

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos
em fevereiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

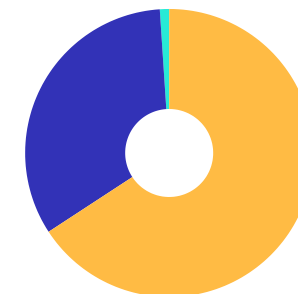
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.166.077,75	2,23%	89	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.186.401,91	1,70%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	18.000.547,88	9,62%	706	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	15.987.610,85	8,54%	903	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.761.557,18	4,68%	677	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRASESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.070.972,62	1,64%	121	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	8.297.092,77	4,43%	989	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	18.033.205,26	9,64%	1.012	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	322.316,25	0,17%	1.341	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.549.349,56	2,96%	53	5,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	176.617,98	0,09%	778	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	6.614.266,38	3,53%	81	6,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.221.353,92	6,00%	264	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	750.442,95	0,40%	300	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.167.813,52	2,76%	143	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.033.338,67	4,83%	195	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.542.964,59	2,43%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	246.894,19	0,13%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	9.238.380,86	4,94%	6.286	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.260.539,26	1,21%	19.147	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.125.941,01	1,67%	7	0,88%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.383.384,82	1,27%	4.052	1,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.306.019,28	1,77%	2.888	6,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	2.712.843,58	1,45%	176	2,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.776.673,90	1,48%	40.797	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.813.148,44	2,04%	123	0,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.761.177,61	1,48%	2.036	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.845.118,99	1,52%	2.885	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.142.457,40	1,68%	1.340	1,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.767.620,28	2,01%	6.474	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.855.718,83	0,99%	121	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.281.065,25	2,82%	1.414	2,40%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.549.831,60	3,50%	18.112	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	3.013.557,43	1,61%	15	3,28%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.249.205,06	1,74%	28	2,32%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.951.588,23	1,04%	805	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			187.163.096,06				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Fevereiro / 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%	0,00%	10,00%	18.716.309,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	79.825.782,47	42,65%	15,00%	36,00%	76,00%	62.418.170,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	112.297.857,64
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	50,00%	38.513.182,98	20,58%	5,00%	20,00%	40,00%	36.352.055,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	10,00%	4.789.858,78	2,56%	0,00%	4,00%	10,00%	13.926.450,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.358.154,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.358.154,80
Total Renda Fixa	100,00%	123.128.824,23	65,79%	20,00%	60,00%	206,00%	



RENTA FIXA 123.128.824,23

RENTA VARIÁVEL 62.082.683,60

EXTERIOR 1.951.588,23

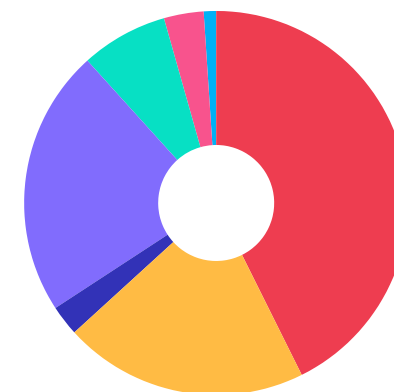
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REND A VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 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%	0,00%	10,00%	18.716.309,61
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.716.309,61
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	42.133.305,43	22,51%	7,00%	27,00%	30,00%	14.015.623,39
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.686.615,68	7,31%	5,00%	8,00%	10,00%	5.029.693,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.262.762,49	3,35%	0,00%	5,00%	5,00%	3.095.392,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.358.154,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.358.154,80
Total Renda Variável	40,00%	62.082.683,60	33,17%	12,00%	40,00%	75,00%	

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%	0,00%	5,00%	9.358.154,80
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	18.716.309,61
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.951.588,23	1,04%	0,00%	0,00%	10,00%	16.764.721,38
Total Exterior	10,00%	1.951.588,23	1,04%	0,00%	0,00%	25,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	49.940.499,68	26,68	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	37.530.226,64	20,05	-
ITAÚ UNIBANCO	19.165.841,34	10,24	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	12.163.615,94	6,50	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	12.104.311,29	6,47	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	9.238.380,86	4,94	-
BANCO J. SAFRA S/A	7.973.384,81	4,26	-
TRÍGONO CAPITAL	6.431.960,29	3,44	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.281.065,25	2,82	-
AURORA CAPITAL	4.542.964,59	2,43	-
VINCI PARTNERS	3.813.148,44	2,04	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.767.620,28	2,01	-
KPTL	3.249.205,06	1,74	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.142.457,40	1,68	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.013.557,43	1,61	-
PERFIN INVESTIMENTOS	2.845.118,99	1,52	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.712.843,58	1,45	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	246.894,19	0,13	-

