

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

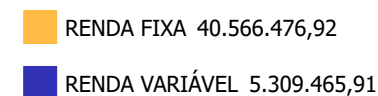
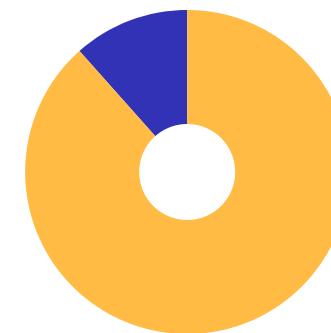
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.013.915,73	8,75%	588	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.404.063,17	13,96%	922	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.769.162,27	14,76%	685	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	1.235.711,86	2,69%	134	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	851.514,53	1,86%	1.225	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.790.939,68	10,44%	701	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	42.554,04	0,09%	165	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	406.803,73	0,89%	45	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.407.155,61	3,07%	265	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.795.009,57	3,91%	885	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	904.067,30	1,97%	1.005	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.513.336,77	3,30%	976	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	472.413,76	1,03%	1.361	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.954.847,86	4,26%	431	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.142.499,33	4,67%	743	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	609.978,48	1,33%	52	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	5.252.503,23	11,45%	269	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	498.068,92	1,09%	2.098	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	119.373,97	0,26%	15.778	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.214.849,69	2,65%	2.413	0,12%	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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	657.426,41	1,43%	42.737	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.807.875,44	3,94%	138	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.011.871,48	2,21%	18.848	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			45.875.942,83				

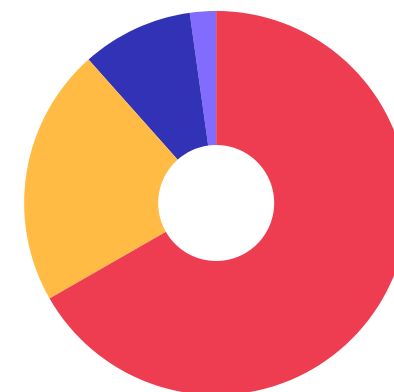
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	30.606.648,02	66,72%	20,00%	30,00%	90,00%	10.681.700,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	27.525.565,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	9.959.828,90	21,71%	5,00%	30,00%	40,00%	8.390.548,23
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.881.391,42
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.293.797,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.293.797,14
Total Renda Fixa	100,00%	40.566.476,92	88,43%	25,00%	70,00%	215,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.587.594,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	4.297.594,43	9,37%	0,00%	15,00%	20,00%	4.877.594,14
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.011.871,48	2,21%	0,00%	10,00%	10,00%	3.575.722,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.293.797,14
Total Renda Variável	30,00%	5.309.465,91	11,57%	0,00%	30,00%	45,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º IV a
 ■ 8º II a
 ■ 8º III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.229.455,09	63,71	0,00
ITAÚ UNIBANCO	7.717.805,08	16,82	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.521.527,05	16,40	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.407.155,61	3,07	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	30.606.648,02	66,72	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	9.959.828,90	21,71	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	4.297.594,43	9,37	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	1.011.871,48	2,21	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,71%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	2,02%	5,34%	2,86%	3,40%	5,34%	18,84%	-	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,12%	4,53%	2,84%	2,98%	4,53%	17,45%	0,89%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	3,47%	0,63%	0,99%	3,47%	10,19%	0,10%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,10%	0,01%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,33%	3,48%	0,67%	1,01%	3,48%	10,18%	0,10%	0,01%
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%	0,74%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,81%	7,78%	3,34%	4,56%	7,78%	21,67%	0,75%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	5,61%	2,89%	3,91%	5,61%	16,66%	0,64%	0,02%
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%	1,04%	0,03%

