

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)

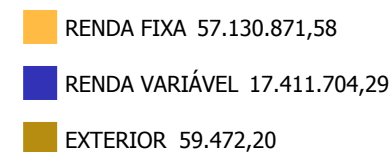
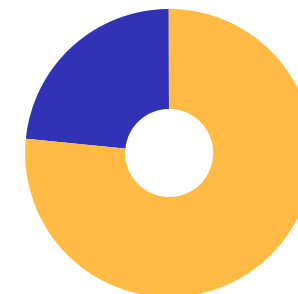
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.766.146,27	10,41%	885	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.212.575,12	5,65%	922	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.553.263,96	6,10%	588	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.543.822,62	2,07%	1.225	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.257.518,27	1,69%	701	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.287.526,27	4,41%	1.361	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	844.676,91	1,13%	445	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.343.458,47	7,16%	976	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.156.916,30	4,23%	1.005	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.285.513,85	5,74%	685	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	936.832,23	1,26%	102	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.120.073,43	8,20%	431	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.290.819,99	7,09%	196	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.073.529,66	2,78%	576	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.657,54	0,01%	641	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.642.044,84	2,20%	272	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	347.609,92	0,47%	110	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.092.093,53	5,49%	269	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	370.792,40	0,50%	117	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.564.521,85	2,10%	6.642	0,82%	Artigo 8º, Inciso I, 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
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	D+3	Não há	997.905,67	1,34%	52	0,28%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.350.573,49	1,81%	68	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	668.239,49	0,90%	1.837	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.449.078,73	3,28%	202	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.798.849,52	2,41%	2.098	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.975.554,12	3,99%	38.437	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.379.226,66	1,85%	193	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.514.327,29	2,03%	97	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.508.546,47	3,36%	18.848	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	204.881,00	0,27%	18.236	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	59.472,20	0,08%	191	0,00%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			74.602.048,07				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.460.204,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	36.251.418,04	48,59%	20,00%	50,00%	90,00%	30.890.425,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	44.761.228,84
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	20.879.453,54	27,99%	10,00%	15,00%	40,00%	8.961.365,69
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.730.102,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.730.102,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.730.102,40
Total Renda Fixa	100,00%	57.130.871,58	76,58%	30,00%	70,00%	215,00%	



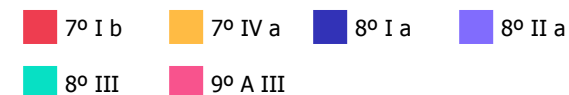
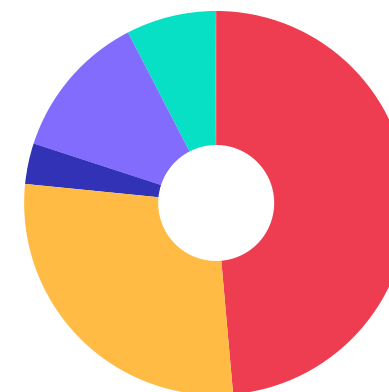
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	2.562.427,52	3,43%	0,00%	3,00%	10,00%	4.897.777,29
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	9.242.295,35	12,39%	5,00%	15,00%	20,00%	5.678.114,26
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.606.981,42	7,52%	3,00%	10,00%	10,00%	1.853.223,39
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.730.102,40
Total Renda Variável	35,00%	17.411.704,29	23,34%	8,00%	30,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	59.472,20	0,08%	0,00%	0,00%	1,00%	686.548,28
Total Exterior	10,00%	59.472,20	0,08%	0,00%	0,00%	1,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.430.939,78	40,79	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.979.014,44	36,16	0,00
BRANCO ASSET MANAGEMENT	9.776.836,28	13,11	0,00
ITAÚ UNIBANCO	7.415.257,57	9,94	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 ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	36.251.418,04	48,59	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	20.879.453,54	27,99	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	2.562.427,52	3,43	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	9.242.295,35	12,39	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.606.981,42	7,52	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	59.472,20	0,08	0,00	1,00

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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	2,12%	4,85%	2,83%	3,09%	4,85%	18,09%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,38%	5,09%	3,18%	3,28%	5,09%	18,83%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	7,92%	3,22%	4,89%	7,92%	20,01%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,01%	0,03%
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%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,00%	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%	0,01%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,81%	7,78%	3,34%	4,56%	7,78%	21,67%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,81%	5,92%	7,04%	8,01%	5,92%	29,81%	0,02%	0,11%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,94%	6,30%	7,16%	8,14%	6,30%	30,60%	0,02%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	4,94%	7,53%	7,12%	7,90%	7,53%	33,84%	0,02%	0,10%

