

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			228.833.929,36	17,30%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	28.246.161,34	2,14%	706	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	18.464.253,83	1,40%	903	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.478.862,48	1,55%	598	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	20.922.467,97	1,58%	89	2,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	52.199.824,50	3,95%	180	3,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	44.585.991,21	3,37%	437	2,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	15.020.340,81	1,14%	18.008	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	45.610.015,51	3,45%	989	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	16.328.550,76	1,23%	11.427	1,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	42.529.728,89	3,22%	27	1,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	29.511.169,84	2,23%	692	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	36.894.907,03	2,79%	183	3,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI...	D+3	Não há	2.483.123,64	0,19%	2.101	1,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	14.903.090,38	1,13%	303	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	23.657.545,00	1,79%	272	1,77%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	30.221.928,91	2,28%	137	2,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.667.942,16	0,50%	4.137	2,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	47.637.049,21	3,60%	120	2,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.344.462,20	2,07%	31	3,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	47.637.049,21	3,60%	120	2,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.344.462,20	2,07%	31	3,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	D+45 a ...	Não há	8.366.543,70	0,63%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, 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 '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	22.132,32	0,00%	28	4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	9.394.242,96	0,71%	8.091	0,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	33.693.045,11	2,55%	123	4,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.719.227,62	0,89%	9.885	1,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	47.872.105,14	3,62%	5.915	2,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	34.142.394,87	2,58%	5	4,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.541.256,63	0,19%	6.286	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	13.741.697,10	1,04%	3.180	1,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	30.756.493,23	2,33%	15.066	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	10.367.148,92	0,78%	35	0,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.834.696,09	0,14%	2.885	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	13.921.199,88	1,05%	164	1,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.176.658,51	0,32%	1.282	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.974.948,00	0,53%	55	0,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	30.742.148,00	2,32%	40.797	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.732.382,94	0,43%	2.734	3,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

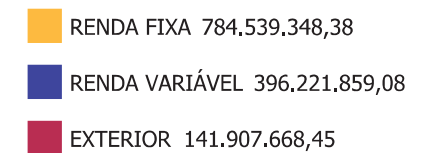
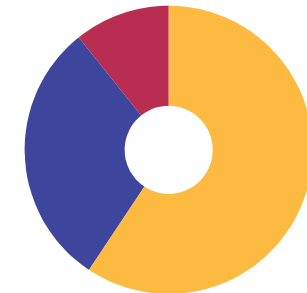
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	13.921.199,88	1,05%	164	1,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	27.663.151,72	2,09%	132	1,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	32.962.550,16	2,49%	27.594	2,53%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC...	D+2	22 meses	4.776.248,34	0,36%	668	4,37%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC ...	D+2	27 meses	4.208.247,34	0,32%	723	4,11%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.619.527,89	0,20%	11	4,33%	Artigo 8º, Inciso III
MAG FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.737.926,87	0,43%	50	4,45%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	5.294.551,76	0,40%	3.427	3,42%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.067.775,19	0,38%		14,08%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I M...	Não se ...	Não se aplica	17.681.996,18	1,34%		6,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.779.728,12	0,21%	99	0,70%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.542.759,38	0,19%	39	0,46%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FI...	Não se ...	Não se aplica	2.676.296,45	0,20%	46	3,39%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se ...	Não se aplica	294.574,24	0,02%	19	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	6.854.824,83	0,52%		5,82%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.381.600,00	0,33%		4,16%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	5.828.870,26	0,44%	35	4,47%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	20.072.344,70	1,52%	58	1,24%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO N...	D+5 du	Não há	10.381.293,38	0,78%	57	1,05%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR I...	D+5 du	Não há	13.566.971,72	1,03%	1.713	10,58%	Artigo 9º - A, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO N...	D+5 du	Não há	10.381.293,38	0,78%	57	1,05%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	17.675.900,94	1,34%	8.896	1,31%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	32.660.754,30	2,47%	19.795	1,91%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	28.835.394,29	2,18%	118.461	1,05%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.322.668.875,91				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			7.899.132,59				Artigo 6º
PL Total			1.330.568.008,50				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 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%	228.833.929,36	17,30%	17,00%	25,00%	40,00%	300.233.621,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	370.792.274,17	28,03%	20,00%	22,00%	50,00%	290.542.163,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	17.386.214,02	1,31%	1,00%	5,00%	35,00%	445.547.892,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	159.138.254,80	12,03%	1,00%	6,00%	40,00%	369.929.295,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	8.388.676,03	0,63%	1,00%	2,00%	3,00%	31.291.390,25
Total Renda Fixa	100,00%	784.539.348,38	59,31%	40,00%	60,00%	168,00%	



