

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.528.207,10	2,95%	598	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	14.579.342,11	6,59%	933	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.676.397,00	5,73%	706	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.530.118,48	3,86%	677	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.523.035,51	1,14%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.365.046,46	0,62%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.470.809,00	0,67%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	32.295.704,57	14,61%	903	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.095.037,70	7,28%	1.012	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.529.609,12	7,48%	989	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.676.630,31	2,57%	1.341	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	10.628.117,53	4,81%	484	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.031.265,12	1,82%	778	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.966.296,27	2,25%	195	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	166.094,08	0,08%	447	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.510.177,27	2,94%	114	1,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.201.434,84	1,00%	75	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.776.160,15	1,71%	264	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	998.952,16	0,45%	143	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	562.376,42	0,25%	1.955	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

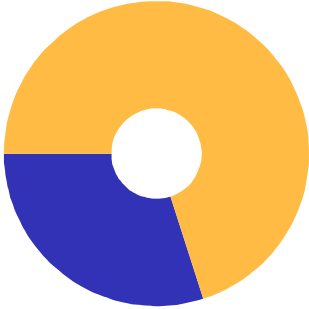
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.051.746,98	0,93%	74	0,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	745.168,00	0,34%	78	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.833.526,09	4,45%	2.036	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.266.865,64	1,48%	200	0,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.286.256,24	1,49%	6.286	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.601.424,51	1,63%	2.384	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	4.106.934,75	1,86%	164	0,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.995.631,04	0,90%	123	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.863.159,14	1,29%	6.474	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.626.715,52	1,19%	15.320	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.948.356,74	1,33%	40.797	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	2.920.938,79	1,32%	18	0,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.080.706,14	1,39%	132	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	6.077.994,02	2,75%	194	1,50%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.972.844,11	3,15%	18.112	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	6.110.137,24	2,76%	101	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.313.199,59	1,05%	17.605	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	3.226.010,59	1,46%	18	4,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	980.000,00	0,44%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		64.768,22	0,03%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			221.118.426,33				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			64.768,22				Artigo 6º
PL Total			221.183.194,55				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	118.269.937,36	53,49%	10,97%	54,86%	68,57%	33.350.967,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	40,00%	33.840.873,84	15,30%	3,96%	13,80%	40,00%	54.606.496,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b '	5,00%	2.796.914,98	1,26%	0,00%	1,26%	1,26%	-10.822,81
Total Renda Fixa	100,00%	154.907.726,18	70,06%	14,93%	69,92%	109,83%	

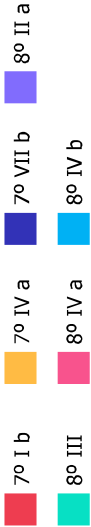
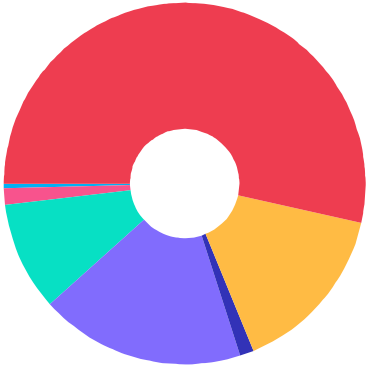


RENDA FIXA 154.907.726,18

RENDA VARIÁVEL 66.210.700,15

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'a '	20,00%	40.530.514,60	18,33%	3,58%	17,91%	20,00%	3.693.170,67
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	21.474.174,96	9,71%	3,14%	9,14%	10,00%	637.667,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a '	5,00%	3.226.010,59	1,46%	0,00%	1,45%	1,45%	-19.793,41
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'b '	5,00%	980.000,00	0,44%	0,00%	0,72%	0,72%	612.052,67
Total Renda Variável	30,00%	66.210.700,15	29,94%	6,72%	29,22%	32,17%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,43%	5,00%	11.055.921,32
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,43%	5,00%	11.055.921,32
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,86%	10,00%	

