

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
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.464.893,02	0,72%	50	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	3.085.321,08	0,91%	18.539	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	72.353.843,98	21,25%	591	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	123.392,07	0,04%	926	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	29.075.535,02	8,54%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	23.246.820,05	6,83%	1.212	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	2.189.802,78	0,64%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	8.034.663,89	2,36%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	38.964.197,64	11,44%	892	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.365.727,70	3,63%	196	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.782.233,42	1,40%	120	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.883.645,17	2,02%	443	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.708.097,35	0,50%	143	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.026.035,72	0,60%	763	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	37,55	0,00%	299	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.510.510,97	1,32%	117	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	25.266.809,17	7,42%	1.459	2,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	5.147.802,59	1,51%	77	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.650.779,88	0,78%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	7.090.723,88	2,08%	41.775	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

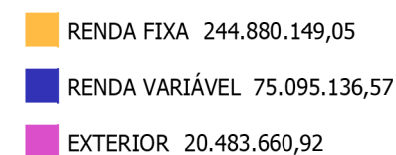
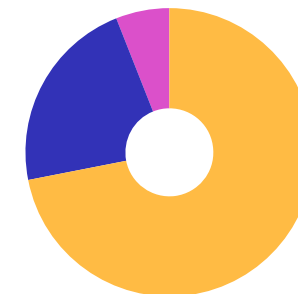
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	3.061.962,71	0,90%	108.525	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.882.504,22	0,55%	17.820	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.952.375,04	0,57%	2.983	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.972.092,25	2,93%	3.051	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	537.262,49	0,16%	6.805	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.634.964,78	0,77%	3.399	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	910.537,56	0,27%	3.179	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	4.607.826,62	1,35%	15.202	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	3.771.848,54	1,11%	160	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	979.634,55	0,29%	1.741	0,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	9.234.396,96	2,71%	2.394	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.445.989,96	1,01%	20.065	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.442.276,17	1,01%	651	4,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.282.880,21	2,14%	1.800	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.846.564,15	1,13%	1.067	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.177.921,17	0,35%	18.477	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
MAUÁ INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	409.239,93	0,12%	3.035	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	7.318.824,27	2,15%	98	0,76%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não há	1.535.311,11	0,45%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
J ESG EMERGING MARKETS DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+6 du	Não há	1.024.659,05	0,30%	169	18,81%	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
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	1.809.902,01	0,53%	317	3,94%	Artigo 9º - A, Inciso II
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	1.368.315,21	0,40%	6.002	0,32%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	14.141.412,50	4,15%	17.343	0,96%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	2.139.372,15	0,63%	203	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			340.458.946,54				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			579.522,08				Artigo 6º
PL Total			341.038.468,62				

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

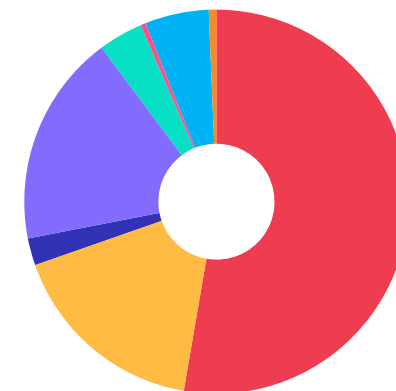
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	340.458.946,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	179.538.469,53	52,73%	40,00%	50,00%	100,00%	160.920.477,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	340.458.946,54
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.022.947,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	204.275.367,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	204.275.367,92
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	57.543.097,05	16,90%	0,00%	5,00%	40,00%	78.640.481,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	50,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	136.183.578,62
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	68.091.789,31
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	51.068.841,98
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	51.068.841,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.022.947,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	7.798.582,47	2,29%	0,00%	1,00%	5,00%	9.224.364,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.022.947,33
Total Renda Fixa	100,00%	244.880.149,05	71,93%	40,00%	59,00%	570,00%	