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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	79.825.782,47	42,65	15,00	76,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	38.513.182,98	20,58	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.789.858,78	2,56	0,00	10,00
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 I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	42.133.305,43	22,51	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	13.686.615,68	7,31	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.262.762,49	3,35	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	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.951.588,23	1,04	0,00	10,00

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
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-1,15%	-2,01%	-0,09%	-0,80%	4,24%	17,06%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-1,24%	-2,07%	-0,16%	-0,97%	3,89%	16,51%	1,35%	0,04%
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	2,15%	4,14%	8,44%	12,47%	25,13%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-3,81%	-0,06%	-0,14%	-0,11%	-11,64%	-26,95%	-	0,07%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,33%	-3,98%	3,24%	3,38%	0,95%	23,20%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,75%	1,83%	10,22%	4,30%	8,23%	15,25%	1,71%	0,14%
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%
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
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-1,88%	-3,55%	1,79%	1,48%	2,47%	21,09%	2,78%	0,12%
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)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,08%	1,64%	10,81%	4,72%	8,60%	14,77%	0,55%	0,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,07%	0,16%	0,25%	0,50%	1,52%	6,29%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,13%	0,23%	0,34%	1,26%	5,77%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	-0,15%	-0,27%	0,02%	0,42%	2,98%	-	0,25%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,86%	1,11%	2,48%	4,95%	5,20%	9,41%	-	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,96%	-1,53%	0,91%	0,42%	2,22%	13,17%	1,16%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,51%	-0,48%	0,83%	1,04%	4,64%	19,53%	0,95%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,49%	-0,36%	1,29%	2,74%	6,55%	21,41%	1,05%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,06%	0,19%	0,40%	0,35%	2,45%	12,28%	0,01%	0,01%

Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,51%	15,06%	14,55%	13,70%	27,44%	33,52%	0,07%	0,22%

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 + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,58%	2,65%	4,94%	10,14%	16,10%	33,38%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	1,25%	4,45%	4,47%	3,93%	-	-	-	0,03%

S&P 500 (Benchmark)	2,61%	1,47%	5,23%	8,88%	29,01%	36,87%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2,59%	2,41%	5,56%	8,58%	24,11%	36,82%	6,61%	0,25%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,42%	2,29%	4,37%	8,93%	13,51%	27,46%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	7,46%	7,30%	7,06%	6,84%	-	-	-	0,08%

IDIV (Benchmark)	-5,21%	-10,02%	-1,98%	7,65%	-3,53%	17,34%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-4,67%	-8,18%	-2,08%	12,05%	-0,71%	26,04%	10,22%	0,40%

Ibovespa (Benchmark)	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,48%	-7,58%	0,32%	8,18%	2,64%	18,37%	12,34%	0,41%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,57%	-6,41%	-0,53%	5,98%	-8,76%	20,18%	10,09%	0,41%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,53%	-3,13%	1,94%	5,65%	10,28%	37,75%	8,73%	0,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,03%	-10,33%	-0,72%	13,05%	5,91%	20,39%	13,40%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,47%	-1,00%	5,24%	12,85%	4,60%	25,63%	10,10%	0,41%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,48%	-6,01%	-1,68%	-6,12%	-11,95%	13,61%	7,79%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-2,66%	-6,01%	0,24%	11,65%	12,64%	27,13%	13,05%	0,39%

