

# 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
TÍTULOS PÚBLICOS			234.313.283,60	17,70%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	45.106.111,00	3,41%	443	1,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	21.323.970,47	1,61%	91	1,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	45.548.696,05	3,44%	977	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	15.220.018,64	1,15%	18.539	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	43.029.769,72	3,25%	28	1,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	16.578.808,22	1,25%	10.348	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	37.468.847,09	2,83%	188	3,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.667.752,56	1,56%	591	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	29.866.757,92	2,26%	699	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	28.415.371,52	2,15%	689	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	18.558.445,83	1,40%	892	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	42.449.886,91	3,21%	172	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO IMA B RENDA FIXA FI REFERENCIADO LP	D+3	Não há	2.523.739,40	0,19%	2.157	1,95%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	15.137.898,62	1,14%	302	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	30.462.916,62	2,30%	136	3,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	24.031.411,81	1,81%	271	1,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.682.704,71	0,50%	4.531	2,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	48.472.761,24	3,66%	117	2,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.519.677,34	2,08%	27	3,04%	Artigo 7º, Inciso IV, 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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	23.344.660,30	1,76%	264	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	11	0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	D+45 a ...	Não há	8.340.579,44	0,63%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	26.190,25	0,00%	28	4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	35.432.333,73	2,68%	5	4,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.607.163,73	0,20%	6.283	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	14.219.904,72	1,07%	3.179	1,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	32.704.664,39	2,47%	15.202	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	10.287.659,59	0,78%	35	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.881.387,29	0,14%	2.993	0,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.313.531,68	0,33%	1.339	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.254.411,47	0,55%	55	0,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	30.597.326,57	2,31%	41.775	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.716.756,10	1,04%	347	3,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.971.083,51	0,45%	2.845	2,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	28.905.940,88	2,18%	134	1,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	47.487.759,70	3,59%	5.938	2,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	9.765.858,77	0,74%	8.840	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	35.239.677,97	2,66%	121	4,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	14.548.657,78	1,10%	160	1,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

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

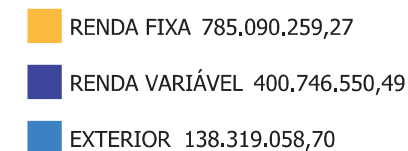
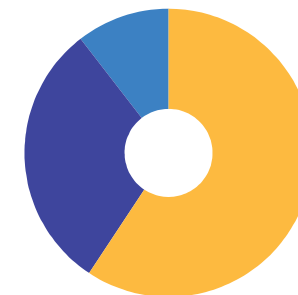
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	12.007.462,83	0,91%	10.322	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC...	D+2	22 meses	4.803.995,40	0,36%	668	4,38%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC ...	D+2	27 meses	4.230.938,54	0,32%	723	4,12%	Artigo 8º, Inciso III
ITAU VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.627.082,12	0,20%	11	4,44%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	32.106.271,37	2,42%	24.942	2,60%	Artigo 8º, Inciso III
MAG FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.764.113,10	0,44%	52	4,29%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	5.274.820,18	0,40%	3.658	2,98%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I M...	Não se ...	Não se aplica	13.453.035,70	1,02%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.780.110,34	0,21%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.039.322,59	0,38%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FI...	Não se ...	Não se aplica	2.685.378,28	0,20%	46	3,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.192.169,27	0,17%	39	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se ...	Não se aplica	294.850,12	0,02%	19	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	7.953.582,77	0,60%		5,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.599.300,00	0,35%		4,18%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	5.533.189,85	0,42%	22	6,71%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	18.908.802,64	1,43%	53	1,28%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR I...	D+5 du	Não há	13.780.870,58	1,04%	1.718	10,55%	Artigo 9º - A, Inciso II
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVES...	D+5 du	Não há	12.921.616,84	0,98%	2.733	6,48%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO N...	D+5 du	Não há	10.736.638,88	0,81%	57	1,05%	Artigo 9º - A, Inciso II