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
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%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,96%	6,43%	1,93%	1,62%	6,43%	18,87%	0,01%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36%	2,42%	0,64%	1,03%	2,42%	8,27%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,25%	2,40%	0,57%	1,01%	2,40%	8,28%	0,00%	0,00%

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%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,01%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,48%	4,66%	3,00%	2,83%	4,66%	17,68%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	-	3,66%	3,62%	-	-	0,01%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,00%	-	1,57%	1,56%	-	-	0,00%	-

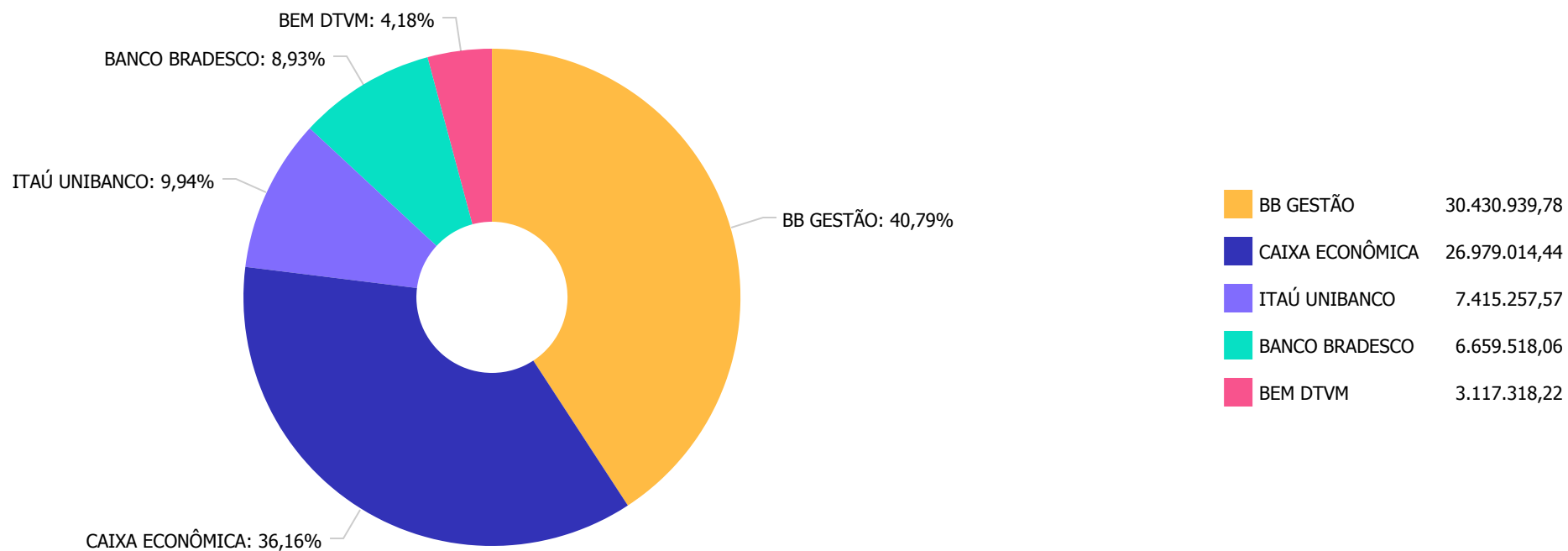
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	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 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	9,09%	4,61%	24,13%	24,17%	4,61%	34,90%	0,07%	0,41%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	9,30%	2,59%	25,72%	25,02%	2,59%	34,71%	0,07%	0,42%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	8,40%	5,24%	19,08%	23,30%	5,24%	42,55%	0,07%	0,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10,72%	5,98%	32,39%	29,35%	5,98%	49,89%	0,08%	0,40%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	7,90%	-3,67%	20,63%	27,64%	-3,67%	22,88%	0,07%	0,41%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,10%	2,01%	1,91%	1,07%	2,01%	11,22%	0,00%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,56%	2,52%	6,28%	5,81%	2,52%	16,57%	0,02%	0,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,70%	3,52%	4,23%	4,60%	3,52%	22,23%	0,01%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	6,49%	2,72%	19,96%	19,14%	2,72%	-	0,05%	0,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,26%	3,04%	4,08%	4,74%	3,04%	-	0,01%	0,11%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,61%	-1,90%	14,88%	16,21%	-1,90%	41,74%	0,06%	0,42%

