

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

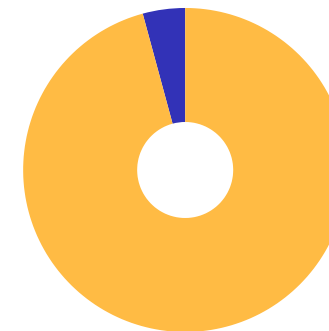
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	34.678.862,08	17,64%	296	2,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.502.631,16	1,27%	679	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	29.411,54	0,01%	1.225	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	886.385,74	0,45%	701	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	36.457.981,29	18,54%	885	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	32.291.682,35	16,42%	1.005	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	18.117.391,57	9,21%	976	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.794.858,64	8,03%	322	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.004.967,16	2,04%	1.361	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	10.114.600,06	5,14%	375	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.401.752,97	1,22%	112	0,77%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.295.450,48	2,69%	641	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	46,22	0,00%	106.753	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	53.783,84	0,03%	15.442	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	25.689.415,87	13,07%	18	15,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	4.260.974,54	2,17%	38	2,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	Não se ...	Não se aplica	4.040.864,03	2,06%		3,19%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		2,43	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			196.621.059,54				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2,43				Artigo 6º
PL Total			196.621.061,97				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	154.878.771,59	78,77%	15,00%	30,00%	90,00%	22.080.182,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	117.972.635,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	33.440.449,38	17,01%	10,00%	30,00%	40,00%	45.207.974,44
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	29.493.158,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.831.052,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.831.052,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.831.052,98
Total Renda Fixa	100,00%	188.319.220,97	95,78%	25,00%	70,00%	220,00%	



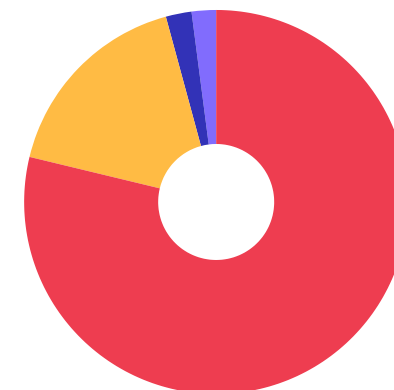
RENDA FIXA 188.319.220,97

RENDA VARIÁVEL 8.301.838,57

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	39.324.211,91
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,00%	10,00%	10,00%	19.662.105,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	4.260.974,54	2,17%	0,00%	5,00%	5,00%	5.570.078,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	4.040.864,03	2,06%	0,00%	5,00%	5,00%	5.790.188,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	9.831.052,98
Total Renda Variável	30,00%	8.301.838,57	4,22%	3,00%	30,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	19.662.105,95
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



7º I b 7º IV a 8º IV a 8º IV b

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	124.532.514,58	63,34	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.097.290,52	19,38	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	25.689.415,87	13,07	1,12
ÍNDIGO DTVM	4.260.974,54	2,17	-
REDITUS INVESTIMENTOS	4.040.864,03	2,06	-

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 ' b '	154.878.771,59	78,77	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	33.440.449,38	17,01	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	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 II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	4.260.974,54	2,17	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	4.040.864,03	2,06	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,71%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	3,05%	8,45%	2,90%	2,29%	8,45%	23,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,04%	8,22%	2,90%	2,21%	8,22%	23,25%	1,69%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,51%	5,50%	10,53%	11,36%	5,50%	37,54%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,48%	5,06%	10,38%	11,03%	5,06%	36,63%	3,37%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,56%	5,23%	10,56%	11,28%	5,23%	36,52%	3,42%	0,17%
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%	0,10%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,10%	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%	0,74%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,84%	6,14%	7,14%	8,03%	6,14%	30,17%	2,03%	0,11%