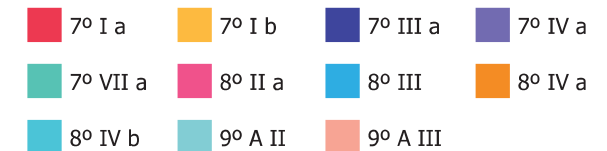
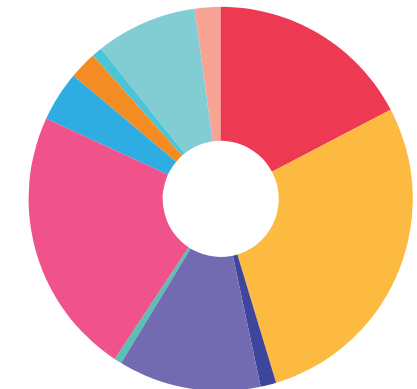
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 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%	66.133.443,80
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	298.343.252,33	22,56%	6,00%	18,00%	25,00%	32.323.966,65
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	55.599.052,36	4,20%	1,00%	6,00%	10,00%	76.667.835,23
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	31.043.129,56	2,35%	1,00%	3,00%	3,00%	8.636.936,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	11.236.424,83	0,85%	1,00%	2,00%	5,00%	54.897.018,97
Total Renda Variável	35,00%	396.221.859,08	29,96%	10,00%	30,00%	48,00%	

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%	113.072.274,16	8,55%	1,00%	8,00%	10,00%	19.194.613,43
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	28.835.394,29	2,18%	1,00%	2,00%	10,00%	103.431.493,30
Total Exterior	10,00%	141.907.668,45	10,73%	2,00%	10,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	228.833.929,36	17,30	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	149.551.067,04	11,31	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	132.547.846,61	10,02	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	121.966.083,36	9,22	-
WESTERN ASSET	114.960.899,17	8,69	-
ITAÚ UNIBANCO	97.453.904,86	7,37	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	81.920.975,60	6,19	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	77.858.978,12	5,89	-
VINCI PARTNERS	51.790.903,50	3,92	-
ICATU VANGUARDA	36.738.705,16	2,78	-
ARX INVESTIMENTOS	34.142.394,87	2,58	-
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	32.660.754,30	2,47	-
MOAT CAPITAL	30.756.493,23	2,33	-
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	22.749.771,37	1,72	-
BANCO J. SAFRA S/A	20.922.467,97	1,58	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	15.020.340,81	1,14	-
OCCAM BRASIL	13.741.697,10	1,04	-
OLIVEIRA TRUST	8.366.543,70	0,63	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	8.221.050,51	0,62	-
ITAÚ DTVM	6.974.948,00	0,53	-
BV ASSET	6.854.824,83	0,52	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.828.870,26	0,44	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	5.732.382,94	0,43	-
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.381.600,00	0,33	-
VINCI DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS...	2.676.296,45	0,20	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.542.759,38	0,19	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.541.256,63	0,19	-

