

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)

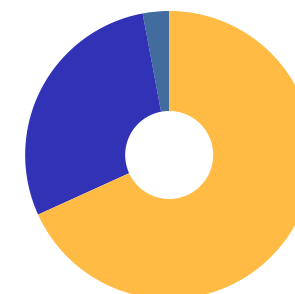
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			2.129.220,50	0,42%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	15.454.325,12	3,01%	588	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	89.311.184,24	17,41%	899	1,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	150.054,62	0,03%	1.361	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	16.704.866,76	3,26%	322	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	82.633.413,60	16,11%	976	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	33.628.167,87	6,56%	1.005	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.699.381,58	2,48%	922	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	14.189.309,80	2,77%	685	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	43.362.301,18	8,45%	885	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	138,64	0,00%	641	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.527.490,53	3,81%	110	3,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	14.167.705,73	2,76%	117	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	747.807,26	0,15%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.017.487,91	0,20%	431	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	792.326,64	0,15%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	0,01	0,00%	13	100,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.351.777,31	0,65%	33	2,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	24.262.667,96	4,73%	1.656	1,95%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	22.080.420,28	4,30%	42.737	0,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	14.270.708,05	2,78%	138	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	17.542.226,95	3,42%	4.938	5,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	15.180.347,69	2,96%	12.157	1,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	13.720.838,71	2,67%	3.143	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	21.355.519,89	4,16%	55	1,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	10.125.456,28	1,97%	18.848	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	770.362,76	0,15%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.646.501,97	0,91%	28	3,46%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se ...	Não se aplica	765.525,67	0,15%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.373.223,74	0,46%		1,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	6.277.397,45	1,22%	7.150	0,59%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	5.262.273,49	1,03%	14.090	0,41%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	3.591.810,40	0,70%	191	0,18%	Artigo 9º - A, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	860.373,70	0,17%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			512.952.614,29				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	2.129.220,50	0,42%	0,00%	0,50%	50,00%	254.347.086,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	308.133.004,77	60,07%	15,00%	50,50%	90,00%	153.524.348,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.647.630,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	50,00%	35.460.630,07	6,91%	2,00%	8,00%	40,00%	169.720.415,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	10,00%	4.144.103,96	0,81%	0,00%	2,00%	5,00%	21.503.526,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.647.630,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.647.630,71
Total Renda Fixa	100,00%	349.866.959,30	68,21%	17,00%	61,00%	200,00%	



RENTA FIXA 349.866.959,30

RENTA VARIÁVEL 147.954.173,65

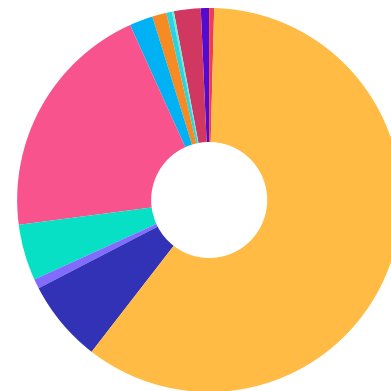
EXTERIOR 15.131.481,34

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!