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 (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	102.137.683,96
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	102.137.683,96
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	60.807.275,94	17,86%	0,00%	17,00%	20,00%	7.284.513,37
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	68.091.789,31
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.752.549,52	3,75%	0,00%	8,00%	10,00%	21.293.345,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	1.535.311,11	0,45%	0,00%	1,00%	5,00%	15.487.636,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	17.022.947,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.022.947,33
Total Renda Variável	40,00%	75.095.136,57	22,06%	0,00%	30,00%	125,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	34.045.894,65
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	18.344.288,77	5,39%	0,00%	4,00%	10,00%	15.701.605,88
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	2.139.372,15	0,63%	0,00%	5,00%	10,00%	31.906.522,50
Total Exterior	10,00%	20.483.660,92	6,02%	0,00%	10,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	148.467.022,78	43,61	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	65.792.454,34	19,32	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	52.868.204,22	15,53	0,01
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	16.534.386,76	4,86	0,00
ITAÚ UNIBANCO	12.645.385,38	3,71	0,00
NAVI CAPITAL	9.972.092,25	2,93	0,61
XP GESTÃO DE RECURSOS	5.566.974,37	1,64	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	4.782.233,42	1,40	0,00
MOAT CAPITAL	4.607.826,62	1,35	0,03
VINCI PARTNERS	3.771.848,54	1,11	0,00
INDIE CAPITAL	3.445.989,96	1,01	0,09
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	3.085.321,08	0,91	0,01
ALASKA ASSET MANAGEMENT	3.061.962,71	0,90	0,03
BANCO J. SAFRA S/A	2.464.893,02	0,72	0,00
LAD CAPITAL	1.535.311,11	0,45	-
BRASIL PLURAL	910.537,56	0,27	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	537.262,49	0,16	0,03
MAUÁ CAPITAL	409.239,93	0,12	0,01

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	179.538.469,53	52,73	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	57.543.097,05	16,90	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	7.798.582,47	2,29	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	60.807.275,94	17,86	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	12.752.549,52	3,75	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.535.311,11	0,45	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	18.344.288,77	5,39	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	2.139.372,15	0,63	0,00	10,00

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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-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%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,18%	3,07%	4,24%	7,69%	18,77%	0,01%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,71%	0,71%	3,99%	7,36%	10,76%	22,35%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	3,33%	3,32%	7,96%	23,13%	0,01%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,69%	-1,69%	8,43%	2,01%	3,68%	26,83%	-	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	-1,67%	-1,67%	6,05%	1,46%	5,43%	24,74%	0,03%	0,12%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	0,54%	0,79%	3,07%	9,59%	0,00%	0,01%
IMA-B (Benchmark)	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,02%	-1,02%	5,96%	2,45%	4,93%	23,74%	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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	2,68%	3,87%	5,71%	15,45%	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
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,08%	0,24%	0,37%	1,43%	6,15%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	0,25%	0,52%	1,68%	6,66%	0,00%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,02%	0,07%	0,06%	0,42%	3,52%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	-0,12%	-0,12%	0,39%	0,69%	3,66%	-	0,00%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,10%	0,10%	3,47%	4,22%	7,17%	19,51%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	0,13%	3,12%	3,73%	7,85%	22,55%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00%	0,00%	3,01%	2,00%	6,72%	22,98%	0,01%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,01%	0,02%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,78%	0,20%	2,38%	14,58%	0,00%	0,01%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,58%	-0,58%	2,68%	0,52%	3,61%	14,74%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,47%	-0,47%	3,25%	1,20%	-	-	0,02%	-