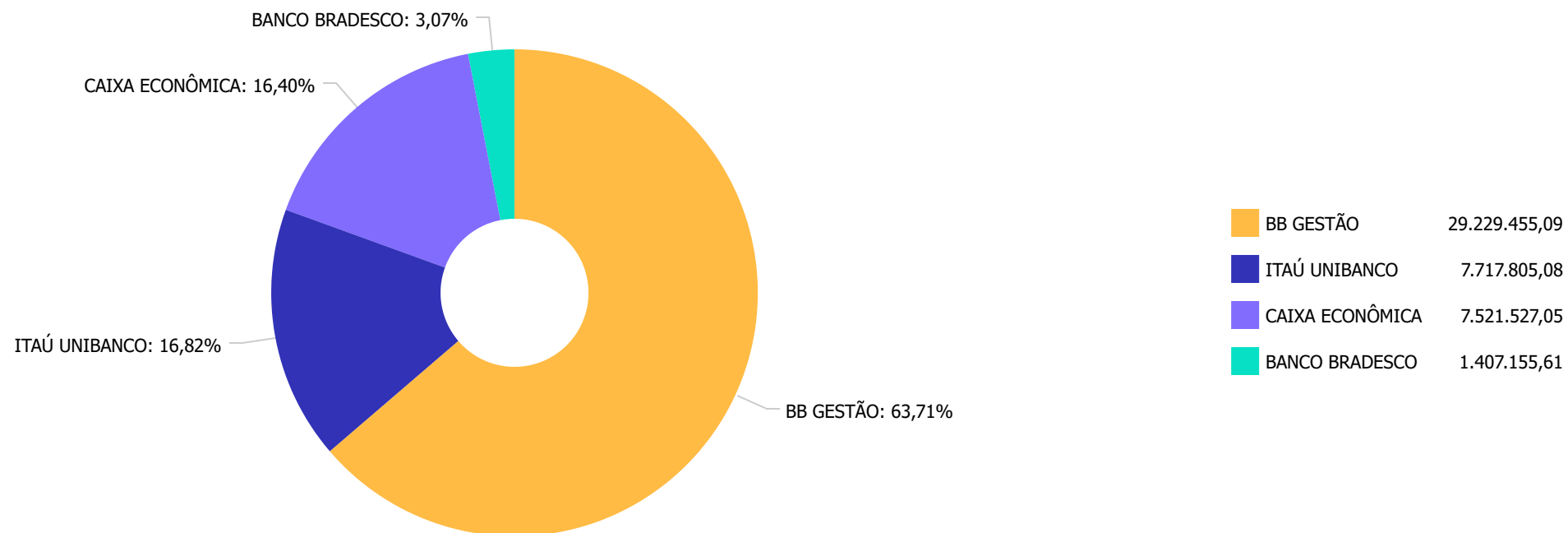
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,64%	0,22%	0,40%	1,64%	6,54%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,40%	2,67%	0,70%	1,13%	2,67%	8,69%	0,19%	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%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,55%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	-	3,66%	3,62%	-	-	1,09%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	7,92%	3,22%	4,89%	7,92%	20,01%	0,66%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	8,29%	2,90%	4,76%	8,29%	23,53%	0,64%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,38%	5,09%	3,18%	3,28%	5,09%	18,83%	1,02%	0,04%

