0,50%	-0,50%
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	0,00	2.835.505,92	0,00	2.784.731,93	-50.773,99	-1,79%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.766.859,19	65.573,77	0,00	5.040.276,43	-792.156,53	-13,58%	-13,25%
				Total Renda Variável	57.040.029,33	16,09%	

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
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	16.727.827,80	0,00	0,00	18.026.042,30	1.298.214,50	7,76%	7,76%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	12.276.042,02	0,00	0,00	13.203.279,22	927.237,20	7,55%	7,55%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	29.198.731,19	0,00	0,00	29.988.426,30	789.695,11	2,70%	2,70%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.350.216,58	0,00	0,00	15.996.984,06	646.767,48	4,21%	4,21%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	10.418.208,12	0,00	0,00	11.014.222,74	596.014,62	5,72%	5,72%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	4.832.355,33	0,00	0,00	5.206.932,21	374.576,88	7,75%	7,75%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	27.346.391,38	0,00	0,00	27.466.101,95	119.710,57	0,44%	0,44%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	13.760.390,14	0,00	0,00	13.396.515,84	-363.874,30	-2,64%	-2,64%
				Total Exterior	4.388.342,06	3,38%	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	228.384.304,25	0,00	10.760.979,97	235.889.376,41	18.266.052,13	8,00%	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	116.084.425,68	7.576.878,62	85.434.144,02	44.866.674,19	6.639.513,91	5,37%	7,83%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	113.366.912,90	898.150,17	74.400.086,83	45.456.634,07	5.591.657,83	4,89%	6,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	83.296.931,38	332.986,91	42.913.821,07	45.510.808,36	4.794.711,14	5,73%	7,75%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	78.315.961,64	0,00	32.478.279,87	48.972.799,76	3.135.117,99	4,00%	6,30%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	43.048.296,96	1.198.020,76	20.000.000,00	26.772.798,16	2.526.480,44	5,71%	6,28%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	44.545.339,53	0,00	16.687.131,97	30.107.244,96	2.249.037,40	5,05%	6,40%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	28.249.891,17	0,00	0,00	30.469.050,54	2.219.159,37	7,86%	7,86%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	25.547.846,63	0,00	0,00	27.503.114,99	1.955.268,36	7,65%	7,65%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	27.827.294,41	0,00	0,00	29.455.760,00	1.628.465,59	5,85%	5,85%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	15.146.504,51	0,00	0,00	16.689.068,70	1.542.564,19	10,18%	10,18%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.409.310,63	14.005.201,63	5.503.628,86	28.387.990,65	1.477.107,25	4,56%	7,78%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	20.226.466,90	0,00	0,00	21.691.499,34	1.465.032,44	7,24%	7,24%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.006.818,08	129.419,59	16.244.825,91	24.239.596,99	1.348.185,23	3,44%	5,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.768.688,39	0,00	0,00	20.774.892,63	1.006.204,24	5,09%	5,09%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	14.074.077,84	331.894,55	0,00	15.272.591,12	866.618,73	6,02%	6,05%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	14.617.121,55	0,00	0,00	15.343.649,83	726.528,28	4,97%	4,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	28.030.106,39	0,00	5.400.000,00	23.313.435,77	683.329,38	2,44%	2,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.573.716,06	14.380.540,00	5.000.000,00	18.553.753,38	599.497,32	2,61%	6,66%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	7.932.355,53	0,00	0,00	8.311.824,75	379.469,22	4,78%	4,78%

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
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	9.739.440,86	6.600.000,00	9.841.127,16	6.712.140,87	213.827,17	1,31%	3,07%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	20.421.132,61	191.343.325,41	204.454.413,86	7.490.838,46	180.794,30	0,09%	2,10%
MONGERAL AEGON INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	0,00	2.394.000,00	0,00	2.548.030,87	154.030,87	6,43%	6,40%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	26.555,49	0,00	145.384,70	25.906,76	144.735,97	545,03%	-2,45%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	4.100.250,79	4.109.879,86	0,00	9.629,07	0,23%	2,45%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	1.197.217,92	1.198.020,76	0,00	802,84	0,07%	3,21%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	4.367,77	0,00	0,00	0,01	-4.367,76	-100,00%	-100,00%
				Total Renda Fixa	59.799.452,90	4,79%	