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
S&P 500 (Benchmark)	-1,11%	-1,11%	13,59%	13,55%	15,15%	37,36%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-0,18%	-0,18%	13,99%	13,41%	12,32%	38,60%	0,08%	0,27%
IDIV (Benchmark)	-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%
IBX (Benchmark)	-3,03%	-3,03%	22,21%	12,06%	1,64%	20,92%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	-0,12%	-0,12%	18,68%	12,59%	5,10%	52,87%	0,14%	0,46%
Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	-4,48%	-4,48%	12,60%	1,61%	-11,58%	24,87%	0,11%	0,49%
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-4,95%	-4,95%	10,07%	5,65%	-9,94%	11,95%	0,12%	0,42%
OCCAM FIC AÇÕES	-3,13%	-3,13%	19,35%	9,66%	3,51%	29,87%	0,13%	0,40%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,95%	-3,95%	15,85%	1,99%	-11,45%	21,54%	0,10%	0,41%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,25%	-4,25%	20,75%	5,77%	1,31%	24,49%	0,10%	0,41%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	-4,41%	-4,41%	12,13%	1,45%	-12,25%	22,95%	0,11%	0,48%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,46%	-1,46%	17,60%	12,10%	-6,09%	23,46%	0,11%	0,43%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,57%	-2,57%	18,02%	5,76%	-4,46%	-	0,11%	0,44%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-

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
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,09%	-0,09%	4,50%	3,05%	2,72%	17,79%	0,02%	0,08%
MAUÁ INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,83%	-0,83%	3,06%	-0,20%	1,41%	9,55%	0,01%	0,05%

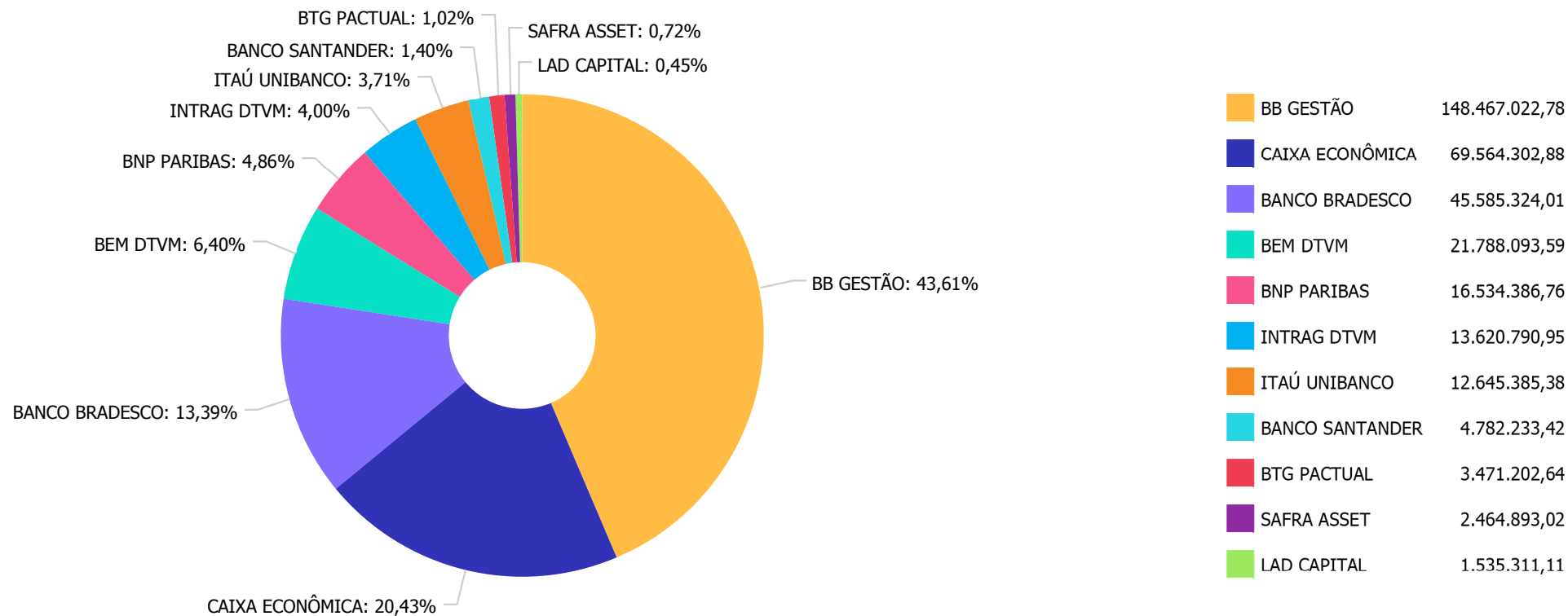
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	-8,18%	-8,18%	10,00%	-3,77%	-23,61%	4,56%	0,11%	0,38%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-1,64%	-1,64%	12,15%	1,61%	-7,54%	12,86%	0,11%	0,44%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,23%	0,23%	4,92%	2,44%	3,04%	-	0,02%	0,11%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,67%	-2,67%	14,64%	4,51%	-6,04%	27,57%	0,12%	0,42%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-4,71%	-4,71%	19,45%	8,87%	-10,49%	25,24%	0,12%	0,50%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	-6,26%	-6,26%	16,46%	1,60%	-	-	0,11%	-