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	16.898.777,96	1,28%	7.869	1,46%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	31.278.652,76	2,36%	17.343	2,12%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	28.260.509,19	2,13%	109.569	1,11%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>1.324.155.868,46</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>1.077.288,49</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>1.325.233.156,95</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	234.313.283,60	17,70%	17,00%	25,00%	40,00%	295.349.063,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	364.234.435,93	27,51%	20,00%	22,00%	50,00%	297.843.498,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	17.661.638,02	1,33%	1,00%	5,00%	35,00%	445.792.915,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	160.514.132,02	12,12%	1,00%	6,00%	40,00%	369.148.215,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	8.366.769,70	0,63%	1,00%	2,00%	3,00%	31.357.906,35
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>785.090.259,27</b>	<b>59,29%</b>	<b>40,00%</b>	<b>60,00%</b>	<b>168,00%</b>	



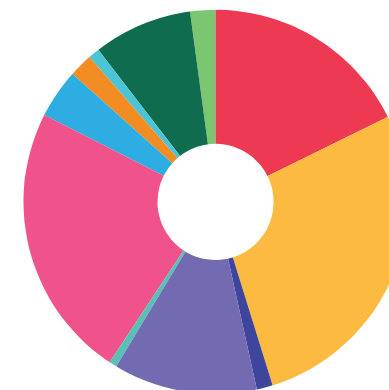
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	0,00	0,00%	1,00%	1,00%	5,00%	66.207.793,42
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	306.941.580,71	23,18%	6,00%	18,00%	25,00%	24.097.386,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	54.807.220,71	4,14%	1,00%	6,00%	10,00%	77.608.366,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	26.444.866,30	2,00%	1,00%	3,00%	3,00%	13.279.809,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	12.552.882,77	0,95%	1,00%	2,00%	5,00%	53.654.910,65
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>400.746.550,49</b>	<b>30,26%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>48,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	110.058.549,51	8,31%	1,00%	8,00%	10,00%	22.357.037,34
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	28.260.509,19	2,13%	1,00%	2,00%	10,00%	104.155.077,66
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>138.319.058,70</b>	<b>10,45%</b>	<b>2,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	234.313.283,60	17,70	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	139.847.281,68	10,56	0,03
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	133.386.085,44	10,07	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	121.890.096,45	9,21	0,01
WESTERN ASSET	114.384.715,08	8,64	0,23
ITAÚ UNIBANCO	99.191.765,97	7,49	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	81.740.407,01	6,17	0,28
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	78.935.677,86	5,96	0,01
VINCI PARTNERS	54.101.867,43	4,09	0,04
ICATU VANGUARDA	37.285.536,11	2,82	0,09
ARX INVESTIMENTOS	35.432.333,73	2,68	0,12
MOAT CAPITAL	32.704.664,39	2,47	0,23
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	31.278.652,76	2,36	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	21.323.970,47	1,61	0,00
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	18.492.358,29	1,40	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	15.220.018,64	1,15	0,05
OCCAM BRASIL	14.219.904,72	1,07	0,05
OLIVEIRA TRUST	8.340.579,44	0,63	0,07
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	8.287.852,50	0,63	0,12
BV ASSET	7.953.582,77	0,60	-
ITAÚ DTVM	7.254.411,47	0,55	0,00
XP GESTÃO DE RECURSOS	5.971.083,51	0,45	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.533.189,85	0,42	0,12
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.599.300,00	0,35	0,05
VINCI DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS...	2.665.376,28	0,20	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.607.163,73	0,20	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.192.169,27	0,17	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		



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>CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)</b>	0,24%	0,24%	0,76%	1,54%	3,74%	11,06%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	0,35%	0,35%	1,08%	2,73%	4,64%	11,91%	-	-
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	-0,44%	-0,44%	2,38%	0,96%	3,87%	15,36%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,55%	2,68%	0,93%	4,00%	15,84%	0,01%	0,04%
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,42%	0,42%	1,32%	2,68%	6,07%	16,15%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,09%	1,09%	3,86%	-9,53%	-6,28%	-2,61%	-	0,52%
<b>120% do CDI (Benchmark)</b>	0,18%	0,18%	0,56%	1,13%	3,04%	10,23%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,00%	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-
<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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	3,22%	3,67%	7,34%	20,02%	0,01%	0,03%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-0,02%	-0,02%	3,08%	3,45%	7,24%	19,88%	0,01%	0,04%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,66%	-0,66%	4,04%	2,59%	8,48%	24,20%	0,02%	0,06%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	0,06%	0,06%	3,20%	3,47%	7,11%	19,80%	0,01%	0,04%