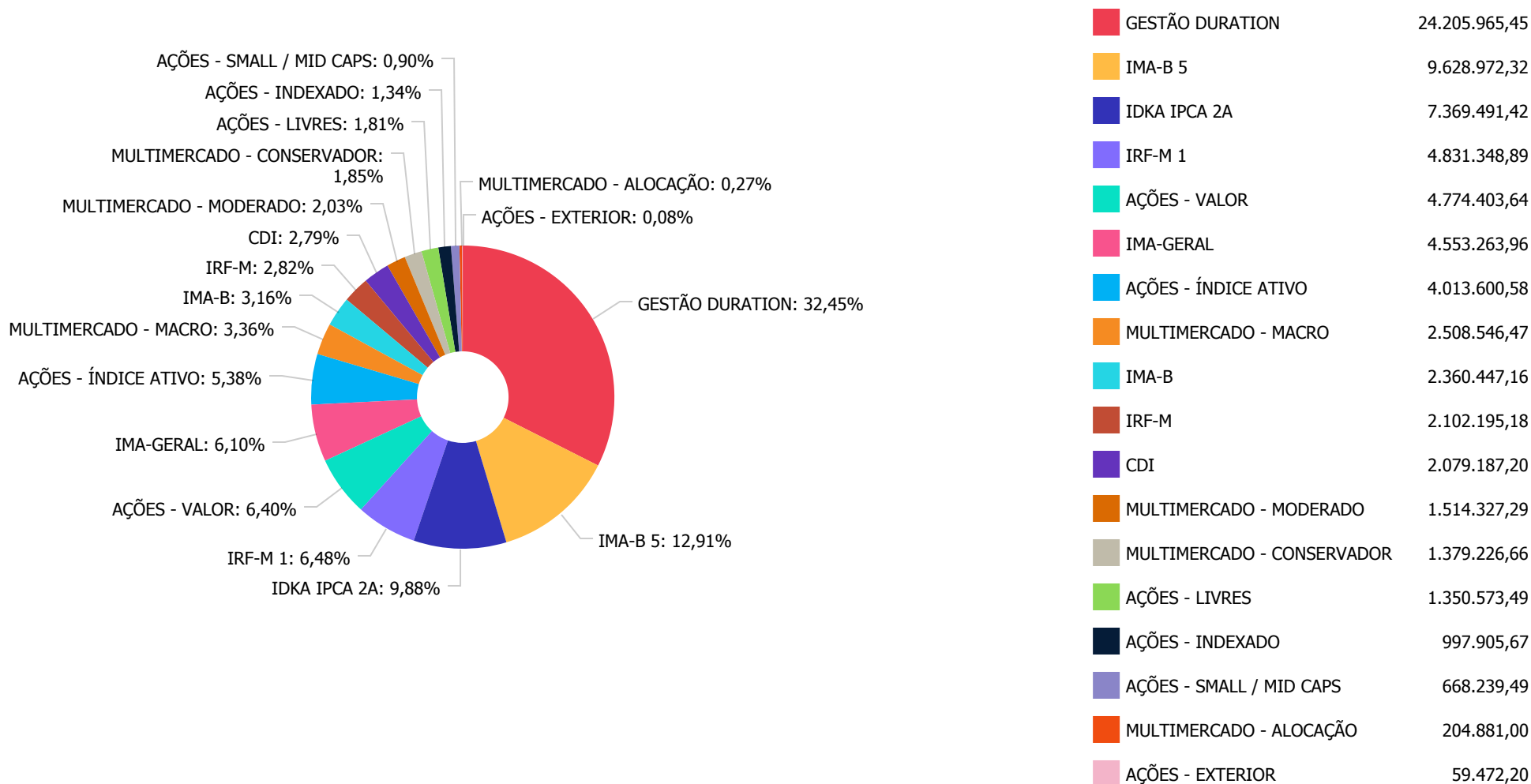
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,93%	54,01%	1,70%	16,29%	54,01%	108,94%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,69%	54,76%	1,31%	16,49%	54,76%	108,09%	0,07%	0,22%