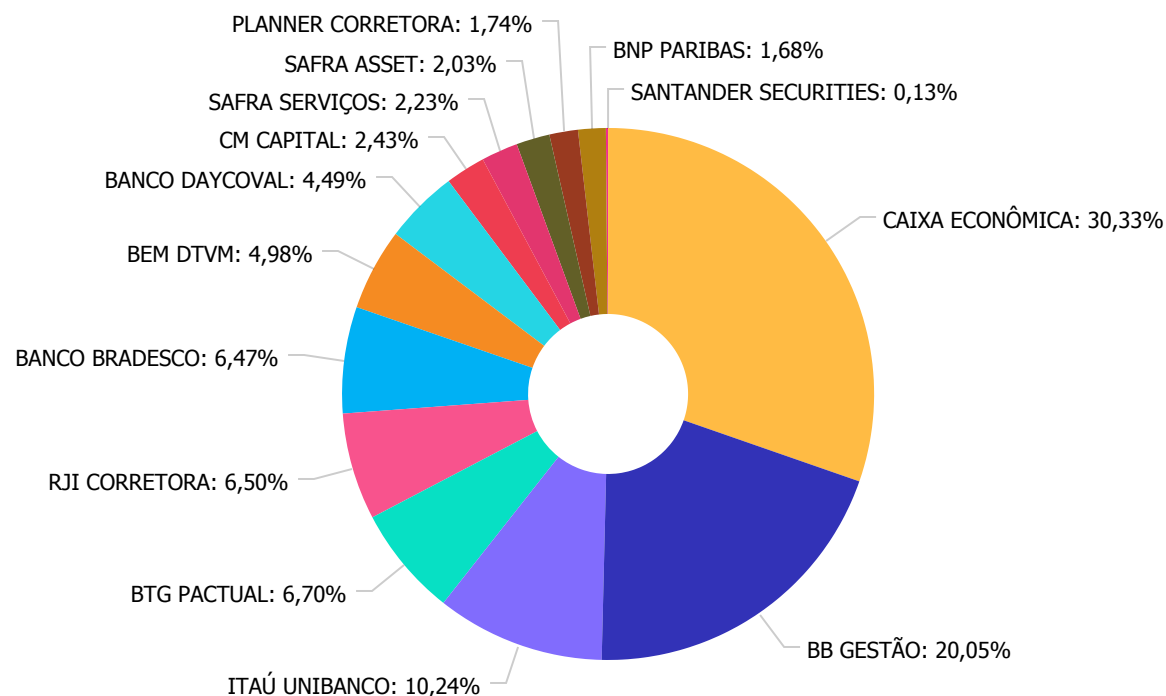
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,12%	6,12%	18,14%	24,29%	-	-	9,28%	-
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,57%	-0,66%	1,03%	2,61%	3,70%	17,13%	2,21%	0,08%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	-0,10%	-0,12%	-0,07%	-0,26%	2,42%	10,03%	0,62%	0,01%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,39%	-7,39%	1,02%	8,83%	-0,22%	28,90%	10,78%	0,42%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	4,25%	6,11%	17,06%	37,82%	22,04%	70,91%	8,20%	0,39%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,85%	-9,57%	-0,15%	10,15%	9,93%	34,73%	13,04%	0,46%

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

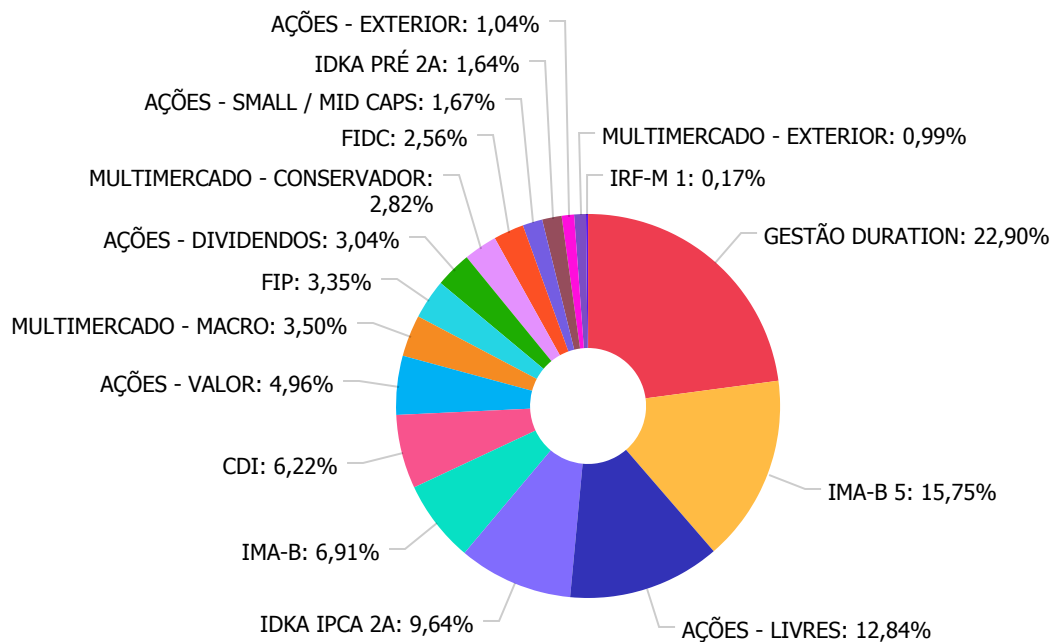
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	3,93%	10,28%	11,31%	9,94%	69,17%	115,88%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,47%	8,39%	8,76%	7,05%	54,45%	100,15%	5,93%	0,22%