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 Fevereiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	0,22%	0,46%	0,73%	1,50%	3,58%	10,66%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	0,31%	0,66%	1,04%	2,13%	4,57%	11,60%	-	-
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,83%	-1,26%	0,83%	0,82%	2,55%	13,91%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,91%	-1,46%	0,88%	0,90%	2,59%	14,34%	1,11%	0,05%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,38%	0,81%	1,28%	2,61%	5,90%	15,70%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-15,49%	-14,57%	-16,34%	-33,01%	-21,22%	-18,49%	-	0,55%
120% do CDI (Benchmark)	0,16%	0,34%	0,54%	1,10%	2,84%	9,76%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,60%	-0,49%	1,33%	2,75%	6,23%	19,15%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,62%	-0,54%	1,27%	2,60%	5,92%	18,50%	1,17%	0,04%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	-0,59%	-0,51%	1,29%	2,64%	6,04%	18,67%	1,15%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,62%	-0,52%	1,28%	2,64%	5,94%	18,61%	1,16%	0,04%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-0,79%	-0,81%	0,95%	2,20%	5,70%	18,35%	1,33%	0,04%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-1,51%	-2,16%	1,01%	1,35%	5,76%	21,87%	1,92%	0,06%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	-0,64%	-0,58%	1,22%	2,47%	5,77%	18,41%	1,17%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	-1,52%	-2,36%	2,38%	3,07%	3,16%	21,74%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,56%	-2,40%	2,29%	2,83%	2,69%	20,79%	2,33%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,72%	-2,73%	2,08%	2,57%	2,65%	20,97%	2,88%	0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,55%	-2,42%	2,32%	2,91%	2,80%	20,82%	2,32%	0,11%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-1,88%	-3,55%	1,79%	1,48%	2,47%	21,09%	2,78%	0,12%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-1,31%	-2,11%	2,38%	3,42%	3,26%	20,42%	2,29%	0,11%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-1,53%	-2,40%	2,31%	2,93%	2,63%	20,75%	2,32%	0,11%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	-1,61%	-2,55%	2,34%	2,63%	2,96%	21,26%	2,38%	0,11%

IRF-M (Benchmark)	-1,18%	-1,97%	-0,06%	-0,58%	3,01%	15,23%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,19%	-1,98%	-0,05%	-0,68%	2,76%	14,70%	1,02%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,15%	-1,92%	0,01%	-0,63%	2,88%	14,72%	1,03%	0,04%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,16%	-1,94%	0,01%	-0,63%	2,68%	14,64%	1,03%	0,04%

CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	-0,22%	-0,66%	-0,22%	-0,44%	1,23%	9,95%	0,19%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,11%	0,29%	0,57%	0,96%	1,73%	7,20%	0,02%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,86%	1,11%	2,48%	4,95%	5,20%	9,41%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,06%	0,19%	0,40%	0,35%	2,45%	12,28%	0,01%	0,01%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,51%	-0,48%	0,83%	1,04%	4,64%	19,53%	0,95%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,87%	3,27%	5,94%	12,29%	20,77%	44,37%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	15,99%	17,63%	20,42%	20,01%	-	62,69%	0,00%	0,24%
S&P 500 (Benchmark)	2,61%	1,47%	5,23%	8,88%	29,01%	36,87%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,67%	2,50%	5,77%	8,77%	23,86%	36,61%	6,70%	0,25%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	2,15%	4,14%	8,44%	12,47%	25,13%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-4,37%	-5,81%	-2,89%	-3,95%	-28,78%	-20,36%	16,17%	0,15%
IDIV (Benchmark)	-5,21%	-10,02%	-1,98%	7,65%	-3,53%	17,34%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-4,31%	-7,91%	0,72%	9,47%	-0,18%	19,66%	11,89%	0,38%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,00%	-11,99%	-4,76%	-3,01%	-21,19%	2,63%	10,28%	0,38%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,81%	-7,57%	-0,21%	5,04%	-10,56%	8,41%	8,10%	0,38%
Ibovespa (Benchmark)	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-3,85%	-6,10%	1,76%	9,34%	3,30%	19,80%	10,80%	0,42%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,48%	-6,01%	-1,68%	-6,12%	-11,95%	13,61%	7,79%	0,43%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,71%	-9,37%	-0,97%	8,47%	-1,87%	9,80%	11,82%	0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,53%	-3,13%	1,94%	5,65%	10,28%	37,75%	8,73%	0,42%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,40%	-4,98%	2,32%	4,10%	-4,06%	12,03%	11,82%	0,45%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
OCCAM FIC AÇÕES	-3,36%	-6,39%	3,08%	8,40%	10,55%	27,02%	12,80%	0,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,30%	-7,08%	0,32%	0,73%	-20,50%	-4,05%	10,53%	0,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,47%	-1,00%	5,24%	12,85%	4,60%	25,63%	10,10%	0,41%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	-3,17%	-6,08%	2,56%	10,61%	0,99%	31,29%	9,24%	0,42%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO	-0,54%	-0,90%	0,31%	-0,03%	3,21%	-	1,06%	0,03%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	-0,58%	-1,10%	0,23%	-0,52%	-	-	1,04%	-
SMLL (Benchmark)	-1,84%	-5,21%	1,92%	9,84%	2,20%	38,68%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,81%	-1,12%	5,73%	8,73%	-4,31%	38,63%	11,62%	0,48%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
MAG FI MULTIMERCADO	-0,45%	-0,68%	0,39%	0,76%	2,11%	6,65%	1,04%	0,02%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,37%	0,33%	0,93%	-0,81%	-3,51%	4,13%	1,23%	0,02%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,29%	-0,27%	0,69%	1,09%	-0,89%	-	1,10%	0,06%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,52%	2,51%	4,72%	9,66%	15,06%	30,99%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	-0,09%	-0,20%	-5,08%	-3,35%	-	-24,69%	0,00%	0,31%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-14,01%	-19,76%	-24,57%	-14,59%	-25,10%	-29,77%	15,08%	0,63%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,39%	-7,39%	1,02%	8,83%	-0,22%	28,90%	10,78%	0,42%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,57%	0,55%	0,45%	-13,11%	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FI...	31,44%	30,97%	31,45%	27,48%	-	-	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	-0,34%	-4,61%	54,62%	49,70%	-	98,18%	0,37%	0,63%
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,25%	-	-	-	-	-	-	-
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,64%	-6,62%	1,07%	-	-	-	11,44%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,77%	-1,16%	5,69%	8,74%	-5,01%	-	11,67%	0,48%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	-5,96%	-11,85%	-5,63%	-0,81%	-	-	14,42%	-