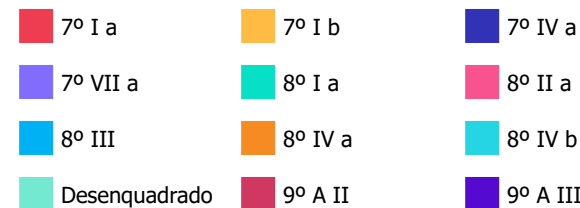


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	40,00%	24.262.667,96	4,73%	0,00%	5,00%	10,00%	27.032.593,47
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.647.630,71
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	104.150.061,57	20,30%	7,00%	21,00%	30,00%	49.735.722,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	51.295.261,43
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.125.456,28	1,97%	0,00%	3,00%	10,00%	41.169.805,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.182.390,40	1,21%	0,00%	2,00%	5,00%	19.465.240,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	2.373.223,74	0,46%	0,00%	1,00%	5,00%	23.274.406,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	25.647.630,71
Desenquadrado - RV	0,00%	860.373,70	0,17%	0,00%	0,00%	0,00%	-860.373,70
Total Renda Variável	40,00%	147.954.173,65	28,84%	7,00%	32,00%	80,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	11.539.670,94	2,25%	0,00%	5,00%	10,00%	39.755.590,49
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	3.591.810,40	0,70%	0,00%	2,00%	5,00%	22.055.820,31
Total Exterior	10,00%	15.131.481,34	2,95%	0,00%	7,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	279.507.393,59	54,49	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	67.623.172,37	13,18	0,00
ITAÚ UNIBANCO	55.878.618,86	10,89	0,00
ITAÚ DTVM	21.355.519,89	4,16	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	17.542.226,95	3,42	0,95
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	15.180.347,69	2,96	0,05
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.167.705,73	2,76	0,00
NAVI CAPITAL	13.720.838,71	2,67	0,84
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	6.277.397,45	1,22	0,00
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	5.262.273,49	1,03	0,00
A5 CAPITAL PARTNERS	4.646.501,97	0,91	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.913.357,64	0,76	1,87
AURORA CAPITAL	3.351.777,31	0,65	2,02
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	2.129.220,50	0,42	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.535.888,43	0,30	0,35
CADENCE GESTORA	860.373,70	0,17	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	0,01	0,00	0,00

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 '	2.129.220,50	0,42	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	308.133.004,77	60,07	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	35.460.630,07	6,91	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.144.103,96	0,81	0,00	5,00
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 '	24.262.667,96	4,73	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	104.150.061,57	20,30	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	10.125.456,28	1,97	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.182.390,40	1,21	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.373.223,74	0,46	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	11.539.670,94	2,25	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	3.591.810,40	0,70	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,95%	11,80%	4,89%	8,07%	11,80%	24,81%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,48%	-4,72%	1,08%	-1,81%	-4,72%	-3,95%	0,02%	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,08%	-23,11%	0,08%	-8,89%	-23,11%	-30,71%	-	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,51%	5,50%	10,53%	11,36%	5,50%	37,54%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,56%	5,23%	10,56%	11,28%	5,23%	36,52%	0,03%	0,17%
120% do CDI (Benchmark)	0,20%	3,32%	0,57%	1,18%	3,32%	10,75%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
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%

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-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%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,94%	6,30%	7,16%	8,14%	6,30%	30,60%	0,02%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,84%	6,06%	7,13%	8,09%	6,06%	30,02%	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%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1,04%	-2,23%	1,35%	0,96%	-2,23%	9,38%	0,00%	0,06%

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%

IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,01%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	-	3,66%	3,62%	-	-	0,01%	-

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,24%	15,45%	5,74%	9,85%	15,45%	33,11%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	0,02%	-	-0,33%	-0,91%	-	-	-	0,00%

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	2,12%	13,88%	5,38%	9,09%	13,88%	29,52%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-0,14%	-	-0,39%	-0,81%	-	-	0,00%	0,00%

IGC (Benchmark)	8,34%	5,19%	23,19%	24,14%	5,19%	45,71%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8,75%	2,28%	24,40%	23,92%	2,28%	36,95%	0,07%	0,43%

Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,37%	2,14%	21,63%	22,49%	2,14%	37,94%	0,06%	0,43%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7,70%	-12,57%	17,26%	17,08%	-12,57%	29,24%	0,07%	0,50%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	7,12%	-7,00%	20,98%	15,84%	-7,00%	25,62%	0,06%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7,97%	-21,23%	17,87%	10,19%	-21,23%	10,15%	0,07%	0,53%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11,36%	3,38%	22,46%	20,17%	3,38%	46,10%	0,07%	0,41%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6,30%	-4,87%	19,94%	22,34%	-4,87%	38,19%	0,06%	0,42%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,70%	3,52%	4,23%	4,60%	3,52%	22,23%	0,01%	0,08%