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



CAIXA ECONÔMICA	56.767.205,55
BB GESTÃO	37.530.226,64
ITAÚ UNIBANCO	19.165.841,34
BTG PACTUAL	12.544.400,14
RJI CORRETORA	12.163.615,94
BANCO BRADESCO	12.104.311,29
BEM DTVM	9.325.582,85
BANCO DAYCOVAL	8.407.006,26
CM CAPITAL	4.542.964,59
SAFRA SERVIÇOS	4.166.077,75
SAFRA ASSET	3.807.307,06
PLANNER CORRETORA	3.249.205,06
BNP PARIBAS	3.142.457,40
SANTANDER SECURITIES	246.894,19

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

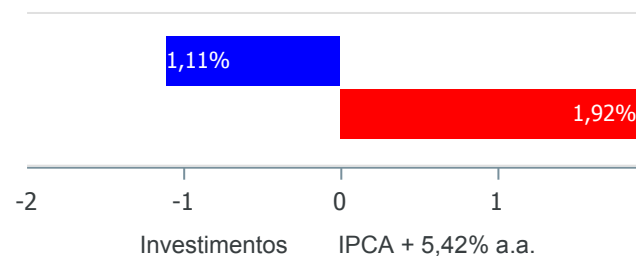


GESTÃO DURATION	42.856.569,82
IMA-B 5	29.484.042,56
AÇÕES - LIVRES	24.030.790,69
IDKA IPCA 2A	18.033.205,26
IMA-B	12.927.634,93
CDI	11.644.224,01
AÇÕES - VALOR	9.287.169,63
MULTIMERCADO - MACRO	6.549.831,60
FIP	6.262.762,49
AÇÕES - DIVIDENDOS	5.689.404,10
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.281.065,25
FIDC	4.789.858,78
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.125.941,01
IDKA PRÉ 2A	3.070.972,62
AÇÕES - EXTERIOR	1.951.588,23
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.855.718,83
IRF-M 1	322.316,25

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	188.473.692,48	5.654.725,25	5.789.001,22	187.393.812,64	-945.603,87	-945.603,87	-0,50%	-0,50%	0,67%	0,67%	-74,79%	3,86%
Fevereiro	187.393.812,64	3.546.838,03	2.619.901,54	187.163.096,06	-1.157.653,07	-2.103.256,94	-0,61%	-1,11%	1,24%	1,92%	-57,98%	3,44%