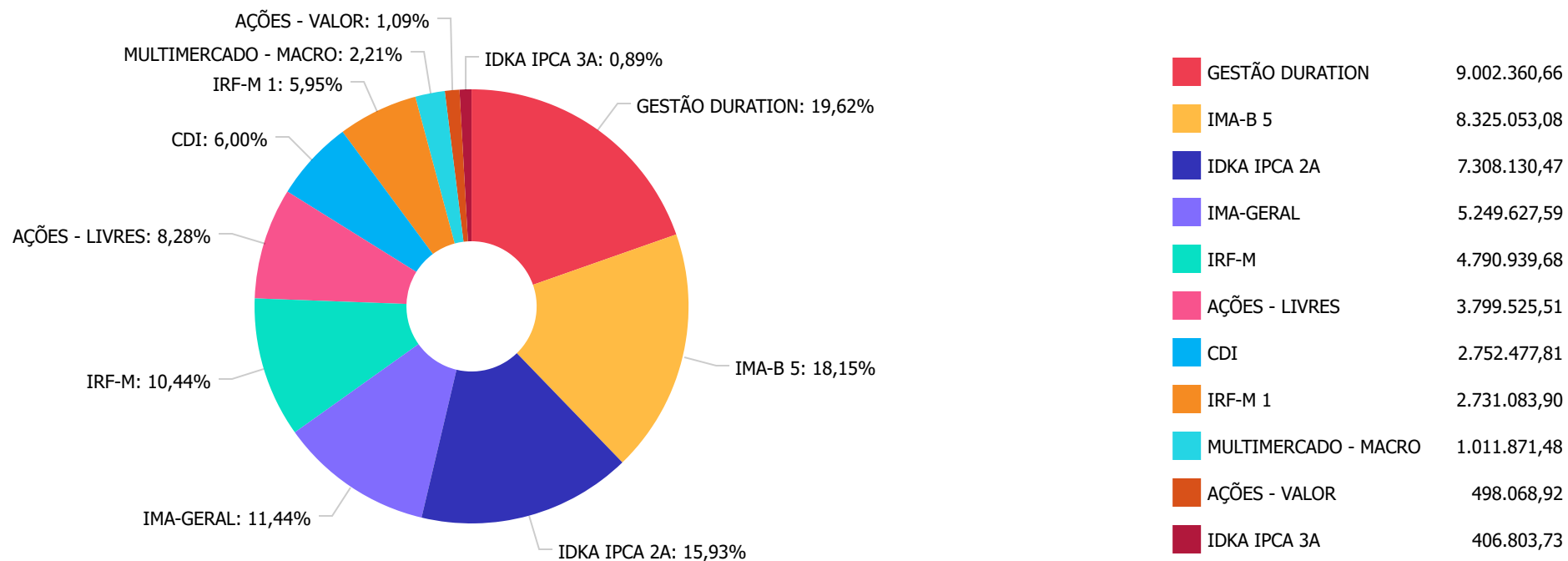
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	10,42%	14,03%	28,14%	32,00%	14,03%	67,13%	7,54%	0,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,97%	-21,23%	17,87%	10,19%	-21,23%	10,15%	6,55%	0,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10,72%	5,98%	32,39%	29,35%	5,98%	49,89%	7,54%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,30%	-4,87%	19,94%	22,34%	-4,87%	38,19%	6,12%	0,42%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,70%	3,52%	4,23%	4,60%	3,52%	22,23%	0,93%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7,65%	1,18%	18,83%	18,56%	1,18%	-	5,83%	0,44%

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



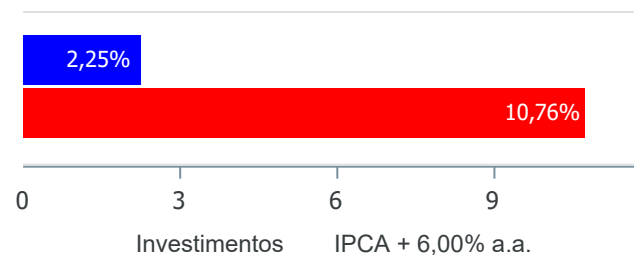
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