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



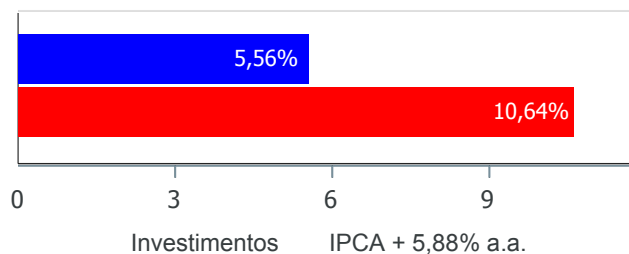
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

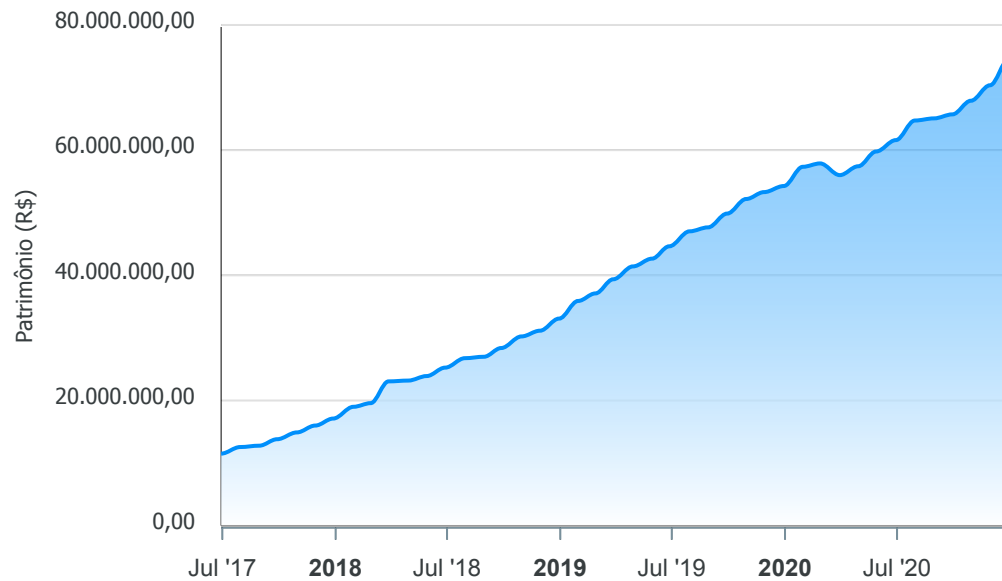
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	54.269.143,32	3.873.858,42	1.050.077,24	57.342.913,30	249.988,80	249.988,80	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,58%	1,57%
Fevereiro	57.342.913,30	3.585.545,94	2.597.355,99	57.839.541,87	-491.561,38	-241.572,58	-0,84%	-0,41%	0,66%	1,38%	-29,70%	2,88%
Março	57.839.541,87	1.452.002,00	107.308,09	56.010.479,82	-3.173.755,96	-3.415.328,54	-5,36%	-5,75%	0,57%	1,95%	-294,22%	11,37%
Abril	56.010.479,82	432.509,84	99.539,65	57.248.662,93	905.212,92	-2.510.115,62	1,61%	-4,23%	0,14%	2,10%	-201,67%	5,72%
Mai	57.248.662,93	2.438.209,30	1.135.517,06	59.787.400,05	1.236.044,88	-1.274.070,74	2,11%	-2,21%	0,07%	2,17%	-101,80%	3,17%
Junho	59.787.400,05	1.600.755,44	1.110.311,35	61.471.243,03	1.193.398,89	-80.671,85	1,98%	-0,28%	0,74%	2,93%	-9,47%	2,71%
Julho	61.471.243,03	1.677.544,06	183.618,44	64.332.265,33	1.367.096,68	1.286.424,83	2,17%	1,89%	0,88%	3,84%	49,17%	2,33%
Agosto	64.332.265,33	1.257.100,23	90.716,66	65.076.189,58	-422.459,32	863.965,51	-0,64%	1,23%	0,72%	4,59%	26,84%	2,31%
Setembro	65.076.189,58	1.453.773,28	87.159,66	65.719.668,52	-723.134,68	140.830,83	-1,09%	0,13%	1,12%	5,76%	2,24%	3,02%
Outubro	65.719.668,52	1.820.157,96	94.620,76	67.430.642,51	-14.563,21	126.267,62	-0,02%	0,11%	1,34%	7,18%	1,50%	2,74%
Novembro	67.430.642,51	1.224.823,46	98.646,67	70.368.729,60	1.811.910,30	1.938.177,92	2,64%	2,75%	1,35%	8,62%	31,94%	2,55%
Dezembro	70.368.729,60	4.820.870,16	2.567.800,24	74.602.048,07	1.980.248,55	3.918.426,47	2,73%	5,56%	1,86%	10,64%	52,22%	1,71%