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	99.059.224,02	44,80	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	78.824.796,40	35,65	-
ITAÚ UNIBANCO	20.078.163,72	9,08	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.233.161,91	3,72	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.286.256,24	1,49	-
AGBI REAL ASSETS	3.226.010,59	1,46	-
ITAÚ DTVM	2.920.938,79	1,32	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.863.159,14	1,29	-
GENIAL INVESTIMENTOS	2.626.715,52	1,19	-

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 - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	0,00	0,00	10,97	68,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	0,00	0,00	3,96	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b '	0,00	0,00	0,00	1,26
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '	0,00	0,00	17,91	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a '	0,00	0,00	0,00	1,45
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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 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%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,48%	-0,33%	1,40%	2,72%	6,95%	18,92%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,53%	-0,39%	1,25%	2,68%	6,48%	17,50%	1,30%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,37%	1,15%	2,96%	6,43%	17,41%	1,09%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,28%	2,00%	3,91%	7,95%	11,43%	22,82%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,64%	-0,64%	1,13%	1,57%	5,27%	21,70%	1,13%	0,05%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,06%	-0,75%	0,93%	4,49%	5,03%	9,67%	5,00%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,08%	0,39%	0,94%	3,08%	9,80%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02%	0,04%	0,33%	0,82%	2,87%	9,36%	0,10%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,60%	-0,49%	1,33%	2,75%	6,23%	19,15%	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,59%	-0,56%	1,40%	2,04%	6,51%	22,01%	1,39%	0,04%
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%
IMA-B (Benchmark)	-1,52%	-2,36%	2,38%	3,07%	3,16%	21,74%	-	-

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
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,63%	-2,67%	2,14%	2,52%	3,72%	24,08%	2,38%	0,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,53%	-2,38%	2,34%	2,96%	2,89%	21,16%	2,31%	0,11%
CDI (Benchmark)								
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,08%	0,28%	0,53%	0,56%	2,05%	7,73%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	-0,15%	-0,27%	0,02%	0,42%	2,98%	-	0,25%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	-0,12%	-0,41%	-0,30%	0,34%	5,49%	16,63%	0,15%	0,03%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,05%	0,13%	0,23%	0,34%	1,26%	5,77%	0,01%	0,00%
	0,09%	0,26%	0,48%	0,72%	2,09%	7,62%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)								
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,86%	1,11%	2,48%	4,95%	5,20%	9,41%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,96%	-1,53%	0,91%	0,42%	2,22%	13,17%	1,16%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	0,19%	0,40%	0,35%	2,45%	12,28%	0,01%	0,01%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,01%	0,28%	1,49%	3,39%	6,76%	19,69%	0,71%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,07%	-0,98%	0,89%	2,60%	5,69%	17,51%	1,54%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,93%	-1,39%	1,27%	1,32%	-	-	1,29%	-
	-0,51%	-0,48%	0,83%	1,04%	4,64%	19,53%	0,95%	0,03%