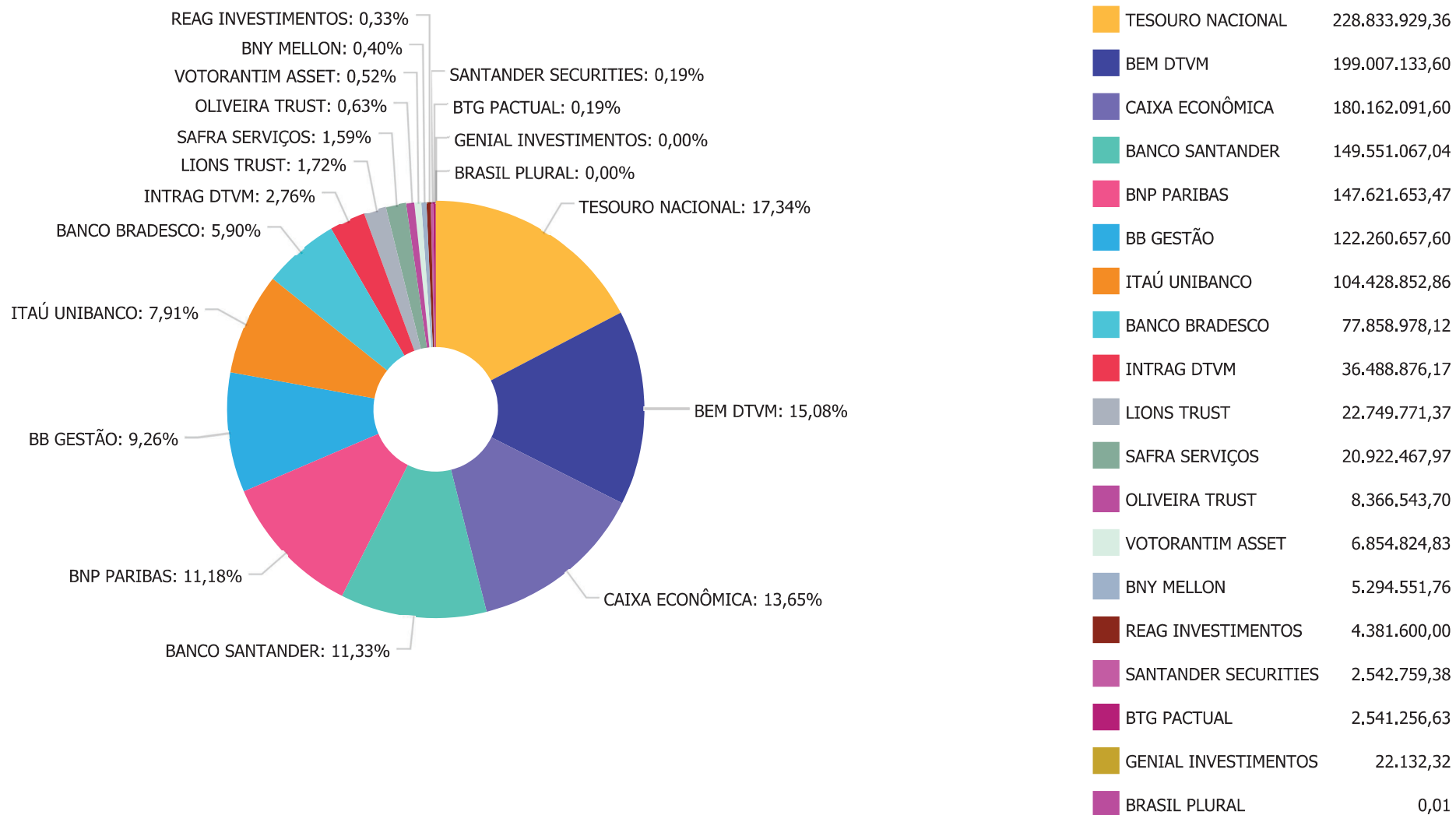
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	3,93%	10,28%	11,31%	9,94%	69,17%	115,88%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,03%	4,99%	4,75%	3,98%	65,57%	121,93%	6,37%	0,23%