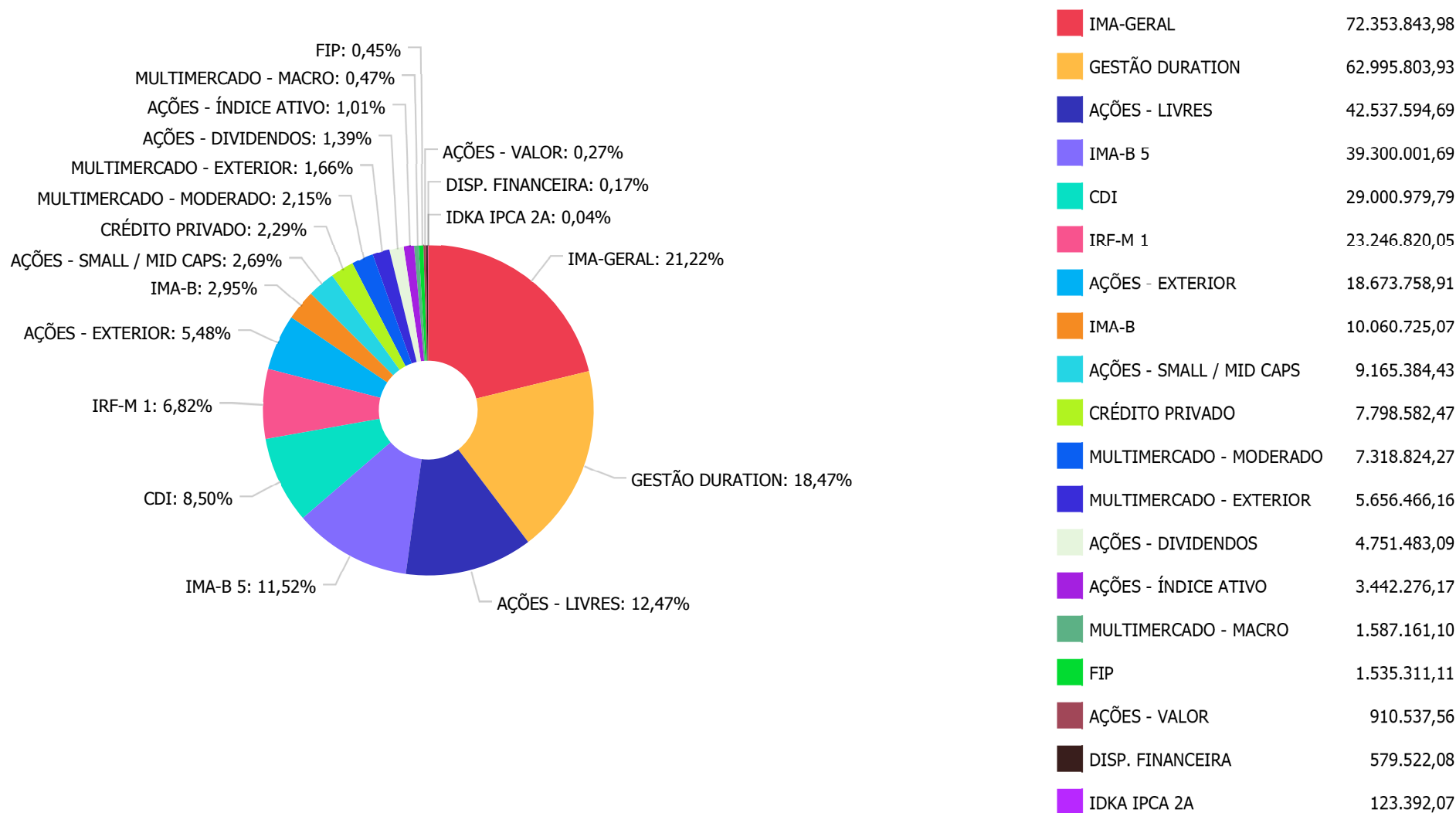
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,11%	6,11%	9,83%	21,25%	53,50%	120,12%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	5,79%	5,79%	9,11%	20,97%	53,70%	118,69%	0,12%	0,22%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	4,30%	4,30%	8,24%	27,17%	83,37%	-	0,13%	0,21%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-0,19%	-0,19%	14,10%	17,21%	39,36%	-	0,10%	0,25%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	4,02%	4,02%	-	-	-	-	0,11%	-
J ESG EMERGING MARKETS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	8,64%	8,64%	-	-	-	-	0,12%	-