## 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>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,86%	-0,86%	5,93%	2,59%	4,73%	23,34%	0,03%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,02%	-1,02%	5,96%	2,45%	4,93%	23,74%	0,03%	0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,88%	-0,88%	5,95%	2,59%	4,88%	23,40%	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%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,88%	-0,88%	5,96%	2,62%	4,67%	23,27%	0,03%	0,11%
MAG INFLAÇÃO IMA B RENDA FIXA FI REFERENCIADO LP	-0,95%	-0,95%	6,08%	2,35%	5,07%	23,87%	0,03%	0,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,81%	-0,81%	5,65%	2,91%	4,49%	22,68%	0,02%	0,11%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,15%	4,92%	16,95%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,30%	4,65%	16,40%	0,02%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,77%	-0,77%	1,51%	-0,25%	4,73%	16,38%	0,02%	0,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,79%	-0,79%	1,55%	-0,31%	4,55%	16,31%	0,02%	0,03%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	-0,44%	-0,44%	0,18%	-0,24%	2,14%	10,54%	0,00%	0,01%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
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%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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 + 15,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,37%	1,37%	6,09%	11,79%	20,04%	43,92%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	1,41%	1,41%	3,69%	7,70%	-	53,53%	0,03%	0,26%
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-1,11%	-1,11%	13,59%	13,55%	15,15%	37,36%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-0,16%	-0,16%	14,05%	13,28%	11,59%	37,59%	0,08%	0,27%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,79%	0,79%	4,23%	7,86%	11,79%	24,66%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-1,51%	-1,51%	4,33%	-3,57%	-26,13%	-13,59%	0,20%	0,15%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-5,08%	-5,08%	18,30%	8,08%	-4,52%	21,27%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,76%	-3,76%	20,27%	10,03%	-2,32%	25,54%	0,10%	0,38%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-8,33%	-8,33%	10,21%	-3,90%	-23,56%	5,06%	0,11%	0,39%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,92%	-3,92%	17,82%	4,29%	-13,53%	10,48%	0,10%	0,39%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-2,34%	-2,34%	20,39%	10,30%	-0,91%	22,60%	0,12%	0,43%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,62%	-3,62%	4,65%	-5,71%	-12,96%	15,42%	0,11%	0,43%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,89%	-4,89%	19,37%	8,09%	-4,89%	12,27%	0,11%	0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,62%	-0,62%	13,66%	7,92%	5,08%	38,70%	0,13%	0,43%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,64%	-2,64%	14,42%	4,55%	-9,84%	12,05%	0,12%	0,46%

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
OCCAM FIC AÇÕES	-3,13%	-3,13%	19,35%	9,66%	3,51%	29,87%	0,13%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-2,91%	-2,91%	19,43%	1,12%	-24,63%	-1,24%	0,13%	0,53%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,46%	-1,46%	17,60%	12,10%	-6,09%	23,46%	0,11%	0,43%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	-3,01%	-3,01%	19,70%	8,71%	-1,35%	32,08%	0,12%	0,42%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO	-0,37%	-0,37%	1,92%	0,16%	4,17%	-	0,01%	0,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	-0,52%	-0,52%	2,29%	-	-	-	0,01%	-
<b>SMLL (Benchmark)</b>	<b>-3,43%</b>	<b>-3,43%</b>	<b>21,10%</b>	<b>10,52%</b>	<b>-4,50%</b>	<b>38,71%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,91%	-1,91%	17,05%	4,39%	-10,96%	33,55%	0,14%	0,48%
<b>CDI (Benchmark)</b>	<b>0,15%</b>	<b>0,15%</b>	<b>0,46%</b>	<b>0,94%</b>	<b>2,53%</b>	<b>8,46%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
MAG FI MULTIMERCADO	-0,23%	-0,23%	1,74%	1,35%	2,32%	7,41%	0,01%	0,02%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	-0,04%	-0,04%	0,09%	-1,72%	-3,38%	3,63%	0,01%	0,02%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,02%	0,02%	1,37%	1,58%	-2,71%	-	0,01%	0,07%
<b>IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)</b>	<b>0,97%</b>	<b>0,97%</b>	<b>4,82%</b>	<b>9,10%</b>	<b>14,37%</b>	<b>30,53%</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-0,10%	-0,10%	-2,85%	-21,08%	-	-24,73%	0,00%	0,33%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-6,68%	-6,68%	5,70%	-11,70%	-29,80%	-17,06%	0,11%	0,65%