Investimentos x Meta Atuarial

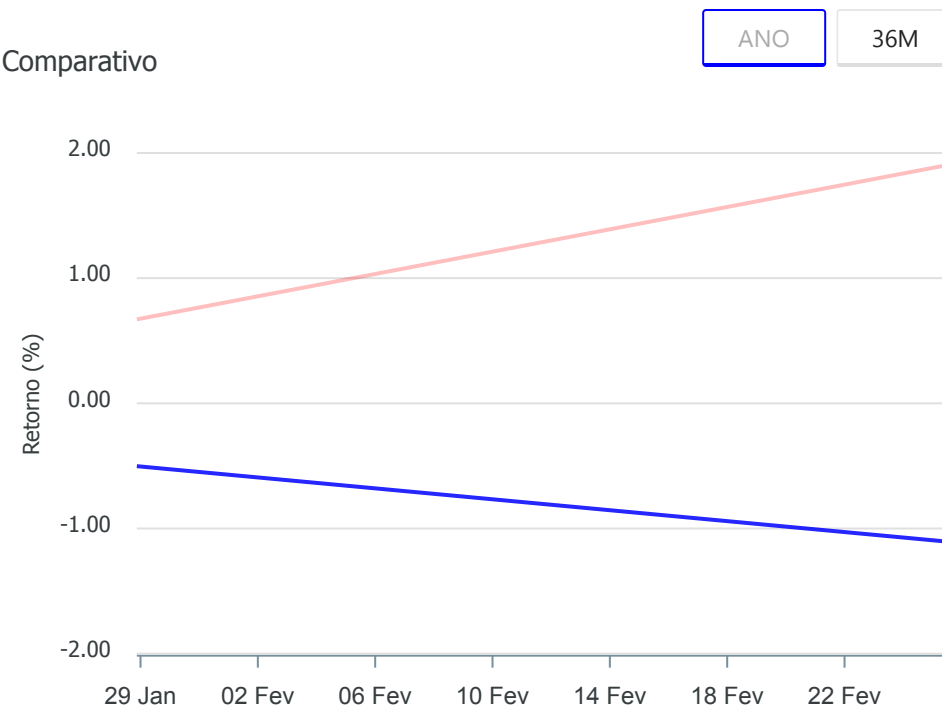


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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 Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.500.625,82	0,00	0,00	6.614.266,38	113.640,56	1,75%	1,75%	1,71%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	5.489.991,89	0,00	0,00	5.549.349,56	59.357,67	1,08%	1,08%	0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.214.646,98	0,00	0,00	11.221.353,92	6.706,94	0,06%	0,06%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	86.755,66	100.610,97	10.800,72	176.617,98	52,07	0,03%	0,05%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	322.258,05	0,00	0,00	322.316,25	58,20	0,02%	0,02%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	534.542,27	1.942.536,59	1.726.952,60	750.442,95	316,69	0,01%	0,07%	0,00%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.722.984,28	0,00	175.036,88	4.542.964,59	-4.982,81	-0,11%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.175.614,75	0,00	0,00	5.167.813,52	-7.801,23	-0,15%	-0,15%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.284.063,57	0,00	82.111,34	3.186.401,91	-15.550,32	-0,47%	-0,49%	1,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.069.168,72	0,00	0,00	15.987.610,85	-81.557,87	-0,51%	-0,51%	0,95%
BBIF MASTER FIDC LP	248.166,67	0,00	0,00	246.894,19	-1.272,48	-0,51%	-0,51%	0,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	17.333.196,39	1.350.000,00	550.000,00	18.033.205,26	-99.991,13	-0,54%	-0,53%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.111.851,93	0,00	0,00	18.000.547,88	-111.304,05	-0,61%	-0,61%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.270.453,90	153.690,47	75.000,00	8.297.092,77	-52.051,60	-0,62%	-0,62%	1,17%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.120.705,69	0,00	0,00	9.033.338,67	-87.367,02	-0,96%	-0,96%	1,16%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.109.529,74	0,00	0,00	3.070.972,62	-38.557,12	-1,24%	-1,24%	1,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.897.949,24	0,00	0,00	8.761.557,18	-136.392,06	-1,53%	-1,53%	2,31%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.246.024,85	0,00	0,00	4.166.077,75	-79.947,10	-1,88%	-1,88%	2,78%
Total Renda Fixa	122.738.530,40	3.546.838,03	2.619.901,54	123.128.824,23	-536.642,66	-0,43%		1,14%

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
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.804.298,68	0,00	0,00	3.013.557,43	209.258,75	7,46%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	3.171.267,05	0,00	0,00	3.306.019,28	134.752,23	4,25%	4,25%	8,20%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.002.211,03	0,00	0,00	3.125.941,01	123.729,98	4,12%	4,12%	9,28%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.808.794,03	0,00	0,00	1.855.718,83	46.924,80	2,59%	2,59%	6,61%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.763.593,43	0,00	0,00	2.776.673,90	13.080,47	0,47%	0,47%	10,10%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.286.378,49	0,00	0,00	5.281.065,25	-5.313,24	-0,10%	-0,10%	0,62%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.252.576,21	0,00	0,00	3.249.205,06	-3.371,15	-0,10%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.587.504,11	0,00	0,00	6.549.831,60	-37.672,51	-0,57%	-0,57%	2,21%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.917.524,44	0,00	0,00	2.845.118,99	-72.405,45	-2,48%	-2,48%	7,79%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.477.976,85	0,00	0,00	9.238.380,86	-239.595,99	-2,53%	-2,53%	8,73%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.866.882,91	0,00	0,00	3.767.620,28	-99.262,63	-2,57%	-2,57%	10,09%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.787.040,65	0,00	0,00	2.712.843,58	-74.197,07	-2,66%	-2,66%	13,05%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.988.185,77	0,00	0,00	3.813.148,44	-175.037,33	-4,39%	-4,39%	10,78%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.289.914,10	0,00	0,00	3.142.457,40	-147.456,70	-4,48%	-4,48%	12,34%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.500.000,00	0,00	0,00	2.383.384,82	-116.615,18	-4,66%	-4,66%	10,22%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.375.659,01	0,00	0,00	2.260.539,26	-115.119,75	-4,85%	-4,85%	13,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.907.358,79	0,00	0,00	2.761.177,61	-146.181,18	-5,03%	-5,03%	13,40%
Total Renda Variável	62.787.165,55	0,00	0,00	62.082.683,60	-704.481,95	-1,12%		8,26%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA - IMP
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 26/02/2021

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.868.116,69	0,00	0,00	1.951.588,23	83.471,54	4,47%	4,47%	5,93%
Total Exterior	1.868.116,69	0,00	0,00	1.951.588,23	83.471,54	4,47%		5,93%