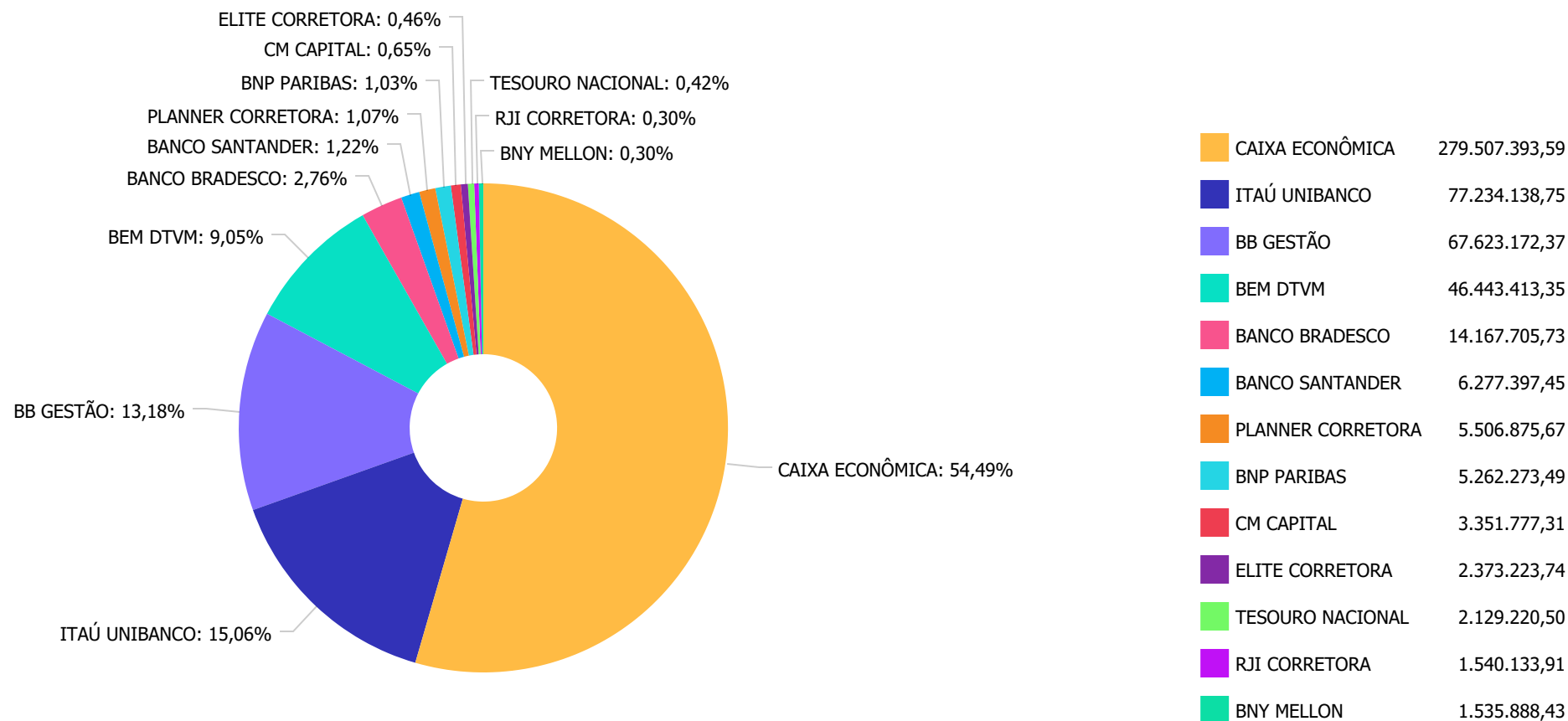
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,28%	-1,18%	0,00%	-0,37%	-1,18%	-	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	0,27%	-55,28%	0,00%	-0,42%	-55,28%	198.707.271,31%	-	-
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,17%	-	-0,47%	-1,02%	-	-	-	0,00%