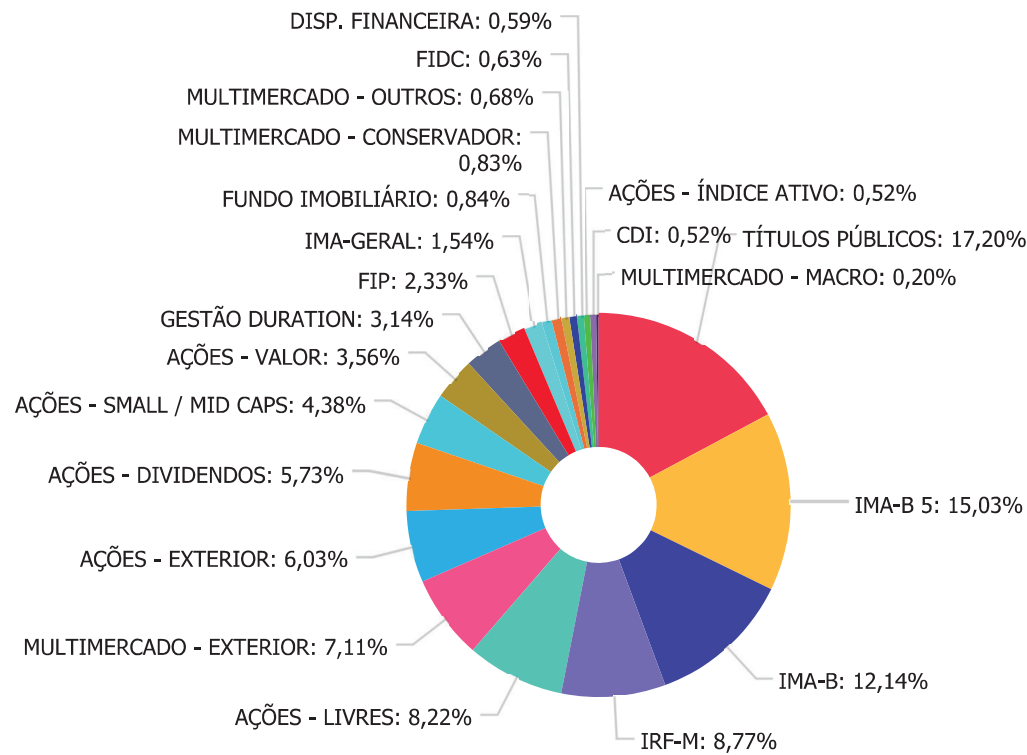
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	4,42%	8,91%	9,10%	15,21%	97,35%	-	11,13%	0,19%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MUL...	-3,31%	-5,75%	-4,59%	-1,71%	2,48%	13,52%	4,25%	0,16%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INVESTIMENTO NO EX...	-1,55%	1,27%	-0,81%	0,00%	26,09%	62,42%	7,14%	0,11%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	4,60%	10,50%	11,02%	15,78%	72,33%	111,26%	5,18%	0,18%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	6,15%	11,35%	12,57%	18,60%	67,93%	108,73%	7,13%	0,19%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5,34%	11,94%	12,20%	19,88%	-	-	6,31%	-
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERI...	-0,28%	-2,40%	-0,24%	0,77%	31,54%	44,82%	7,97%	0,23%