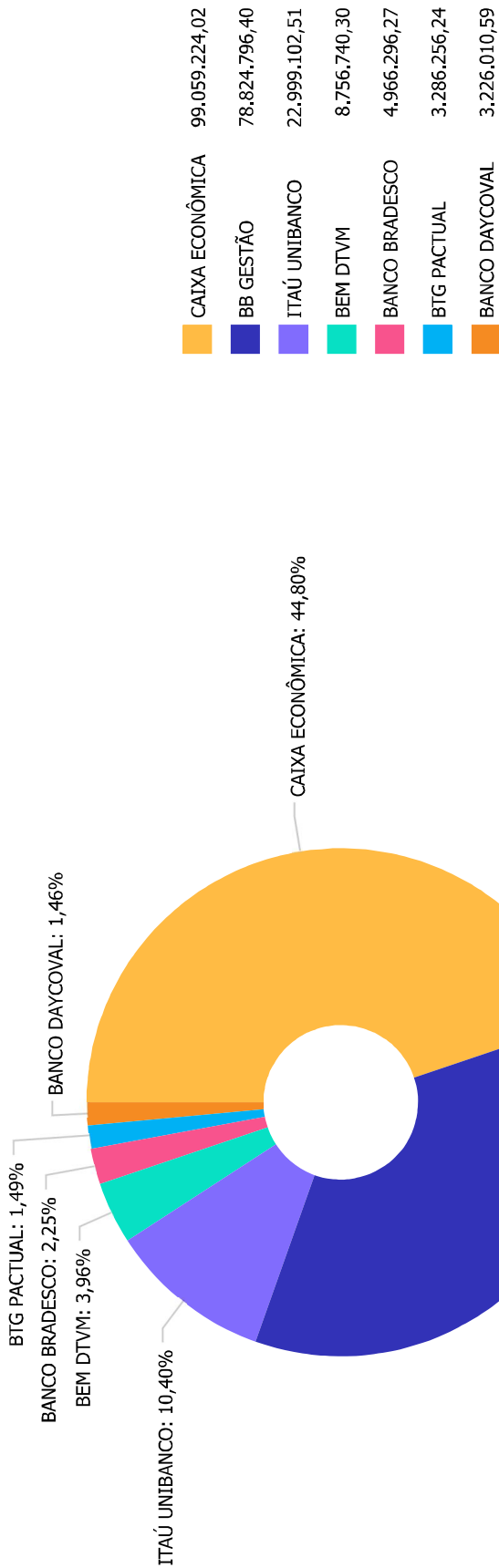
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,42%	2,29%	4,37%	8,93%	13,51%	27,46%	-	-
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	-0,08%	3,03%	2,88%	2,61%	-	21,05%	0,06%	0,03%
IDIV (Benchmark)	-5,21%	-10,02%	-1,98%	7,65%	-3,53%	17,34%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-4,31%	-7,91%	0,72%	9,47%	-0,18%	19,66%	11,89%	0,38%
Ibovespa (Benchmark)	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,39%	-7,39%	1,02%	8,83%	-0,22%	28,90%	10,78%	0,42%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,53%	-3,13%	1,94%	5,65%	10,28%	37,75%	8,73%	0,42%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-2,99%	-6,36%	1,56%	9,84%	4,92%	14,50%	11,73%	0,40%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-3,24%	-5,64%	1,82%	10,71%	3,53%	10,67%	13,26%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-3,16%	-4,74%	2,26%	8,77%	8,34%	-	10,01%	0,42%
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%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,03%	-10,33%	-0,72%	13,05%	5,91%	20,39%	13,40%	0,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,79%	-5,29%	1,95%	6,49%	1,82%	-	10,27%	0,43%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,57%	-6,41%	-0,53%	5,98%	-8,76%	20,18%	10,09%	0,41%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,28%	-0,39%	0,70%	0,73%	1,30%	9,24%	0,75%	0,02%