Investimentos x Meta Atuarial



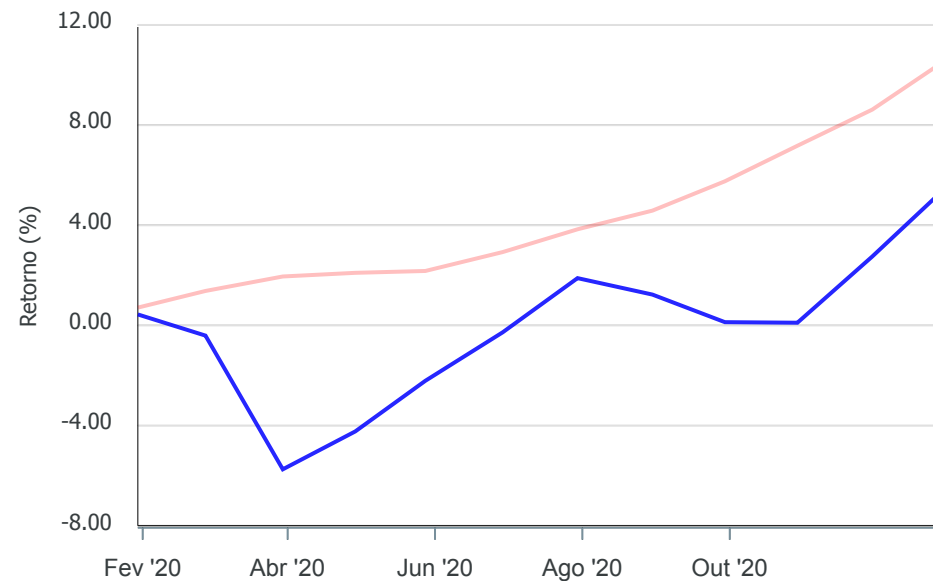
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	353.324,82	0,00	0,00	370.792,40	17.467,58	4,94%	4,94%	2,09%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	331.251,74	0,00	0,00	347.609,92	16.358,18	4,94%	4,94%	2,07%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.566.732,94	0,00	0,00	1.642.044,84	75.311,90	4,81%	4,81%	2,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.959.378,88	0,00	0,00	6.120.073,43	160.694,55	2,70%	2,70%	1,09%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.162.795,16	0,00	0,00	5.290.819,99	128.024,83	2,48%	2,48%	1,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.447.457,58	0,00	0,00	4.553.263,96	105.806,38	2,38%	2,38%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.749.932,87	500.000,00	0,00	5.343.458,47	93.525,60	1,78%	1,82%	0,74%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.728.291,09	0,00	500.000,00	1.257.518,27	29.227,18	1,69%	1,96%	1,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.105.591,35	0,00	0,00	3.156.916,30	51.324,95	1,65%	1,65%	0,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.149.272,66	0,00	0,00	4.212.575,12	63.302,46	1,53%	1,53%	0,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.133.803,40	1.088.818,72	0,00	4.285.513,85	62.891,73	1,49%	1,81%	0,75%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.325.487,17	0,00	500.000,00	844.676,91	19.189,74	1,45%	1,96%	1,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.664.918,51	0,00	0,00	7.766.146,27	101.227,76	1,32%	1,32%	0,55%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	919.962,06	7.589,28	0,00	936.832,23	9.280,89	1,00%	1,00%	0,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.539.006,39	0,00	0,00	1.543.822,62	4.816,23	0,31%	0,31%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.278.192,20	0,00	0,00	3.287.526,27	9.334,07	0,28%	0,28%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.083.837,64	0,00	0,00	4.092.093,53	8.255,89	0,20%	0,20%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	70.051,04	0,00	64.516,30	5.657,54	122,80	0,18%	0,36%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	349.190,17	1.787.288,85	66.110,63	2.073.529,66	3.161,27	0,15%	0,25%	0,02%
Total Renda Fixa	53.918.477,67	3.383.696,85	1.130.626,93	57.130.871,58	959.323,99	1,71%		0,73%