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
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,14%	-3,14%	19,35%	8,34%	-2,73%	31,72%	0,12%	0,42%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,02%	-0,02%	-0,30%	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FI...	-0,36%	-0,36%	1,05%	-	-	-	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	-4,29%	-4,29%	53,54%	-	-	92,46%	-	0,63%
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,10%	-3,10%	-	-	-	-	0,10%	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,91%	-1,91%	17,10%	4,52%	-11,40%	-	0,14%	0,48%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	-6,26%	-6,26%	16,46%	1,60%	-	-	0,11%	-

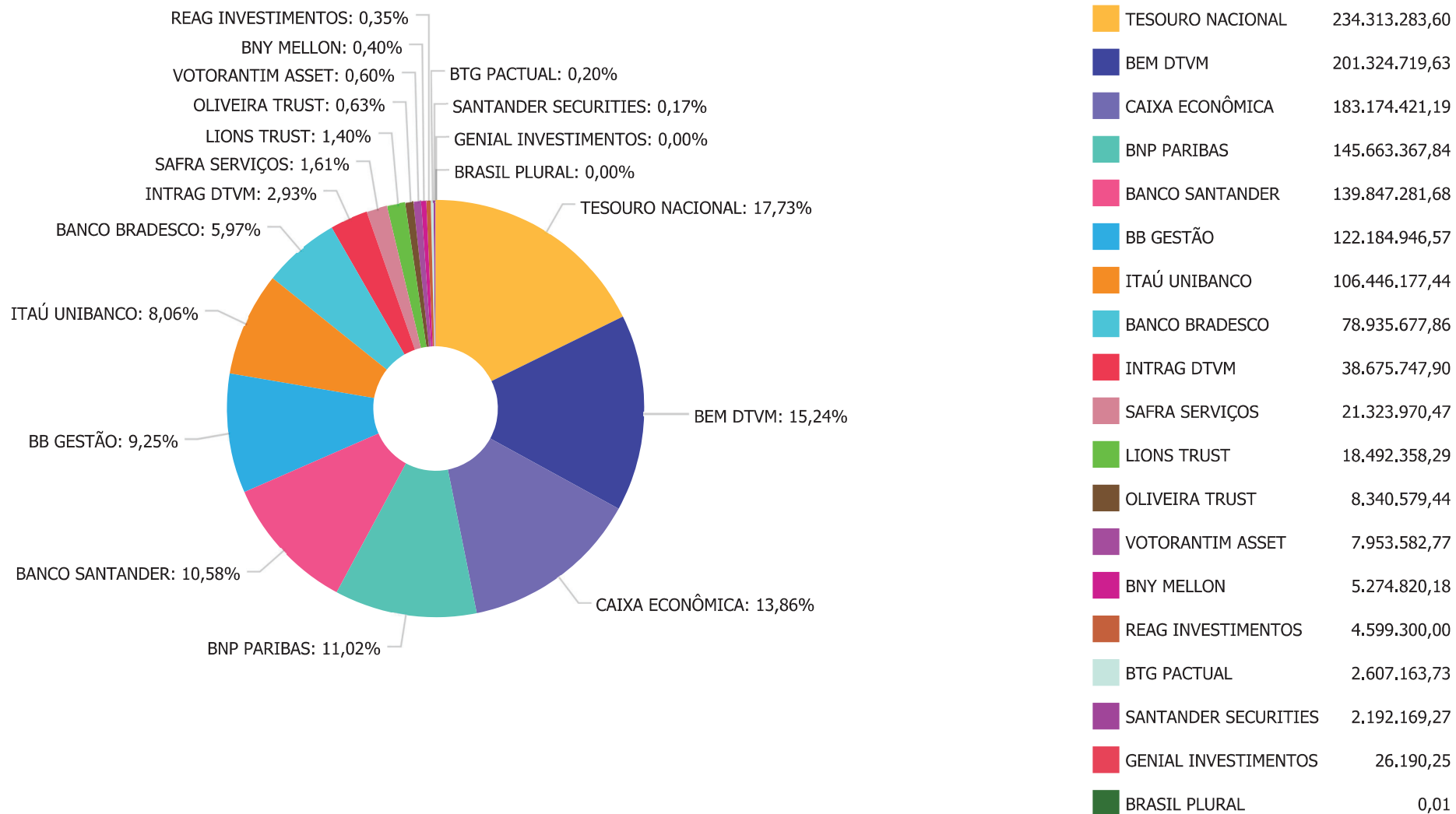
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	6,11%	6,11%	9,83%	21,25%	53,50%	120,12%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,89%	2,89%	5,70%	18,48%	59,07%	128,83%	0,12%	0,24%