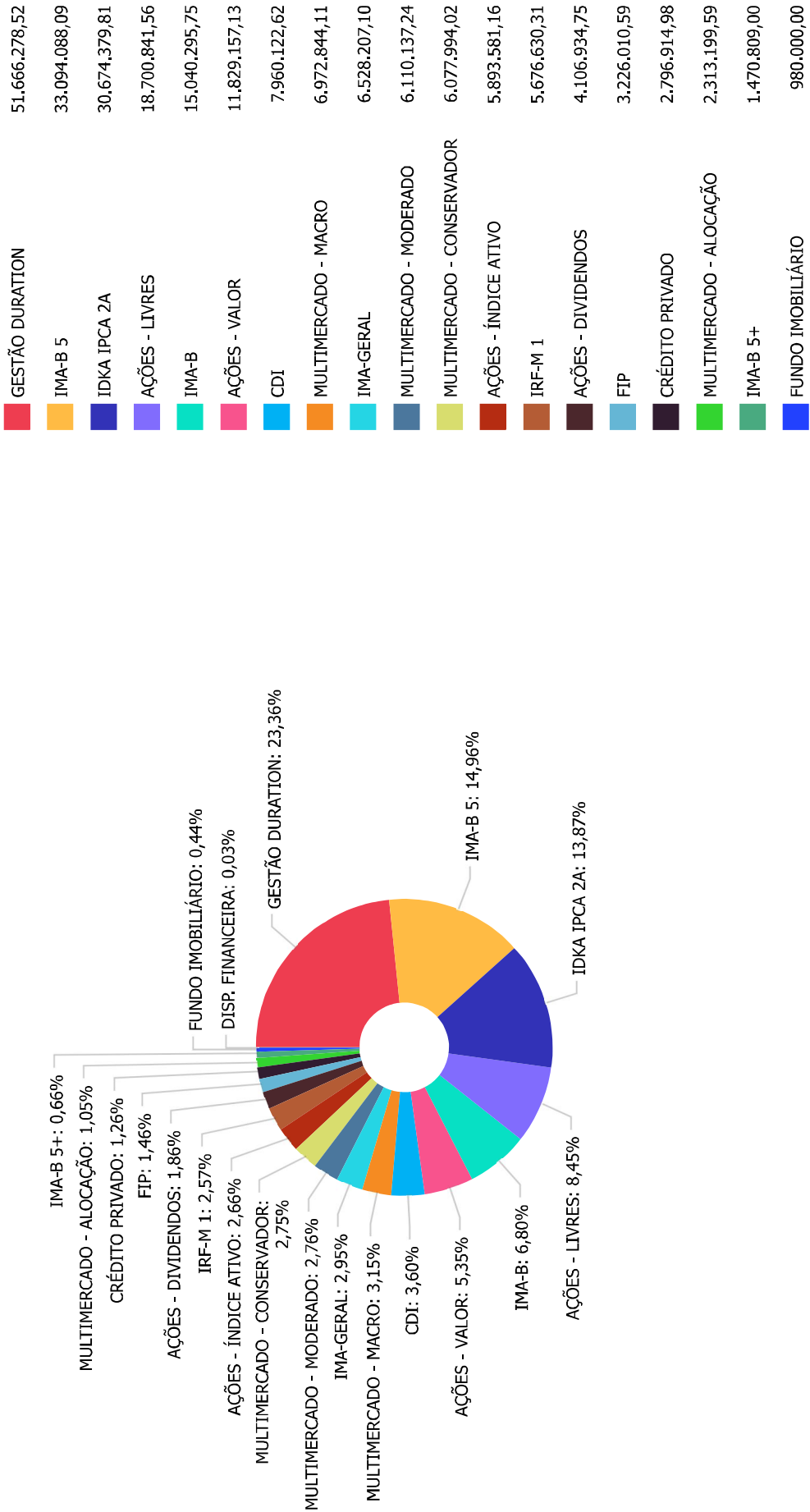
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,41%	-0,18%	1,10%	2,25%	5,00%	-	2,52%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,57%	-0,66%	1,03%	2,61%	3,70%	17,13%	2,21%	0,08%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,14%	-1,71%	0,81%	2,32%	3,52%	11,18%	3,60%	0,12%
IFIX (Benchmark)	0,25%	0,57%	2,78%	3,75%	-2,61%	18,56%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-14,12%	-28,39%	-31,94%	-36,77%	-33,51%	-5,15%	15,82%	0,51%

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



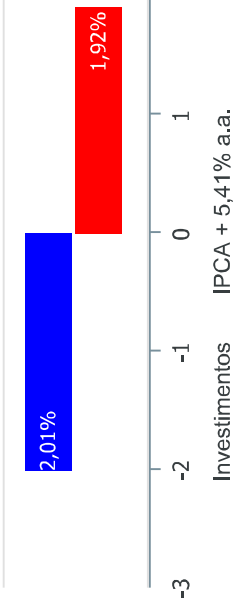
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