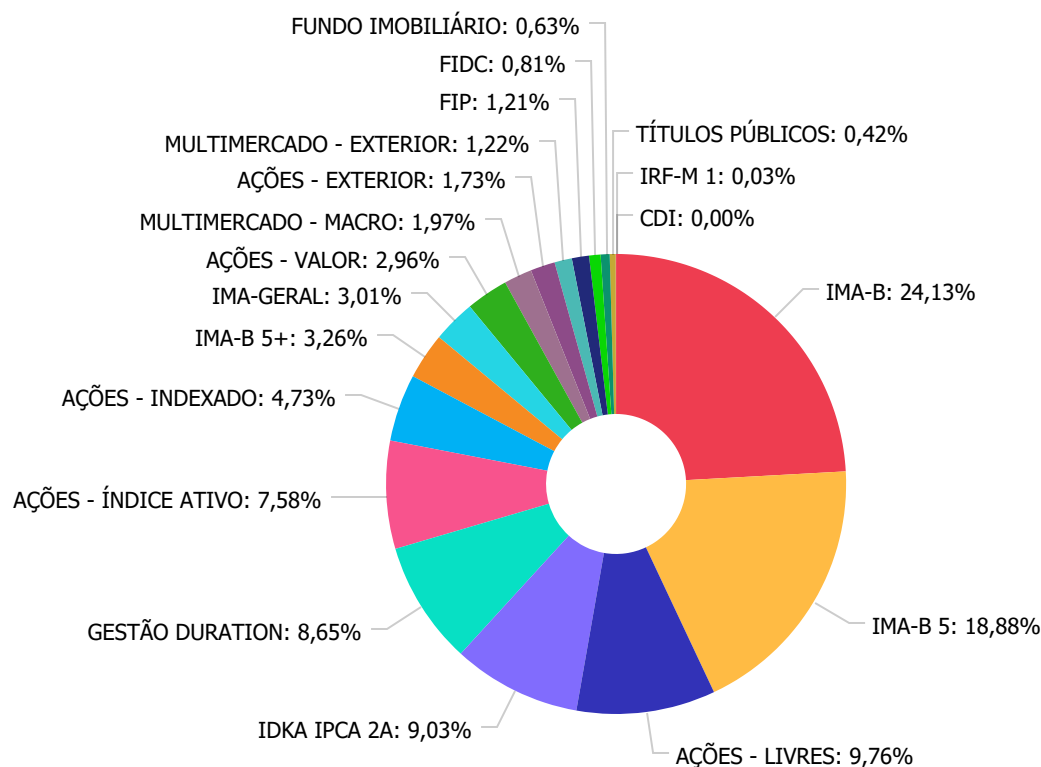
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	0,18%	91,31%	2,71%	25,96%	91,31%	-	0,09%	0,21%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,48%	61,34%	4,21%	19,17%	61,34%	103,17%	0,09%	0,20%

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



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



IMA-B	123.754.187,76
IMA-B 5	96.822.723,40
AÇÕES - LIVRES	50.071.967,04
IDKA IPCA 2A	46.327.549,45
GESTÃO DURATION	44.379.789,09
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	38.897.746,84
AÇÕES - INDEXADO	24.262.667,96
IMA-B 5+	16.704.866,76
IMA-GERAL	15.454.325,12
AÇÕES - VALOR	15.180.347,69
MULTIMERCADO - MACRO	10.125.456,28
AÇÕES - EXTERIOR	8.854.083,89
MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.277.397,45
FIP	6.182.390,40
FIDC	4.144.103,96
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.233.597,44
TÍTULOS PÚBLICOS	2.129.220,50
IRF-M 1	150.054,62
CDI	138,64

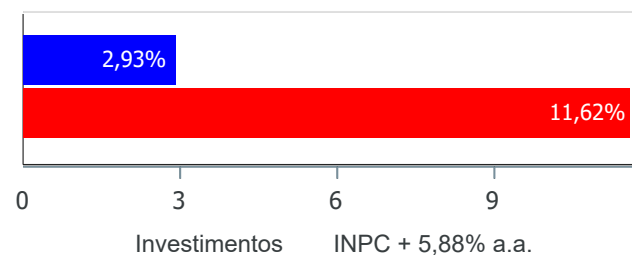
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512202	5.054,059900	1.997.348,05	2.092.380,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.262,817008	34.966,87	36.839,72	Curva