<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	4,30%	4,30%	8,24%	27,17%	83,37%	-	0,13%	0,21%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MUL...	-2,52%	-2,52%	4,38%	2,08%	3,08%	17,27%	0,03%	0,16%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INVESTIMENTO NO EX...	2,87%	2,87%	-0,52%	6,60%	30,49%	68,96%	0,09%	0,11%

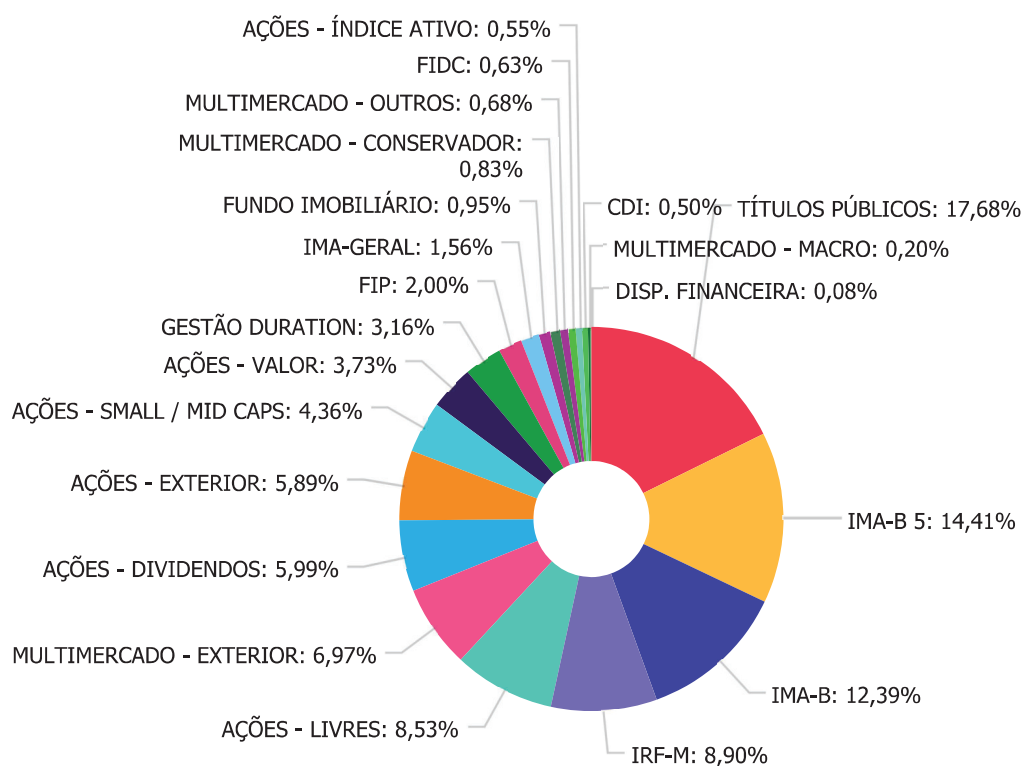
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	5,64%	5,64%	10,77%	23,80%	60,10%	112,76%	0,11%	0,20%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	4,90%	4,90%	15,18%	24,80%	48,52%	108,33%	0,11%	0,21%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6,27%	6,27%	11,76%	-	-	-	0,12%	-
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERI...	-2,13%	-2,13%	9,42%	10,42%	23,78%	50,31%	0,08%	0,25%