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



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



TÍTULOS PÚBLICOS	228.833.929,36
IMA-B 5	199.950.943,22
IMA-B	161.518.524,04
IRF-M	116.626.889,94
AÇÕES - LIVRES	109.433.631,80
MULTIMERCADO - EXTERIOR	94.659.060,90
AÇÕES - EXTERIOR	80.211.157,71
AÇÕES - DIVIDENDOS	76.260.676,26
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	58.239.254,06
AÇÕES - VALOR	47.434.742,21
GESTÃO DURATION	41.822.875,47
FIP	31.043.129,56
IMA-GERAL	20.478.862,48
FUNDO IMOBILIÁRIO	11.236.424,83
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	11.032.478,63
MULTIMERCADO - OUTROS	8.984.495,68
FIDC	8.388.676,03
DISP. FINANCEIRA	7.899.132,59
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.974.948,00

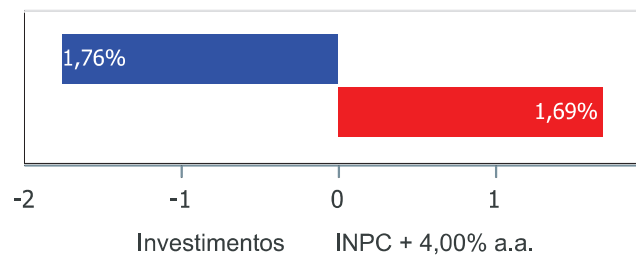
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 2021)

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	3.588,522674	10.097.369,17	12.380.403,23	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7.600	3.031,376224	3.842,239819	23.038.459,30	29.201.022,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2.000	2.593,340767	3.842,239819	5.186.681,53	7.684.479,64	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	3.956,256773	10.048.181,87	13.451.273,03	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8.500	3.097,511439	4.354,305397	26.328.847,23	37.011.595,87	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6.000	3.097,511438	4.354,305397	18.585.068,63	26.125.832,38	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.354,305397	7.520.551,00	13.933.777,27	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3.450	2.896,880939	4.354,305397	9.994.239,24	15.022.353,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	13.000	3.271,849021	4.354,305397	42.534.037,27	56.605.970,16	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.354,305397	13.087.396,08	17.417.221,59	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	20.643.927,70	1.324.155.868,46	-11.405.354,91	-11.405.354,91	-0,85%	-0,85%	0,58%	0,58%	-146,58%	6,17%
Fevereiro	1.324.155.868,46	13.599.501,88	2.905.461,40	1.322.668.875,91	-12.181.033,03	-23.586.387,94	-0,91%	-1,76%	1,10%	1,69%	-103,95%	5,38%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



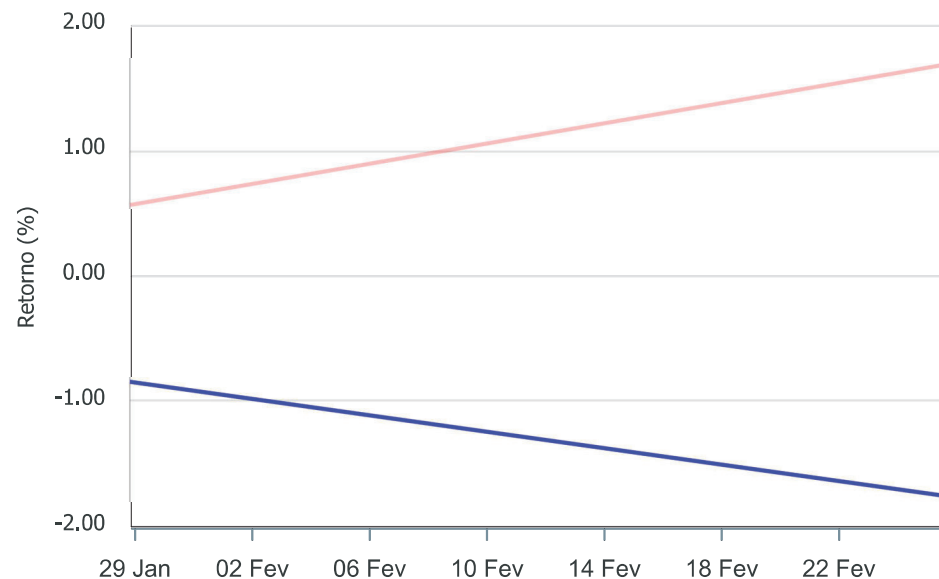
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- 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 Fevereiro/2021