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



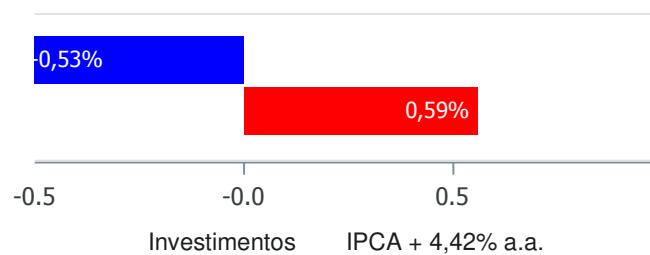
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

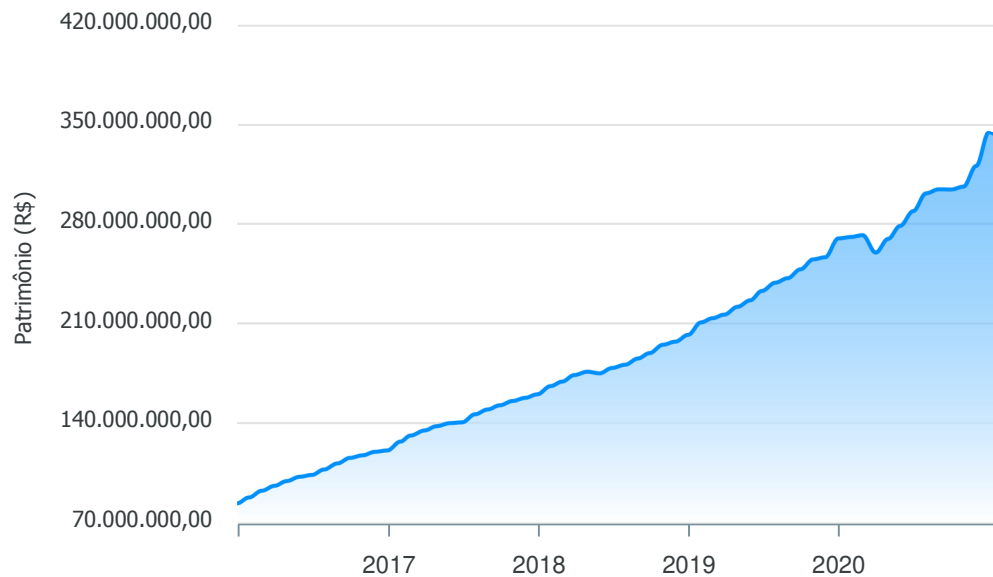
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	343.830.991,70	7.629.861,52	9.185.155,14	340.458.946,54	-1.816.751,54	-1.816.751,54	-0,53%	-0,53%	0,59%	0,59%	-88,85%	3,61%