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

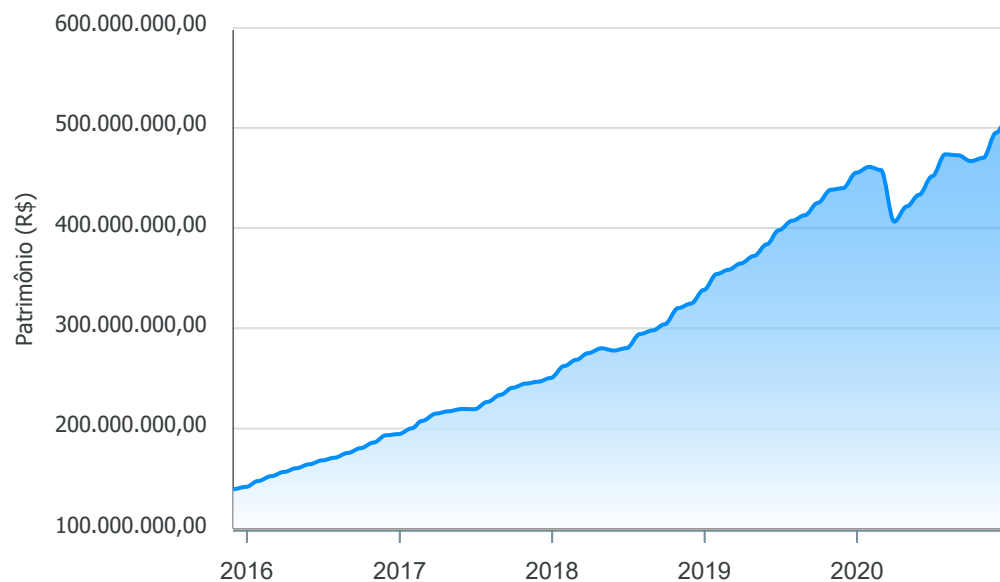
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	454.864.737,50	21.816.085,69	16.528.778,45	461.323.639,85	1.171.595,11	1.171.595,11	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	36,85%	3,25%
Fevereiro	461.323.639,85	10.707.825,40	6.130.332,45	457.995.410,88	-7.905.721,92	-6.734.126,81	-1,70%	-1,45%	0,58%	1,27%	-113,49%	4,88%
Março	457.995.410,88	28.820.410,36	32.625.991,25	406.736.215,22	-47.453.614,77	-54.187.741,58	-10,36%	-11,66%	0,68%	1,96%	-593,49%	19,18%
Abril	406.736.215,22	11.794.948,55	7.062.000,00	421.782.320,35	10.313.156,58	-43.874.585,00	2,51%	-9,44%	0,22%	2,19%	-430,80%	9,16%
Mai	421.782.320,35	645.611,92	226.784,81	433.326.657,26	11.125.509,80	-32.749.075,20	2,64%	-7,06%	0,20%	2,40%	-294,06%	4,98%
Junho	433.326.657,26	28.272.120,91	21.004.703,97	451.963.776,96	11.369.702,76	-21.379.372,44	2,58%	-4,66%	0,78%	3,20%	-145,71%	4,45%
Julho	451.963.776,96	8.017.610,89	2.808.912,54	473.812.023,06	16.639.547,75	-4.739.824,69	3,64%	-1,19%	0,97%	4,19%	-28,35%	3,64%
Agosto	473.812.023,06	6.081.362,53	1.504.502,69	472.906.882,54	-5.482.000,36	-10.221.825,05	-1,15%	-2,32%	0,84%	5,07%	-45,80%	3,53%
Setembro	472.906.882,54	6.975.863,10	1.000.000,00	467.031.632,12	-11.851.113,52	-22.072.938,57	-2,47%	-4,74%	1,35%	6,49%	-73,04%	4,56%
Outubro	467.031.632,12	4.761.985,03	125.134,25	470.287.069,81	-1.381.413,09	-23.454.351,66	-0,29%	-5,02%	1,37%	7,95%	-63,13%	3,89%
Novembro	470.287.069,81	11.537.036,27	10.760.213,15	490.352.314,10	19.288.421,17	-4.165.930,49	4,09%	-1,13%	1,41%	9,47%	-11,92%	3,61%
Dezembro	490.352.314,10	15.388.835,96	13.013.318,46	512.952.614,29	20.224.782,69	16.058.852,20	4,10%	2,93%	1,97%	11,62%	25,21%	2,85%