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	8.340.579,44	0,00	0,00	8.366.543,70	25.964,26	0,31%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.344.660,30	0,00	0,00	23.358.621,64	13.961,34	0,06%	0,06%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	0,00	3.150.000,00	2.900.000,00	250.705,68	705,68	0,02%	0,11%	0,02%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.682.704,71	0,00	0,00	6.667.942,16	-14.762,55	-0,22%	-0,22%	0,19%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	18.558.445,83	0,00	0,00	18.464.253,83	-94.192,00	-0,51%	-0,51%	0,95%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	28.415.371,52	5.461,40	0,00	28.246.161,34	-174.671,58	-0,61%	-0,61%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	45.548.696,05	347.026,29	0,00	45.610.015,51	-285.706,83	-0,62%	-0,62%	1,17%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	27.519.677,34	0,00	0,00	27.344.462,20	-175.215,14	-0,64%	-0,64%	1,17%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	42.449.886,91	10.097.014,19	0,00	52.199.824,50	-347.076,60	-0,66%	-0,59%	1,15%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	30.462.916,62	0,00	0,00	30.221.928,91	-240.987,71	-0,79%	-0,79%	1,33%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.667.752,56	0,00	0,00	20.478.862,48	-188.890,08	-0,91%	-0,91%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	45.106.111,00	0,00	0,00	44.585.991,21	-520.119,79	-1,15%	-1,15%	1,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	43.029.769,72	0,00	0,00	42.529.728,89	-500.040,83	-1,16%	-1,16%	1,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.866.757,92	0,00	0,00	29.511.169,84	-355.588,08	-1,19%	-1,19%	1,02%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	15.220.018,64	0,00	0,00	15.020.340,81	-199.677,83	-1,31%	-1,31%	2,29%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.578.808,22	0,00	0,00	16.328.550,76	-250.257,46	-1,51%	-1,51%	1,92%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	37.468.847,09	0,00	0,00	36.894.907,03	-573.940,06	-1,53%	-1,53%	2,32%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	15.137.898,62	0,00	0,00	14.903.090,38	-234.808,24	-1,55%	-1,55%	2,32%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.031.411,81	0,00	0,00	23.657.545,00	-373.866,81	-1,56%	-1,56%	2,33%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	2.523.739,40	0,00	0,00	2.483.123,64	-40.615,76	-1,61%	-1,61%	2,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	48.472.761,24	0,00	0,00	47.637.049,21	-835.712,03	-1,72%	-1,72%	2,88%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	21.323.970,47	0,00	0,00	20.922.467,97	-401.502,50	-1,88%	-1,88%	2,78%
TÍTULOS PÚBLICOS	234.313.283,60	0,00	0,00	228.833.929,36	-5.479.354,24	-2,34%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	26.190,25	0,00	0,00	22.132,32	-4.057,93	-15,49%	-	-
Total Renda Fixa	785.090.259,27	13.599.501,88	2.900.000,00	784.539.348,38	-11.250.412,77	-1,41%		1,50%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	13.453.035,70	0,00	0,00	17.681.996,18	4.228.960,48	31,43%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	2.192.169,27	0,00	0,00	2.542.759,38	350.590,11	15,99%	-0,09%	0,00%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32.106.271,37	0,00	0,00	32.962.550,16	856.278,79	2,67%	2,67%	6,70%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	47.487.759,70	0,00	0,00	47.872.105,14	384.345,44	0,81%	0,81%	11,62%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.287.659,59	0,00	0,00	10.367.148,92	79.489,33	0,77%	0,77%	11,67%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.039.322,59	0,00	0,00	5.067.775,19	28.452,60	0,56%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	30.597.326,57	0,00	0,00	30.742.148,00	144.821,43	0,47%	0,47%	10,10%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	5.274.820,18	0,00	0,00	5.294.551,76	19.731,58	0,37%	0,37%	1,23%