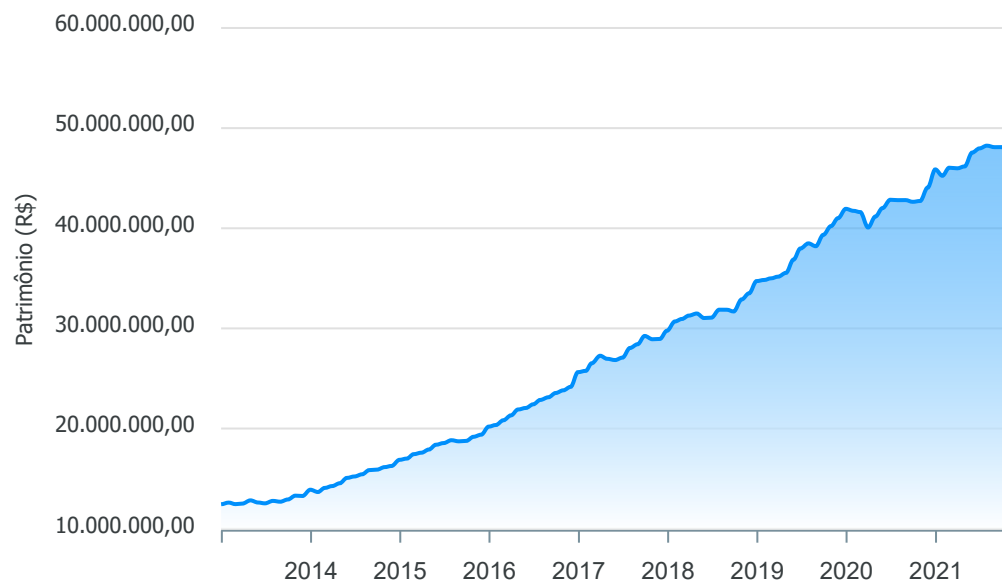
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	40.971.560,32	37.761,74	475.896,91	40.746.753,77	213.328,62	213.328,62	0,52%	0,52%	0,72%	0,72%	72,21%	1,21%
Fevereiro	40.746.753,77	493.422,05	498.032,35	40.597.445,51	-144.697,96	68.630,66	-0,36%	0,16%	0,67%	1,39%	11,74%	1,81%
Março	40.597.445,51	457.144,99	464.810,57	39.050.485,46	-1.539.294,47	-1.470.663,81	-3,79%	-3,63%	0,58%	1,98%	-183,31%	7,64%
Abril	39.050.485,46	1.163.105,42	488.663,15	40.117.638,91	392.711,18	-1.077.952,63	0,99%	-2,68%	0,15%	2,14%	-125,45%	4,16%
Mai	40.117.638,91	698.026,12	490.192,99	40.991.534,99	666.062,95	-411.889,68	1,65%	-1,07%	0,08%	2,22%	-48,36%	2,06%
Junho	40.991.534,99	2.163.448,33	1.998.925,16	41.741.709,48	585.651,32	173.761,64	1,42%	0,33%	0,75%	2,99%	11,18%	1,84%
Julho	41.741.709,48	1.743.963,78	1.501.756,14	41.688.639,35	-295.277,77	-121.516,13	-0,70%	-0,37%	0,90%	3,91%	-9,52%	1,57%
Agosto	41.688.639,35	2.369.003,40	2.235.987,27	41.668.708,14	-152.947,34	-274.463,47	-0,37%	-0,74%	0,73%	4,66%	-15,79%	1,57%
Setembro	41.668.708,14	734.332,33	510.531,16	41.526.241,98	-366.267,33	-640.730,80	-0,87%	-1,60%	1,13%	5,85%	-27,44%	2,16%
Outubro	41.526.241,98	562.719,55	510.687,77	41.528.461,50	-49.812,26	-690.543,06	-0,12%	-1,72%	1,35%	7,28%	-23,67%	1,86%
Novembro	41.528.461,50	1.013.646,75	512.261,21	42.842.036,62	812.189,58	121.646,52	1,93%	0,18%	1,36%	8,73%	2,03%	1,66%
Dezembro	42.842.036,62	1.794.571,21	980.537,99	44.561.072,79	905.002,95	1.026.649,47	2,07%	2,25%	1,87%	10,76%	20,94%	1,17%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