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





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



TÍTULOS PÚBLICOS	234.313.283,60
IMA-B 5	190.975.356,66
IMA-B	164.178.647,27
IRF-M	118.002.638,64
AÇÕES - LIVRES	113.017.477,37
MULTIMERCADO - EXTERIOR	92.431.361,43
AÇÕES - DIVIDENDOS	79.434.689,89
AÇÕES - EXTERIOR	77.993.968,64
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	57.775.419,29
AÇÕES - VALOR	49.459.582,69
GESTÃO DURATION	41.903.106,13
FIP	26.444.866,30
IMA-GERAL	20.667.752,56
FUNDO IMOBILIÁRIO	12.552.882,77
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	11.038.933,28
MULTIMERCADO - OUTROS	9.034.933,94
FIDC	8.366.769,70
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.254.411,47
CDI	6.682.704,71

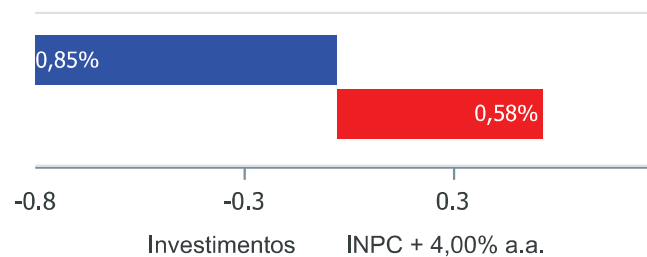
## Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2021)

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	3.572,294072	10.097.369,17	12.324.414,55	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7.600	3.031,376224	3.864,322576	23.038.459,30	29.368.851,58	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2.000	2.593,340767	3.864,322576	5.186.681,53	7.728.645,15	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.132,495619	10.048.181,87	14.050.485,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8.500	3.097,511439	4.478,135969	26.328.847,23	38.064.155,74	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6.000	3.097,511438	4.478,135969	18.585.068,63	26.868.815,81	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.478,135969	7.520.551,00	14.330.035,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3.450	2.896,880939	4.478,135969	9.994.239,24	15.449.569,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	13.000	3.271,849021	4.478,135969	42.534.037,27	58.215.767,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.478,135969	13.087.396,08	17.912.543,88	Mercado

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	1.320.231.395,12	35.973.755,95	20.636.329,22	1.324.155.868,46	-11.412.953,39	-11.412.953,39	-0,85%	-0,85%	0,58%	0,58%	-146,68%	6,17%