Investimentos x Meta Atuarial



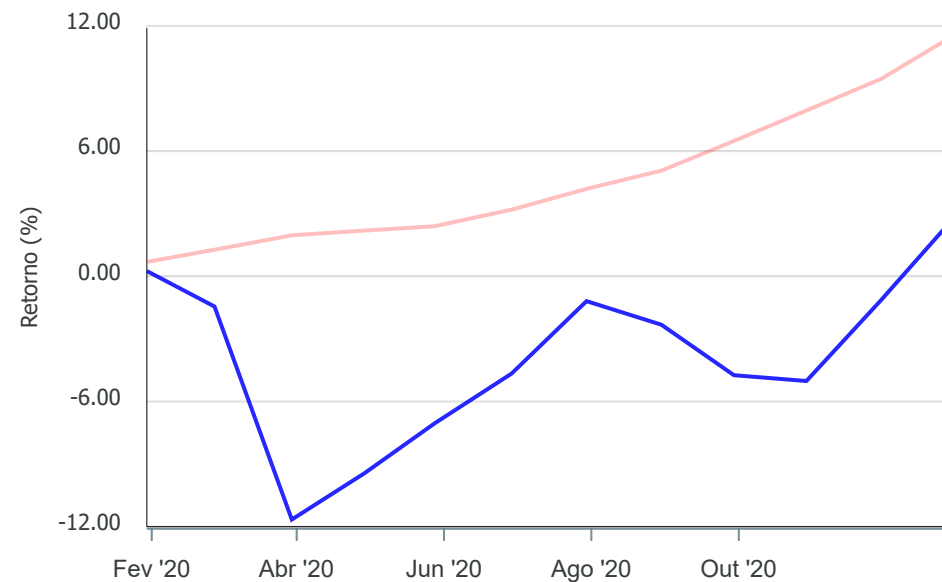
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.530.312,39	0,00	0,00	16.704.866,76	1.174.554,37	7,56%	7,56%	3,42%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.500.282,47	0,00	0,00	14.167.705,73	667.423,26	4,94%	4,94%	2,09%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.608.545,91	0,00	0,00	19.527.490,53	918.944,62	4,94%	4,94%	2,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	85.187.715,79	0,00	0,00	89.311.184,24	4.123.468,45	4,84%	4,84%	2,04%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.229.483,87	0,00	0,00	3.351.777,31	122.293,44	3,79%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	990.771,76	0,00	0,00	1.017.487,91	26.716,15	2,70%	2,70%	1,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.095.205,54	0,00	0,00	15.454.325,12	359.119,58	2,38%	2,38%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	81.156.530,86	0,00	0,00	82.633.413,60	1.476.882,74	1,82%	1,82%	0,74%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.937.475,14	0,00	0,00	14.189.309,80	251.834,66	1,81%	1,81%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	32.973.395,83	108.905,42	0,00	33.628.167,87	545.866,62	1,65%	1,65%	0,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.508.547,69	0,00	0,00	12.699.381,58	190.833,89	1,53%	1,53%	0,66%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.098.410,44	0,00	0,00	2.129.220,50	30.810,06	1,47%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	42.797.095,73	0,00	0,00	43.362.301,18	565.205,45	1,32%	1,32%	0,55%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	740.124,06	0,00	0,00	747.807,26	7.683,20	1,04%	1,04%	0,45%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	788.532,70	0,00	0,00	792.326,64	3.793,94	0,48%	0,48%	1,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	138,14	0,00	0,00	138,64	0,50	0,36%	0,36%	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.402.427,10	1.740.706,58	13.013.318,46	150.054,62	20.239,40	0,15%	0,28%	0,10%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	350.544.995,43	1.849.612,00	13.013.318,46	349.866.959,30	10.485.670,33	2,98%		1,32%

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
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.321.735,55	0,00	0,00	13.720.838,71	1.399.103,16	11,35%	11,35%	7,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	13.217.368,55	0,00	0,00	14.270.708,05	1.053.339,50	7,97%	7,97%	6,55%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	20.332.356,61	2.156.000,00	0,00	24.262.667,96	1.774.311,35	7,89%	8,75%	6,71%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	14.095.522,31	0,00	0,00	15.180.347,69	1.084.825,38	7,70%	7,70%	6,62%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	17.717.361,70	2.157.465,24	0,00	21.355.519,89	1.480.692,95	7,45%	8,37%	6,16%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	16.376.096,46	0,00	0,00	17.542.226,95	1.166.130,49	7,12%	7,12%	6,35%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.772.707,80	0,00	0,00	22.080.420,28	1.307.712,48	6,30%	6,30%	6,12%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.956.143,27	0,00	0,00	10.125.456,28	169.313,01	1,70%	1,70%	0,93%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	771.430,49	0,00	0,00	770.362,76	-1.067,73	-0,14%	-0,14%	0,01%
OSASCO PROPERTIES FII	861.603,03	0,00	0,00	860.373,70	-1.229,33	-0,14%	0,27%	-
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	766.807,88	0,00	0,00	765.525,67	-1.282,21	-0,17%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.655.368,70	0,00	0,00	4.646.501,97	-8.866,73	-0,19%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.423.024,15	0,00	0,00	2.373.223,74	-49.800,41	-2,06%	0,28%	0,00%
Total Renda Variável	134.267.526,50	4.313.465,24	0,00	147.954.173,65	9.373.181,91	6,76%		5,96%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