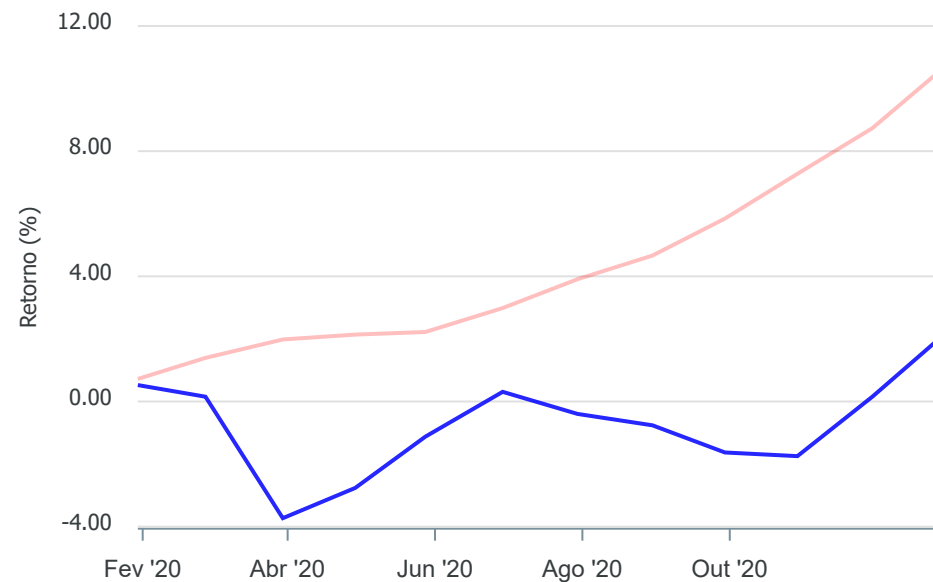
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.903.519,49	0,00	0,00	1.954.847,86	51.328,37	2,70%	2,70%	1,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.920.642,44	0,00	0,00	4.013.915,73	93.273,29	2,38%	2,38%	1,02%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	1.210.019,94	0,00	0,00	1.235.711,86	25.691,92	2,12%	2,12%	0,89%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.698.638,20	0,00	0,00	4.790.939,68	92.301,48	1,96%	1,96%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.486.289,35	0,00	0,00	1.513.336,77	27.047,42	1,82%	1,82%	0,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.649.021,85	0,00	0,00	6.769.162,27	120.140,42	1,81%	1,81%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	889.369,03	0,00	0,00	904.067,30	14.698,27	1,65%	1,65%	0,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.307.829,18	0,00	0,00	6.404.063,17	96.233,99	1,53%	1,53%	0,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.771.612,53	0,00	0,00	1.795.009,57	23.397,04	1,32%	1,32%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	401.939,31	0,00	0,00	406.803,73	4.864,42	1,21%	1,21%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	42.046,76	0,00	0,00	42.554,04	507,28	1,21%	1,21%	0,64%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	607.523,38	0,00	0,00	609.978,48	2.455,10	0,40%	0,40%	0,19%
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.402.593,98	0,00	0,00	1.407.155,61	4.561,63	0,33%	0,33%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	848.858,08	0,00	0,00	851.514,53	2.656,45	0,31%	0,31%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	471.072,46	0,00	0,00	472.413,76	1.341,30	0,28%	0,28%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.241.906,21	0,00	0,00	5.252.503,23	10.597,02	0,20%	0,20%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.237.573,61	1.954.599,49	1.051.229,95	2.142.499,33	1.556,18	0,05%	0,10%	0,01%
Total Renda Fixa	39.090.455,80	1.954.599,49	1.051.229,95	40.566.476,92	572.651,58	1,43%		0,62%

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	449.849,93	0,00	0,00	498.068,92	48.218,99	10,72%	10,72%	7,54%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	108.106,20	0,00	0,00	119.373,97	11.267,77	10,42%	10,42%	7,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.674.433,81	0,00	0,00	1.807.875,44	133.441,63	7,97%	7,97%	6,55%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.128.568,37	0,00	0,00	1.214.849,69	86.281,32	7,65%	7,65%	5,83%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	618.490,34	0,00	0,00	657.426,41	38.936,07	6,30%	6,30%	6,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	994.951,47	0,00	0,00	1.011.871,48	16.920,01	1,70%	1,70%	0,93%
Total Renda Variável	4.974.400,12	0,00	0,00	5.309.465,91	335.065,79	6,74%		5,38%