Investimentos x Meta Atuarial



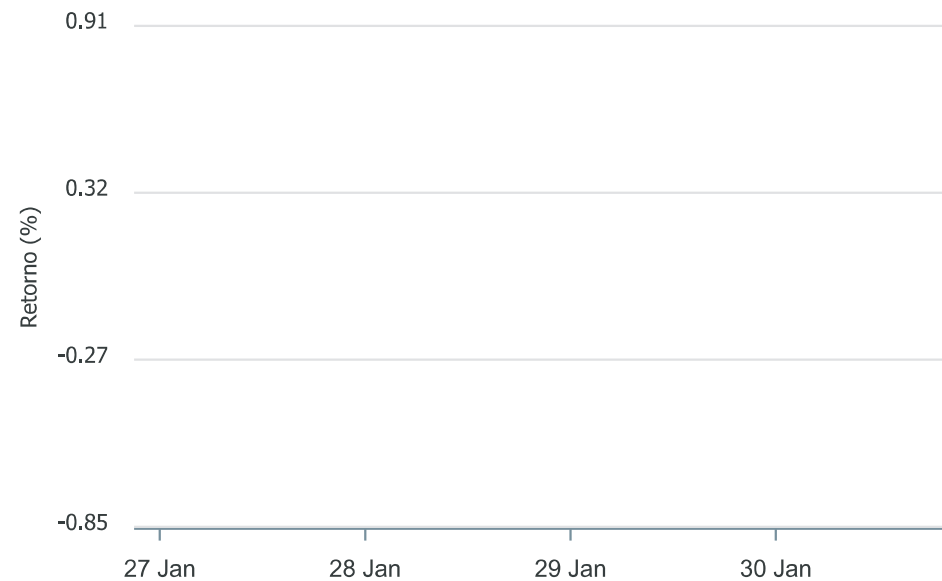
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	25.906,76	0,00	0,00	26.190,25	283,49	1,09%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	8.311.824,75	0,00	0,00	8.340.579,44	28.754,69	0,35%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	7.490.838,46	0,00	7.503.178,52	0,00	12.340,06	0,16%	0,18%	0,02%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.313.435,77	0,00	0,00	23.344.660,30	31.224,53	0,13%	0,13%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	28.387.990,65	0,00	0,00	28.415.371,52	27.380,87	0,10%	0,10%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	45.510.808,36	0,00	0,00	45.548.696,05	37.887,69	0,08%	0,08%	1,04%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	44.866.674,19	4.401.260,17	6.847.973,68	42.449.886,91	29.926,23	0,06%	0,08%	1,04%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	27.503.114,99	0,00	0,00	27.519.677,34	16.562,35	0,06%	0,06%	1,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	18.553.753,38	0,00	0,00	18.558.445,83	4.692,45	0,03%	0,03%	0,76%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNI...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	30.469.050,54	0,00	0,00	30.462.916,62	-6.133,92	-0,02%	-0,02%	1,21%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.712.140,87	0,00	0,00	6.682.704,71	-29.436,16	-0,44%	-0,44%	0,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.774.892,63	7.598,48	0,00	20.667.752,56	-114.738,55	-0,55%	-0,55%	1,42%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.689.068,70	0,00	0,00	16.578.808,22	-110.260,48	-0,66%	-0,66%	2,17%
TÍTULOS PÚBLICOS	235.889.376,41	0,00	0,00	234.313.283,60	-1.576.092,81	-0,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	45.456.634,07	0,00	0,00	45.106.111,00	-350.523,07	-0,77%	-0,77%	1,53%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.772.798,16	16.602.264,72	0,00	43.029.769,72	-345.293,16	-0,80%	-0,79%	1,53%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	30.107.244,96	0,00	0,00	29.866.757,92	-240.487,04	-0,80%	-0,80%	1,53%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	15.343.649,83	0,00	0,00	15.220.018,64	-123.631,19	-0,81%	-0,81%	2,24%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.239.596,99	0,00	0,00	24.031.411,81	-208.185,18	-0,86%	-0,86%	2,59%

## 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
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	15.272.591,12	0,00	0,00	15.137.898,62	-134.692,50	-0,88%	-0,88%	2,57%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	29.455.760,00	14.697.632,58	6.285.177,02	37.468.847,09	-399.368,47	-0,90%	-0,88%	2,58%
MAG INFLAÇÃO IMA B RENDA FIXA FI REFERENCIADO LP	2.548.030,87	0,00	0,00	2.523.739,40	-24.291,47	-0,95%	-0,95%	2,69%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	48.972.799,76	0,00	0,00	48.472.761,24	-500.038,52	-1,02%	-1,02%	2,80%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	21.691.499,34	0,00	0,00	21.323.970,47	-367.528,87	-1,69%	-1,69%	3,11%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>774.359.481,57</b>	<b>35.708.755,95</b>	<b>20.636.329,22</b>	<b>785.090.259,27</b>	<b>-4.341.649,03</b>	<b>-0,55%</b>		<b>1,64%</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
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	2.161.603,24	0,00	0,00	2.192.169,27	30.566,03	1,41%	1,41%	2,59%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.626.561,50	0,00	0,00	2.627.082,12	520,62	0,02%	0,02%	1,21%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.040.276,43	0,00	0,00	5.039.322,59	-953,84	-0,02%	-	-
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	5.276.981,72	0,00	0,00	5.274.820,18	-2.161,54	-0,04%	-0,04%	0,85%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	295.154,52	0,00	0,00	294.850,12	-304,40	-0,10%	-0,10%	0,00%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32.157.460,22	0,00	0,00	32.106.271,37	-51.188,85	-0,16%	-0,16%	8,08%
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	2.784.731,93	0,00	0,00	2.780.110,34	-4.621,59	-0,17%	-	-
MAG FI MULTIMERCADO	5.777.312,80	0,00	0,00	5.764.113,10	-13.199,70	-0,23%	-0,23%	1,13%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	13.500.912,20	0,00	0,00	13.453.035,70	-47.876,50	-0,35%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.246.653,28	0,00	0,00	4.230.938,54	-15.714,74	-0,37%	-0,37%	0,87%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.829.272,26	0,00	0,00	4.803.995,40	-25.276,86	-0,52%	-0,52%	0,96%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.623.312,27	0,00	0,00	2.607.163,73	-16.148,54	-0,62%	-0,62%	13,20%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.650.000,00	0,00	0,00	4.599.300,00	-50.700,00	-1,09%	-1,51%	19,92%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	31.051.926,85	0,00	0,00	30.597.326,57	-454.600,28	-1,46%	-1,46%	10,78%
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	2.466.438,05	265.000,00	0,00	2.685.378,28	-46.059,77	-1,69%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.488.361,87	0,00	0,00	10.287.659,59	-200.702,28	-1,91%	-1,91%	14,19%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	48.414.203,45	0,00	0,00	47.487.759,70	-926.443,75	-1,91%	-1,91%	14,28%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.427.955,80	0,00	0,00	7.254.411,47	-173.544,33	-2,34%	-2,34%	11,57%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.332.823,69	0,00	0,00	12.007.462,83	-325.360,86	-2,64%	-2,64%	11,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	29.771.137,59	0,00	0,00	28.905.940,88	-865.196,71	-2,91%	-2,91%	13,45%