Investimentos x Meta Atuarial



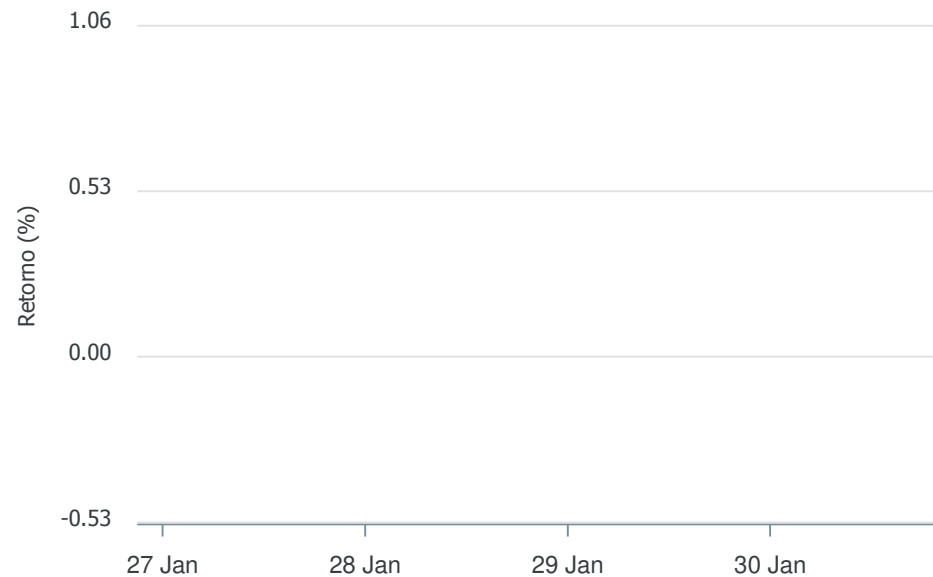
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.183.540,48	0,00	0,00	2.189.802,78	6.262,30	0,29%	0,29%	0,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	123.174,07	0,00	0,00	123.392,07	218,00	0,18%	0,18%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	29.036.554,02	0,00	0,00	29.075.535,02	38.981,00	0,13%	0,13%	0,91%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.648.187,10	0,00	0,00	2.650.779,88	2.592,78	0,10%	0,10%	1,29%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	37,52	0,00	0,00	37,55	0,03	0,08%	0,08%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.023.837,55	608,30	0,00	2.026.035,72	1.589,87	0,08%	0,08%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	4.780.730,55	0,00	0,00	4.782.233,42	1.502,87	0,03%	0,03%	0,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	23.239.520,98	0,00	0,00	23.246.820,05	7.299,07	0,03%	0,03%	0,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	38.954.345,66	0,00	0,00	38.964.197,64	9.851,98	0,03%	0,03%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.032.681,73	0,00	0,00	8.034.663,89	1.982,16	0,02%	0,02%	1,20%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	26.816.600,80	7.629.253,22	9.185.155,14	25.266.809,17	6.110,29	0,02%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	5.147.917,91	0,00	0,00	5.147.802,59	-115,32	0,00%	0,00%	1,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.710.072,14	0,00	0,00	1.708.097,35	-1.974,79	-0,12%	-0,12%	0,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.915.884,53	0,00	0,00	6.883.645,17	-32.239,36	-0,47%	-0,47%	1,56%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	72.755.714,00	0,00	0,00	72.353.843,98	-401.870,02	-0,55%	-0,55%	1,42%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.437.776,53	0,00	0,00	12.365.727,70	-72.048,83	-0,58%	-0,58%	1,40%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3.110.382,94	0,00	0,00	3.085.321,08	-25.061,86	-0,81%	-0,81%	2,24%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.557.040,79	0,00	0,00	4.510.510,97	-46.529,82	-1,02%	-1,02%	2,80%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.506.723,48	0,00	0,00	2.464.893,02	-41.830,46	-1,67%	-1,67%	3,11%
Total Renda Fixa	246.980.722,78	7.629.861,52	9.185.155,14	244.880.149,05	-545.280,11	-0,21%		0,98%