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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.550.653,93	0,00	0,00	6.769.162,27	218.508,34	3,34%	3,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	6.204.033,43	0,00	0,00	6.404.063,17	200.029,74	3,22%	3,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.890.409,37	0,00	0,00	4.013.915,73	123.506,36	3,17%	3,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.697.360,49	0,00	0,00	4.790.939,68	93.579,19	1,99%	1,99%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.885.887,18	0,00	0,00	1.954.847,86	68.960,68	3,66%	3,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.464.736,90	0,00	0,00	1.513.336,77	48.599,87	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.759.100,29	0,00	0,00	1.795.009,57	35.909,28	2,04%	2,04%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	1.201.558,29	0,00	0,00	1.235.711,86	34.153,57	2,84%	2,84%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	877.327,33	0,00	0,00	904.067,30	26.739,97	3,05%	3,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.232.369,52	0,00	0,00	5.252.503,23	20.133,71	0,38%	0,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	395.326,08	0,00	0,00	406.803,73	11.477,65	2,90%	2,90%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.397.777,10	0,00	0,00	1.407.155,61	9.378,51	0,67%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	846.225,36	0,00	0,00	851.514,53	5.289,17	0,63%	0,63%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	605.767,82	0,00	0,00	609.978,48	4.210,66	0,70%	0,70%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	577.627,86	3.693.487,75	2.132.141,82	2.142.499,33	3.525,54	0,08%	0,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	469.388,20	0,00	0,00	472.413,76	3.025,56	0,64%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	41.357,32	0,00	0,00	42.554,04	1.196,72	2,89%	2,89%
				Total Renda Fixa	908.224,52	2,29%	

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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.533.778,74	0,00	0,00	1.807.875,44	274.096,70	17,87%	17,87%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.022.368,29	0,00	0,00	1.214.849,69	192.481,40	18,83%	18,83%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	376.201,62	0,00	0,00	498.068,92	121.867,30	32,39%	32,39%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	548.127,38	0,00	0,00	657.426,41	109.299,03	19,94%	19,94%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	970.770,70	0,00	0,00	1.011.871,48	41.100,78	4,23%	4,23%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	93.158,46	0,00	0,00	119.373,97	26.215,51	28,14%	28,14%
				Total Renda Variável	765.060,72	16,84%	

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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.280.493,80	0,00	0,00	6.769.162,27	488.668,47	7,78%	7,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.934.314,15	0,00	0,00	6.404.063,17	469.749,02	7,92%	7,92%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.502.874,85	0,00	0,00	4.790.939,68	288.064,83	6,40%	6,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.819.507,07	0,00	0,00	4.013.915,73	194.408,66	5,09%	5,09%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.106.369,84	0,00	0,00	5.252.503,23	146.133,39	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.682.854,58	0,00	0,00	1.795.009,57	112.154,99	6,66%	6,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	795.902,04	635.461,50	0,00	1.513.336,77	81.973,23	5,73%	7,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	836.853,43	0,00	0,00	904.067,30	67.213,87	8,03%	8,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.900.000,00	0,00	1.954.847,86	54.847,86	2,89%	-
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	1.182.204,04	0,00	0,00	1.235.711,86	53.507,82	4,53%	4,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.922.401,88	0,00	1.500.000,00	472.413,76	50.011,88	2,60%	3,63%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.359.847,11	0,00	0,00	1.407.155,61	47.308,50	3,48%	3,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	394.899,39	0,00	19.802,37	406.803,73	31.706,71	8,03%	8,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	822.974,47	0,00	0,00	851.514,53	28.540,06	3,47%	3,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.135.364,32	9.833.542,44	8.847.228,49	2.142.499,33	20.821,06	0,19%	1,64%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	576.894,82	17.367,40	0,00	609.978,48	15.716,26	2,64%	2,67%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	647.002,00	0,00	652.828,90	0,00	5.826,90	0,90%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	119.560,39	0,00	81.015,35	42.554,04	4.009,00	3,35%	5,61%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	893.757,22	0,00	0,00	0,00	-893.757,22	-100,00%	2,40%
				Total Renda Fixa	1.266.905,29	3,22%	

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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.214.849,69	214.849,69	21,48%	1,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	469.450,68	500.000,00	0,00	1.011.871,48	42.420,80	4,38%	3,52%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	469.964,25	0,00	0,00	498.068,92	28.104,67	5,98%	5,98%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	100.000,00	0,00	119.373,97	19.373,97	19,37%	14,03%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	691.108,56	0,00	0,00	657.426,41	-33.682,15	-4,87%	-4,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.295.132,67	0,00	0,00	1.807.875,44	-487.257,23	-21,23%	-21,23%
				Total Renda Variável	-216.190,25	-3,91%	

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.