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	1.624.699,52	0,00	0,00	1.798.849,52	174.150,00	10,72%	10,72%	7,54%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	913.038,90	0,00	0,00	997.905,67	84.866,77	9,29%	9,29%	7,08%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.434.148,92	0,00	0,00	1.564.521,85	130.372,93	9,09%	9,09%	6,84%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	615.276,40	0,00	0,00	668.239,49	52.963,09	8,61%	8,61%	5,68%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.269.677,18	0,00	0,00	2.449.078,73	179.401,55	7,90%	7,90%	6,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.342.235,74	0,00	1.437.173,31	0,00	94.937,57	7,07%	7,97%	6,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.268.291,18	0,00	0,00	1.350.573,49	82.282,31	6,49%	6,49%	5,37%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.398.118,65	1.437.173,31	0,00	2.975.554,12	140.262,16	4,95%	8,40%	6,93%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	199.765,65	0,00	0,00	204.881,00	5.115,35	2,56%	2,56%	1,80%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.466.599,77	0,00	0,00	2.508.546,47	41.946,70	1,70%	1,70%	0,93%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.495.116,97	0,00	0,00	1.514.327,29	19.210,32	1,28%	1,26%	1,39%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.364.220,49	0,00	0,00	1.379.226,66	15.006,17	1,10%	1,10%	0,47%
Total Renda Variável	16.391.189,37	1.437.173,31	1.437.173,31	17.411.704,29	1.020.514,92	5,72%		4,91%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/12/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Dezembro / 2020)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	59.062,56	0,00	0,00	59.472,20	409,64	0,69%	0,69%	7,07%
Total Renda Variável	59.062,56	0,00	0,00	59.472,20	409,64	0,69%		7,07%

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.590.879,05	2.319.418,67	0,00	6.120.073,43	209.775,71	3,55%	3,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.681.054,83	500.000,00	0,00	5.343.458,47	162.403,64	3,13%	3,32%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.610.784,05	0,00	0,00	7.766.146,27	155.362,22	2,04%	2,04%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.136.950,90	0,00	0,00	5.290.819,99	153.869,09	3,00%	3,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.413.162,11	0,00	0,00	4.553.263,96	140.101,85	3,17%	3,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.080.996,12	0,00	0,00	4.212.575,12	131.579,00	3,22%	3,22%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.087.440,84	1.088.818,72	0,00	4.285.513,85	109.254,29	2,62%	3,34%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.534.026,18	0,00	0,00	1.642.044,84	108.018,66	7,04%	7,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.063.542,88	0,00	0,00	3.156.916,30	93.373,42	3,05%	3,05%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.727.821,11	0,00	500.000,00	1.257.518,27	29.697,16	1,72%	1,99%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	346.026,41	0,00	0,00	370.792,40	24.765,99	7,16%	7,16%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	324.510,32	0,00	0,00	347.609,92	23.099,60	7,12%	7,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.266.471,43	0,00	0,00	3.287.526,27	21.054,84	0,64%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.325.877,38	0,00	500.000,00	844.676,91	18.799,53	1,42%	1,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.076.407,85	0,00	0,00	4.092.093,53	15.685,68	0,38%	0,38%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	371.634,82	551.190,45	0,00	936.832,23	14.006,96	1,52%	1,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.534.233,20	0,00	0,00	1.543.822,62	9.589,42	0,63%	0,63%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	253.792,81	1.969.250,43	153.755,72	2.073.529,66	4.242,14	0,19%	0,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	175.309,28	0,00	170.138,64	5.657,54	486,90	0,28%	0,64%
				Total Renda Fixa	1.425.166,10	2,56%	