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
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	7.301.739,36	0,00	0,00	7.318.824,27	17.084,91	0,23%	0,23%	2,43%
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	1.535.415,56	0,00	0,00	1.535.311,11	-104,45	-0,01%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.178.962,44	0,00	0,00	1.177.921,17	-1.041,27	-0,09%	-0,09%	1,73%
INDIE FIC AÇÕES	3.450.088,90	0,00	0,00	3.445.989,96	-4.098,94	-0,12%	-0,12%	14,10%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.853.433,61	0,00	0,00	3.846.564,15	-6.869,46	-0,18%	-0,18%	8,07%
MAUÁ INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	412.672,00	0,00	0,00	409.239,93	-3.432,07	-0,83%	-0,83%	1,41%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7.196.074,42	0,00	0,00	7.090.723,88	-105.350,54	-1,46%	-1,46%	10,78%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.113.064,17	0,00	0,00	3.061.962,71	-51.101,46	-1,64%	-1,64%	11,49%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9.478.325,88	0,00	0,00	9.234.396,96	-243.928,92	-2,57%	-2,57%	11,08%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	7.482.870,47	0,00	0,00	7.282.880,21	-199.990,26	-2,67%	-2,67%	11,73%
OCCAM FIC AÇÕES	939.928,15	0,00	0,00	910.537,56	-29.390,59	-3,13%	-3,13%	13,08%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3.919.318,22	0,00	0,00	3.771.848,54	-147.469,68	-3,76%	-3,76%	10,41%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	559.343,47	0,00	0,00	537.262,49	-22.080,98	-3,95%	-3,95%	9,65%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.414.898,37	0,00	0,00	9.972.092,25	-442.806,12	-4,25%	-4,25%	10,17%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	2.756.538,29	0,00	0,00	2.634.964,78	-121.573,51	-4,41%	-4,41%	11,14%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.043.891,86	0,00	0,00	1.952.375,04	-91.516,82	-4,48%	-4,48%	11,38%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.975.440,66	0,00	0,00	1.882.504,22	-92.936,44	-4,70%	-4,70%	12,30%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.621.364,92	0,00	0,00	3.442.276,17	-179.088,75	-4,95%	-4,95%	11,80%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	4.915.596,96	0,00	0,00	4.607.826,62	-307.770,34	-6,26%	-6,26%	11,36%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	1.066.862,16	0,00	0,00	979.634,55	-87.227,61	-8,18%	-8,18%	11,11%

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
Total Renda Variável	77.215.829,87	0,00	0,00	75.095.136,57	-2.120.693,30	-2,75%		10,00%

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
J ESG EMERGING MARKETS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	943.136,92	0,00	0,00	1.024.659,05	81.522,13	8,64%	8,64%	11,86%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2.022.338,39	0,00	0,00	2.139.372,15	117.033,76	5,79%	5,79%	12,35%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	13.558.087,36	0,00	0,00	14.141.412,50	583.325,14	4,30%	4,30%	12,51%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	1.739.960,76	0,00	0,00	1.809.902,01	69.941,25	4,02%	4,02%	11,26%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	1.370.915,62	0,00	0,00	1.368.315,21	-2.600,41	-0,19%	-0,19%	9,77%
Total Exterior	19.634.439,05	0,00	0,00	20.483.660,92	849.221,87	4,33%		12,17%