MARINGÁ PREVIDÊNCIA - PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MARINGÁ
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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	1.045.245,79	4.073.406,46	0,00	5.262.273,49	143.621,24	2,81%	0,18%	9,18%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2.240.480,00	1.262.352,26	0,00	3.591.810,40	88.978,14	2,54%	0,69%	7,07%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.254.066,38	3.890.000,00	0,00	6.277.397,45	133.331,07	2,17%	0,48%	8,64%
Total Renda Variável	5.539.792,17	9.225.758,72	0,00	15.131.481,34	365.930,45	2,48%		8,46%

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	83.360.333,83	5.183,98	0,00	89.311.184,24	5.945.666,43	7,13%	7,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	75.732.232,13	4.261.427,94	0,00	82.633.413,60	2.639.753,53	3,30%	3,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.108.954,76	0,00	0,00	16.704.866,76	1.595.912,00	10,56%	10,56%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.229.837,08	0,00	0,00	19.527.490,53	1.297.653,45	7,12%	7,12%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	32.379.407,96	256.936,07	200,69	33.628.167,87	992.024,53	3,04%	3,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.221.415,42	0,00	0,00	14.167.705,73	946.290,31	7,16%	7,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	52.804.975,54	497.540,51	10.843.227,88	43.362.301,18	903.013,01	1,69%	2,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.978.802,59	0,00	0,00	15.454.325,12	475.522,53	3,17%	3,17%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.731.279,34	0,00	0,00	14.189.309,80	458.030,46	3,34%	3,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.302.718,72	0,00	0,00	12.699.381,58	396.662,86	3,22%	3,22%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.224.207,50	0,00	0,00	3.351.777,31	127.569,81	3,96%	0,08%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.094.482,62	0,00	41.918,83	2.129.220,50	76.656,71	3,66%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	981.594,24	0,00	0,00	1.017.487,91	35.893,67	3,66%	3,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	229,43	13.127.544,80	13.013.318,46	150.054,62	35.598,85	0,27%	0,64%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	776.126,60	0,00	0,00	792.326,64	16.200,04	2,09%	1,08%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	737.877,29	0,00	0,00	747.807,26	9.929,97	1,35%	1,35%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	137,76	0,00	0,00	138,64	0,88	0,64%	0,64%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa				15.952.379,04	4,46%		

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 GOVERNANÇA FI AÇÕES	17.774.196,19	2.156.000,00	0,00	24.262.667,96	4.332.471,77	21,74%	24,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	18.409.487,21	0,00	0,00	22.080.420,28	3.670.933,07	19,94%	19,94%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	15.785.216,41	2.157.465,24	0,00	21.355.519,89	3.412.838,24	19,02%	21,63%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	14.499.701,71	0,00	0,00	17.542.226,95	3.042.525,24	20,98%	20,98%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.203.990,04	0,00	0,00	13.720.838,71	2.516.848,67	22,46%	22,46%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	12.946.090,03	0,00	0,00	15.180.347,69	2.234.257,66	17,26%	17,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12.107.088,92	0,00	0,00	14.270.708,05	2.163.619,13	17,87%	17,87%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.714.174,51	0,00	0,00	10.125.456,28	411.281,77	4,23%	4,23%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	773.399,38	0,00	0,00	770.362,76	-3.036,62	-0,39%	-0,39%
OSASCO PROPERTIES FII	863.900,35	0,00	0,00	860.373,70	-3.526,65	-0,41%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	769.115,23	0,00	0,00	765.525,67	-3.589,56	-0,47%	-0,47%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.671.459,71	0,00	0,00	4.646.501,97	-24.957,74	-0,53%	-0,33%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.429.688,80	0,00	0,00	2.373.223,74	-56.465,06	-2,32%	0,00%
				Total Renda Variável	21.693.199,92	17,18%	