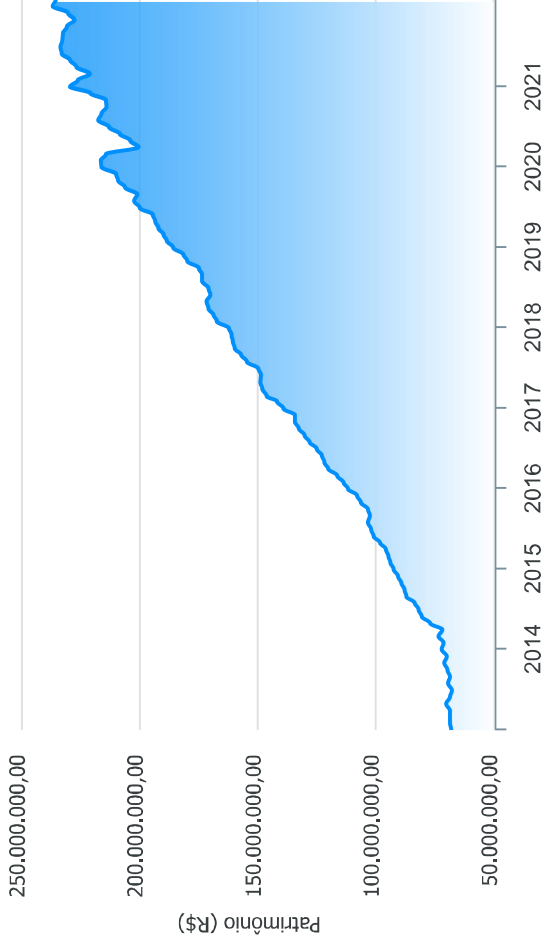
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	226.901.548,33	205.063,27	1.394.306,30	223.875.628,40	-1.836.676,90	-1.836.676,90	-0,81%	-0,81%	0,67%	0,67%	-120,80%	3,22%
Fevereiro	223.875.628,40	2.124.289,00	4.822.101,58	218.469.134,25	-2.708.681,57	-4.545.358,47	-1,21%	-2,01%	1,24%	1,92%	-104,74%	3,18%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- ☐ Investimentos
- ☐ IMA-B 5
- ☐ IRF-M 1+
- ☐ Investimentos
- ☐ IMA-B 5+
- ☐ Ibovespa
- ☐ IBX
- ☐ SMILL
- ☐ IDIV

☐ Meta de Rentabilidade☐ IMA Geral☐ IBX☐ SMLL☐ IDIV☐ CDI☐ IRF-M☐ SMLL☐ IDIV☐ IMA-B☐ IRF-M 1☐ CDI☐ IMA-B☐ IRF-M 1+