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
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	0,00	17.447.567,81	0,00	34.889.105,47	17.441.537,66	99,97%	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,00	29.668.669,27	0,00	36.382.228,72	6.713.559,45	22,63%	2,38%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	30.935.194,75	0,00	36.564.506,17	5.629.311,42	18,20%	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	28.667.562,29	0,00	0,00	32.157.460,22	3.489.897,93	12,17%	12,17%
OCCAM FIC AÇÕES	13.608.474,50	0,00	0,00	14.678.898,97	1.070.424,47	7,87%	7,87%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	1.363.028,29	0,00	160.368,67	2.161.603,24	958.943,62	70,35%	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	1.581.271,43	0,00	0,00	2.466.438,05	885.166,62	55,98%	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.670.263,76	0,00	0,00	15.117.473,26	447.209,50	3,05%	3,05%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.623.312,27	423.312,27	19,24%	7,88%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.035.984,60	0,00	0,00	4.246.653,28	210.668,68	5,22%	5,22%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.272.124,46	0,00	0,00	7.427.955,80	155.831,34	2,14%	2,14%
MAG FI MULTIMERCADO	7.721.686,51	0,00	2.100.000,00	5.777.312,80	155.626,29	2,02%	2,66%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	4.297.748,68	0,00	0,00	4.447.163,63	149.414,95	3,48%	3,48%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	0,00	4.800.000,00	0,00	4.829.272,26	29.272,26	0,61%	-
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	0,00	2.835.505,92	0,00	2.784.731,93	-50.773,99	-1,79%	-
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.706.447,80	0,00	0,00	2.626.561,50	-79.886,30	-2,95%	-2,95%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	369.217,26	9.000,00	0,00	295.154,52	-83.062,74	-21,96%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	7.523.307,55	65.573,77	2.427.986,46	5.040.276,43	-120.618,43	-1,59%	-
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	5.409.047,87	0,00	0,00	5.276.981,72	-132.066,15	-2,44%	-2,44%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.116.482,78	0,00	0,00	1.952.025,96	-164.456,82	-7,77%	-7,77%

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
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	10.278.426,07	3.455.374,00	0,00	13.500.912,20	-232.887,87	-1,70%	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.873.327,30	0,00	0,00	14.422.161,87	-451.165,43	-3,03%	-3,03%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.828.779,40	0,00	0,00	12.332.823,69	-495.955,71	-3,87%	-3,87%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	11.524.353,23	0,00	2.095.691,84	8.519.151,69	-909.509,70	-7,89%	-25,90%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	11.224.246,82	0,00	0,00	10.163.965,26	-1.060.281,56	-9,45%	-9,45%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	5.833.585,29	0,00	0,00	4.650.000,00	-1.183.585,29	-20,29%	-21,85%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.699.484,88	0,00	0,00	6.513.648,26	-1.185.836,62	-15,40%	-15,40%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	11.752.529,54	0,00	10.488.361,87	-1.264.167,67	-10,76%	-4,03%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	49.993.614,63	0,00	0,00	48.414.203,45	-1.579.411,18	-3,16%	-3,16%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	32.642.820,90	0,00	0,00	31.051.926,85	-1.590.894,05	-4,87%	-4,87%
ARX INCOME FIC AÇÕES	35.663.384,47	0,00	30.935.194,75	0,00	-4.728.189,72	-13,26%	2,55%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	32.273.994,70	0,00	17.447.567,81	0,00	-14.826.426,89	-45,94%	8,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	85.232.567,79	0,00	35.000.000,00	29.771.137,59	-20.461.430,20	-24,01%	-21,23%
Total Renda Variável					-12.840.429,86	-3,03%	

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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	0,00	16.909.344,22	0,00	29.988.426,30	13.079.082,08	77,35%	91,31%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	16.544.136,07	0,00	0,00	27.466.101,95	10.921.965,88	66,02%	66,02%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	9.915.062,20	0,00	0,00	15.996.984,06	6.081.921,86	61,34%	61,34%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,00	12.600.000,00	0,00	18.026.042,30	5.426.042,30	43,06%	51,88%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	9.976.069,92	0,00	0,00	13.396.515,84	3.420.445,92	34,29%	34,29%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	10.344.480,28	0,00	0,00	13.203.279,22	2.858.798,94	27,64%	27,64%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	10.441.033,38	0,00	0,00	11.014.222,74	573.189,36	5,49%	5,49%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	0,00	4.682.023,48	0,00	5.206.932,21	524.908,73	11,21%	-
				Total Exterior	42.886.355,07	46,92%	