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	2.173.221,12	3.890.000,00	0,00	6.277.397,45	214.176,33	3,53%	4,21%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	1.019.509,67	4.073.406,46	0,00	5.262.273,49	169.357,36	3,33%	2,70%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2.226.780,02	1.262.352,26	0,00	3.591.810,40	102.678,12	2,94%	1,31%
			Total Exterior		486.211,81	3,32%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	82.694.806,47	9.233.960,73	14.761.347,61	82.633.413,60	5.465.994,01	5,95%	7,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	85.116.569,19	986.891,58	1.925.643,44	89.311.184,24	5.133.366,91	5,96%	6,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	20.252.205,04	32.607.664,51	11.815.701,65	43.362.301,18	2.318.133,28	4,39%	6,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.617.993,32	8.843.160,85	2.000.200,69	33.628.167,87	2.167.214,39	6,48%	8,03%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.752.844,39	2.503.834,07	0,00	19.527.490,53	1.270.812,07	6,96%	7,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.739.361,57	7.435.446,33	0,00	14.189.309,80	1.014.501,90	7,70%	7,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.767.860,14	0,00	0,00	12.699.381,58	931.521,44	7,92%	7,92%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.327.880,20	0,00	0,00	14.167.705,73	839.825,53	6,30%	6,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.874.134,39	0,00	0,00	16.704.866,76	830.732,37	5,23%	5,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.679.355,50	0,00	1.000.000,00	15.454.325,12	774.969,62	4,94%	5,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	39.384,23	28.926.916,78	28.991.419,03	150.054,62	175.172,64	0,60%	3,63%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.113.655,00	0,00	83.018,96	2.129.220,50	98.584,46	4,66%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.196.748,74	0,00	890.465,17	3.351.777,31	45.493,74	1,08%	-23,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.698.396,84	0,00	5.719.855,39	0,00	21.458,55	0,38%	2,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	40.343,34	30.913.667,78	30.972.068,42	138,64	18.195,94	0,06%	2,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.290,99	0,00	1.017.487,91	17.196,92	1,72%	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.181.304,77	0,00	7.195.505,33	0,00	14.200,56	0,20%	4,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	54.364,14	0,00	55.741,69	0,00	1.377,55	2,53%	3,47%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	764.854,78	0,00	0,00	747.807,26	-17.047,52	-2,23%	-2,23%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	831.536,57	0,00	0,00	792.326,64	-39.209,93	-4,72%	-4,72%

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
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.393.920,60	0,00	0,00	0,01	-2.393.920,59	-100,00%	-100,00%
			Total Renda Fixa		18.688.573,84	5,64%	

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 FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	13.580.620,87	6.305.354,99	0,00	21.355.519,89	1.469.544,03	7,39%	2,14%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	4.546.397,84	9.679.291,26	0,00	15.180.347,69	954.658,59	6,71%	-12,57%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	21.618.850,00	2.156.000,00	0,00	24.262.667,96	487.817,96	2,05%	2,28%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.272.043,55	0,00	0,00	13.720.838,71	448.795,16	3,38%	3,38%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.781.546,90	0,00	0,00	10.125.456,28	343.909,38	3,52%	3,52%
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	647.791,40	0,00	0,00	770.362,76	122.571,36	18,92%	-
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	644.860,44	0,00	0,00	765.525,67	120.665,23	18,71%	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	7.315.765,53	0,00	7.379.704,64	0,00	63.939,11	0,87%	-7,93%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.453.590,16	0,00	0,00	2.373.223,74	-80.366,42	-3,28%	-1,18%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	4.744.714,82	0,00	0,00	4.646.501,97	-98.212,85	-2,07%	-
OSASCO PROPERTIES FII	1.928.918,98	0,00	0,00	860.373,70	-1.068.545,28	-55,40%	-55,28%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	23.211.674,06	0,00	0,00	22.080.420,28	-1.131.253,78	-4,87%	-4,87%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	18.863.505,21	0,00	0,00	17.542.226,95	-1.321.278,26	-7,00%	-7,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	18.116.938,52	0,00	0,00	14.270.708,05	-3.846.230,47	-21,23%	-21,23%
Total Renda Variável					-3.533.986,24	-2,33%	

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	0,00	5.891.458,02	0,00	6.277.397,45	385.939,43	6,55%	61,34%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	3.262.352,26	0,00	3.591.810,40	329.458,14	10,10%	54,76%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	0,00	5.073.406,46	0,00	5.262.273,49	188.867,03	3,72%	91,31%
			Total Exterior		904.264,60	6,36%	