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
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.501.676,00	0,00	42.619,61	1.470.809,00	11.762,61	0,78%	-2,06%	5,00%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	565.545,28	0,00	3.679,89	562.376,42	511,03	0,09%	0,09%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	165.970,20	0,00	0,00	166.094,08	123,88	0,07%	0,07%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	6.772.110,07	0,00	3.000.000,00	3.776.160,15	4.050,08	0,06%	0,06%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.515.448,51	2.349.993,80	1.836.105,57	4.031.265,12	1.928,38	0,03%	0,05%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.675.605,36	0,00	0,00	5.676.630,31	1.024,95	0,02%	0,02%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.401.073,66	0,00	36.018,29	1.365.046,46	-8,91	0,00%	-0,01%	0,71%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.204.133,46	0,00	0,00	2.201.434,84	-2.698,62	-0,12%	-0,12%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.000.460,16	0,00	0,00	998.952,16	-1.508,00	-0,15%	-0,15%	0,25%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.460.455,17	0,00	0,00	32.295.704,57	-164.750,60	-0,51%	-0,51%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.180.118,52	0,00	0,00	16.095.037,70	-85.080,82	-0,53%	-0,53%	1,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.659.712,35	0,00	0,00	14.579.342,11	-80.370,24	-0,55%	-0,55%	1,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.537.876,72	0,00	0,00	2.523.035,51	-14.841,21	-0,58%	-0,58%	1,39%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.754.779,86	0,00	0,00	12.676.397,00	-78.382,86	-0,61%	-0,61%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.632.688,37	0,00	0,00	16.529.609,12	-103.079,25	-0,62%	-0,62%	1,17%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	749.936,00	0,00	0,00	745.168,00	-4.768,00	-0,64%	-0,64%	1,13%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.588.421,06	0,00	0,00	6.528.207,10	-60.213,96	-0,91%	-0,91%	1,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.727.704,88	0,00	0,00	10.628.117,53	-99.587,35	-0,93%	-0,93%	1,29%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.014.328,41	0,00	0,00	4.966.296,27	-48.032,14	-0,96%	-0,96%	1,16%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.073.991,86	0,00	0,00	2.051.746,98	-22.244,88	-1,07%	-1,07%	1,54%

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.662.907,71	0,00	0,00	8.530.118,48	-132.789,23	-1,53%	-1,53%	2,31%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.617.963,73	0,00	0,00	6.510.177,27	-107.786,46	-1,63%	-1,63%	2,38%
Total Renda Fixa	158.462.907,34	2.349.993,80	4.918.423,36	154.907.726,18	-986.751,60	-0,62%		1,17%

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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.934.467,50	0,00	0,00	2.948.356,74	13.889,24	0,47%	0,47%	10,10%
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	3.228.449,04	0,00	0,00	3.226.010,59	-2.438,45	-0,08%	-0,08%	0,06%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	6.095.094,41	0,00	0,00	6.077.994,02	-17.100,39	-0,28%	-0,28%	0,75%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.135.416,55	0,00	0,00	6.110.137,24	-25.279,31	-0,41%	-0,41%	2,52%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.012.949,66	0,00	0,00	6.972.844,11	-40.105,55	-0,57%	-0,57%	2,21%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.339.748,85	0,00	0,00	2.313.199,59	-26.549,26	-1,13%	-1,13%	3,60%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.371.484,79	0,00	0,00	3.286.256,24	-85.228,55	-2,53%	-2,53%	8,73%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.938.592,62	0,00	0,00	2.863.159,14	-75.433,48	-2,57%	-2,57%	10,09%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.704.689,23	0,00	0,00	3.601.424,51	-103.264,72	-2,79%	-2,79%	10,27%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.707.717,14	0,00	0,00	2.626.715,52	-81.001,62	-2,99%	-2,99%	11,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	3.016.303,03	0,00	0,00	2.920.938,79	-95.364,24	-3,16%	-3,16%	10,01%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	3.376.368,47	0,00	0,00	3.266.865,64	-109.502,83	-3,24%	-3,24%	13,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.219.109,32	0,00	0,00	3.080.706,14	-138.403,18	-4,30%	-4,30%	10,53%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.292.042,97	0,00	0,00	4.106.934,75	-185.108,22	-4,31%	-4,31%	11,89%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.087.237,74	0,00	0,00	1.995.631,04	-91.606,70	-4,39%	-4,39%	10,78%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.354.128,76	0,00	0,00	9.833.526,09	-520.602,67	-5,03%	-5,03%	13,40%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.141.100,00	0,00	0,00	980.000,00	-161.100,00	-14,12%	-14,12%	15,82%
Total Renda Variável	67.954.900,08	0,00	0,00	66.210.700,15	-1.744.199,93	-2,57%		7,88%

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 4.963/2021, provenientes do recolhimento das aliquotas 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 4.963 de 25 de novembro de 2021 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.