## 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
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	4.447.163,63	0,00	0,00	4.313.531,68	-133.631,95	-3,00%	-3,00%	12,20%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	36.564.506,17	0,00	0,00	35.432.333,73	-1.132.172,44	-3,10%	-3,10%	10,26%
OCCAM FIC AÇÕES	14.678.898,97	0,00	0,00	14.219.904,72	-458.994,25	-3,13%	-3,13%	13,08%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	36.382.228,72	0,00	0,00	35.239.677,97	-1.142.550,75	-3,14%	-3,14%	11,99%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.952.025,96	0,00	0,00	1.881.387,29	-70.638,67	-3,62%	-3,62%	10,54%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.117.473,26	0,00	0,00	14.548.657,78	-568.815,48	-3,76%	-3,76%	10,41%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.163.965,26	0,00	0,00	9.765.858,77	-398.106,49	-3,92%	-3,92%	9,60%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.422.161,87	0,00	0,00	13.716.756,10	-705.405,77	-4,89%	-4,89%	11,19%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	34.889.105,47	0,00	0,00	32.704.664,39	-2.184.441,08	-6,26%	-6,26%	11,36%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	8.519.151,69	0,00	0,00	7.953.582,77	-565.568,92	-6,64%	-6,68%	11,16%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.513.648,26	0,00	0,00	5.971.083,51	-542.564,75	-8,33%	-8,33%	11,36%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>411.573.408,93</b>	<b>265.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>400.746.550,49</b>	<b>-11.091.858,44</b>	<b>-2,69%</b>		<b>11,02%</b>



# CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE SÃO BERNARDO DO CAMPO - SBCPREV  
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
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	5.206.932,21	0,00	0,00	5.533.189,85	326.257,64	6,27%	6,27%	11,97%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.996.984,06	0,00	0,00	16.898.777,96	901.793,90	5,64%	5,64%	11,37%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	18.026.042,30	0,00	0,00	18.908.802,64	882.760,34	4,90%	4,90%	11,48%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	29.988.426,30	0,00	0,00	31.278.652,76	1.290.226,46	4,30%	4,30%	12,51%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	27.466.101,95	0,00	0,00	28.260.509,19	794.407,24	2,89%	2,89%	12,31%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	13.396.515,84	0,00	0,00	13.780.870,58	384.354,74	2,87%	2,87%	9,46%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	13.203.279,22	0,00	0,00	12.921.616,84	-281.662,38	-2,13%	-2,13%	8,18%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	11.014.222,74	0,00	0,00	10.736.638,88	-277.583,86	-2,52%	-2,52%	3,21%
<b>Total Exterior</b>	<b>134.298.504,62</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>138.319.058,70</b>	<b>4.020.554,08</b>	<b>2,99%</b>		<b>10,74%</b>