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	2.780.110,34	0,00	0,00	2.779.728,12	-382,22	-0,01%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	294.850,12	0,00	0,00	294.574,24	-275,88	-0,09%	-0,09%	0,00%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.627.082,12	0,00	0,00	2.619.527,89	-7.554,23	-0,29%	-0,29%	1,10%
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	2.685.378,28	0,00	0,00	2.676.296,45	-9.081,83	-0,34%	-0,34%	0,37%
MAG FI MULTIMERCADO	5.764.113,10	0,00	0,00	5.737.926,87	-26.186,23	-0,45%	-0,45%	1,04%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.230.938,54	0,00	0,00	4.208.247,34	-22.691,20	-0,54%	-0,54%	1,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.803.995,40	0,00	0,00	4.776.248,34	-27.747,06	-0,58%	-0,58%	1,04%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.007.462,83	0,00	0,00	11.719.227,62	-288.235,21	-2,40%	-2,40%	11,82%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.881.387,29	0,00	0,00	1.834.696,09	-46.691,20	-2,48%	-2,48%	7,79%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.607.163,73	0,00	0,00	2.541.256,63	-65.907,10	-2,53%	-2,53%	8,73%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	4.313.531,68	0,00	0,00	4.176.658,51	-136.873,17	-3,17%	-3,17%	9,24%
OCCAM FIC AÇÕES	14.219.904,72	0,00	0,00	13.741.697,10	-478.207,62	-3,36%	-3,36%	12,80%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	35.432.333,73	0,00	0,00	34.142.394,87	-1.289.938,86	-3,64%	-3,64%	11,44%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.765.858,77	0,00	0,00	9.394.242,96	-371.615,81	-3,81%	-3,81%	8,10%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.254.411,47	0,00	0,00	6.974.948,00	-279.463,47	-3,85%	-3,85%	10,80%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.971.083,51	0,00	0,00	5.732.382,94	-238.700,57	-4,00%	-4,00%	10,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	28.905.940,88	0,00	0,00	27.663.151,72	-1.242.789,16	-4,30%	-4,30%	10,53%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.548.657,78	0,00	0,00	13.921.199,88	-627.457,90	-4,31%	-4,31%	11,89%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	35.239.677,97	0,00	0,00	33.693.045,11	-1.546.632,86	-4,39%	-4,39%	10,78%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.716.756,10	0,00	0,00	13.070.455,61	-646.300,49	-4,71%	-4,71%	11,82%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.599.300,00	0,00	0,00	4.381.600,00	-217.700,00	-4,73%	-4,37%	16,17%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	32.704.664,39	0,00	0,00	30.756.493,23	-1.948.171,16	-5,96%	-5,96%	14,42%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	7.953.582,77	0,00	5.461,40	6.854.824,83	-1.093.296,54	-13,75%	-14,01%	15,08%
Total Renda Variável	400.746.550,49	0,00	5.461,40	396.221.859,08	-4.519.230,01	-1,13%		10,30%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	18.908.802,64	0,00	0,00	20.072.344,70	1.163.542,06	6,15%	6,15%	7,13%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	5.533.189,85	0,00	0,00	5.828.870,26	295.680,41	5,34%	5,34%	6,31%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	16.898.777,96	0,00	0,00	17.675.900,94	777.122,98	4,60%	4,60%	5,18%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	31.278.652,76	0,00	0,00	32.660.754,30	1.382.101,54	4,42%	4,42%	11,13%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	28.260.509,19	0,00	0,00	28.835.394,29	574.885,10	2,03%	2,03%	6,37%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	12.921.616,84	0,00	0,00	12.886.138,86	-35.477,98	-0,27%	-0,27%	7,97%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	13.780.870,58	0,00	0,00	13.566.971,72	-213.898,86	-1,55%	-1,55%	7,14%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	10.736.638,88	0,00	0,00	10.381.293,38	-355.345,50	-3,31%	-3,31%	4,25%
Total Exterior	138.319.058,70	0,00	0,00	141.907.668,45	3.588.609,75	2,59%		7,49%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma **OPINIÃO** que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.