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.358.707,76	0,00	0,00	1.798.849,52	440.141,76	32,39%	32,39%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.030.190,62	0,00	0,00	2.449.078,73	418.888,11	20,63%	20,63%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.260.389,12	0,00	0,00	1.564.521,85	304.132,73	24,13%	24,13%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.272.680,44	1.437.173,31	0,00	2.975.554,12	265.700,37	9,80%	19,08%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.125.849,43	0,00	0,00	1.350.573,49	224.724,06	19,96%	19,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.229.485,84	0,00	1.437.173,31	0,00	207.687,47	16,89%	17,87%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	793.772,13	0,00	0,00	997.905,67	204.133,54	25,72%	25,72%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.406.652,84	0,00	0,00	2.508.546,47	101.893,63	4,23%	4,23%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	581.662,36	0,00	0,00	668.239,49	86.577,13	14,88%	14,88%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.454.536,58	0,00	0,00	1.514.327,29	59.790,71	4,11%	4,08%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.353.342,03	0,00	0,00	1.379.226,66	25.884,63	1,91%	1,91%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	192.776,39	0,00	0,00	204.881,00	12.104,61	6,28%	6,28%
				Total Renda Variável	2.351.658,75	14,25%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	58.701,41	0,00	0,00	59.472,20	770,79	1,31%	1,31%
				Total Exterior	770,79	1,31%	

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.280.905,42	0,00	0,00	7.766.146,27	485.240,85	6,66%	6,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.004.242,66	731.219,06	756.650,56	5.343.458,47	364.647,31	6,36%	7,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.972.896,45	670.566,98	750.000,00	4.212.575,12	319.111,69	6,87%	7,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.148.663,75	0,00	2.255.000,00	3.156.916,30	263.252,55	5,11%	8,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.701.170,77	348.710,19	0,00	5.290.819,99	240.939,03	4,77%	4,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.386.822,48	1.910.546,99	250.000,00	4.285.513,85	238.144,38	5,54%	7,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.332.732,69	0,00	0,00	4.553.263,96	220.531,27	5,09%	5,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	5.934.783,00	0,00	6.120.073,43	185.290,43	3,12%	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.517.481,29	0,00	1.642.044,84	124.563,55	8,21%	5,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.847.337,20	131.333,12	0,00	4.092.093,53	113.423,21	2,85%	2,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.043.157,71	131.833,89	0,00	3.287.526,27	112.534,67	3,54%	3,63%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.656.283,83	0,00	500.000,00	1.257.518,27	101.234,44	6,11%	6,40%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.269.827,30	0,00	500.000,00	844.676,91	74.849,61	5,89%	6,43%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	413.574,42	1.097.627,14	0,00	1.543.822,62	32.621,06	2,16%	3,47%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	329.403,05	0,00	347.609,92	18.206,87	5,53%	7,53%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	920.490,65	0,00	936.832,23	16.341,58	1,78%	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	354.983,81	0,00	370.792,40	15.808,59	4,45%	6,30%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.094.854,35	2.149.193,23	1.185.782,92	2.073.529,66	15.265,00	0,47%	2,40%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.463,16	625.143,35	624.059,62	5.657,54	3.110,65	0,50%	2,42%
				Total Renda Fixa	2.945.116,74	5,44%	

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
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	0,00	2.616.172,58	0,00	2.975.554,12	359.381,54	13,74%	5,24%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.265.433,63	0,00	1.564.521,85	299.088,22	23,64%	4,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	666.820,03	886.407,42	0,00	1.798.849,52	245.622,07	15,81%	5,98%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	787.000,00	0,00	997.905,67	210.905,67	26,80%	2,59%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	416.634,79	753.618,15	0,00	1.350.573,49	180.320,55	15,41%	2,72%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.423.344,11	0,00	0,00	2.508.546,47	85.202,36	3,52%	3,52%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.464.005,40	0,00	1.514.327,29	50.321,89	3,44%	3,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.265.275,79	87.000,00	0,00	1.379.226,66	26.950,87	1,99%	2,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	200.000,00	0,00	204.881,00	4.881,00	2,44%	2,52%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	960.899,50	0,00	964.005,40	0,00	3.105,90	0,32%	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	670.000,00	0,00	668.239,49	-1.760,51	-0,26%	-1,90%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.542.445,39	0,00	0,00	2.449.078,73	-93.366,66	-3,67%	-3,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.839.791,52	0,00	1.437.173,31	0,00	-402.618,21	-21,88%	-21,23%
Total Renda Variável					968.034,69	5,89%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	54.197,16	0,00	59.472,20	5.275,04	9,73%	54,76%
				Total Exterior	5.275,04	9,73%	