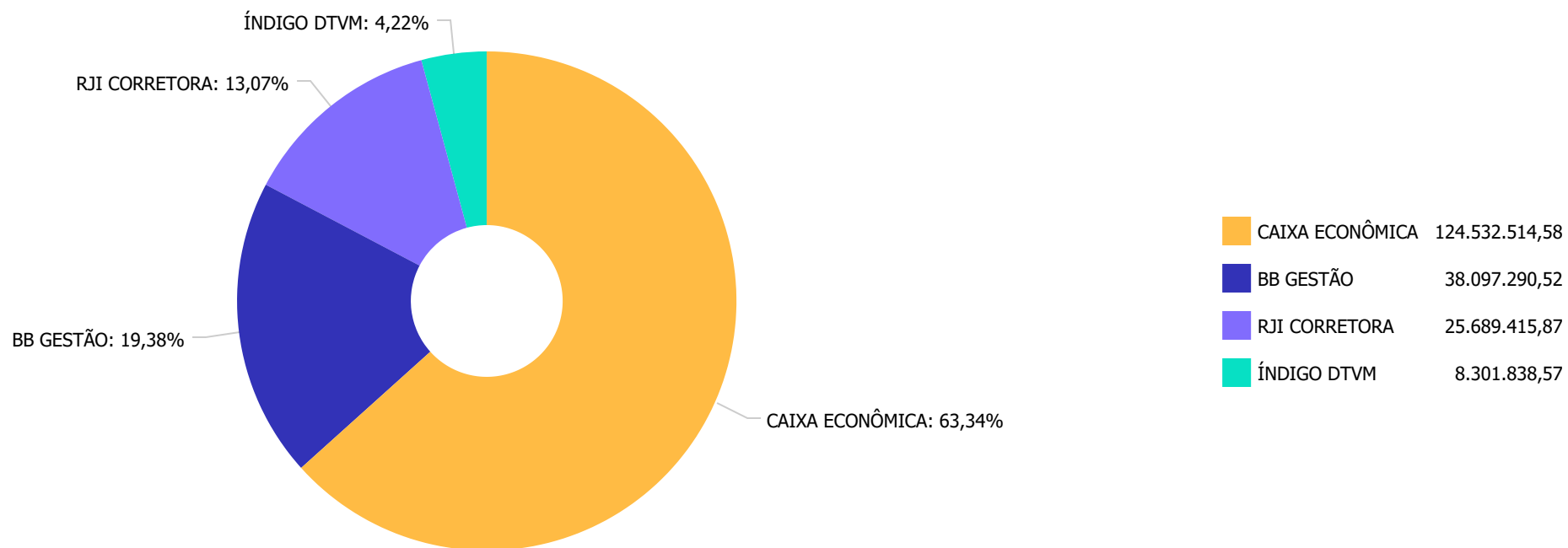
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	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%	1,04%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,27%	2,73%	0,58%	0,85%	2,73%	8,81%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36%	2,42%	0,64%	1,03%	2,42%	8,27%	0,15%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,15%	0,04%	0,06%	0,15%	1,13%	0,00%	0,00%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	0,86%	0,04%	0,10%	0,86%	4,73%	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%	0,55%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,94%	-11,41%	-5,14%	-12,89%	-11,41%	-32,98%	6,03%	0,07%

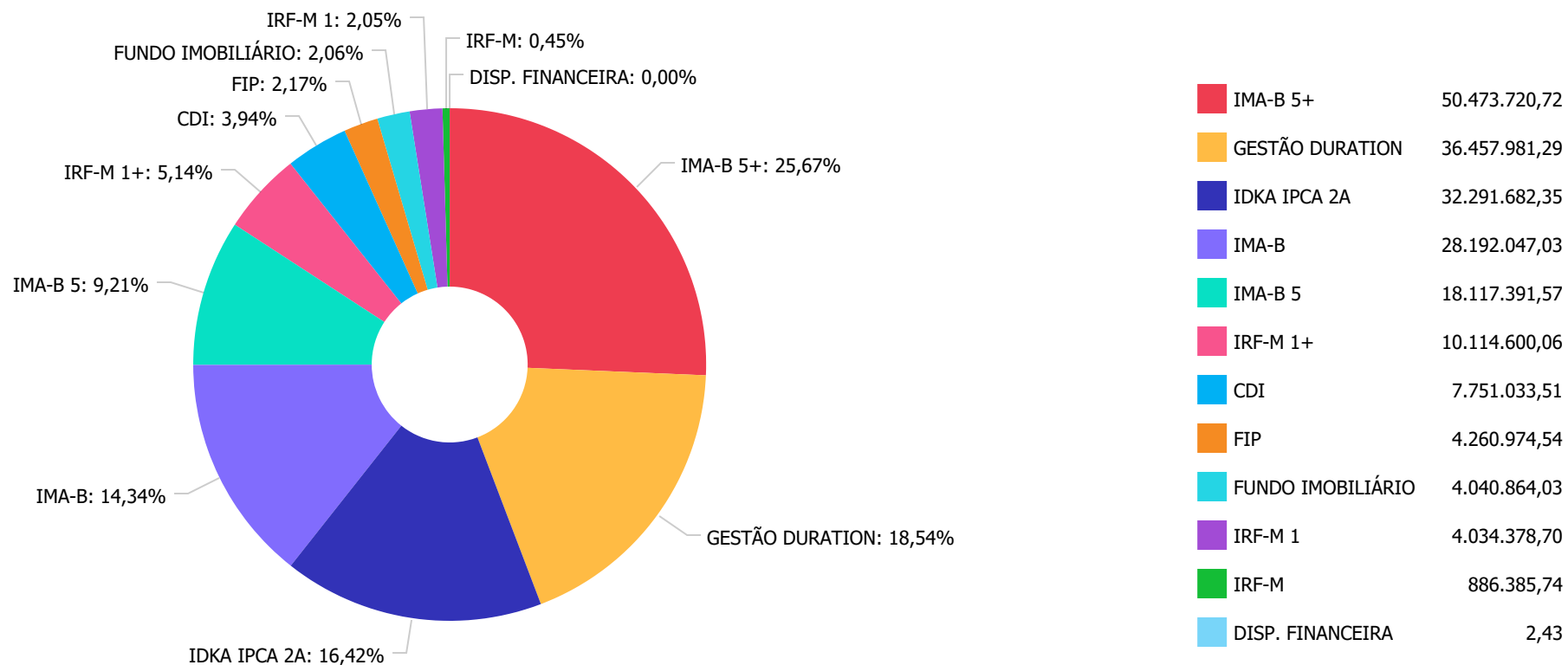
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	2,07%	13,36%	5,26%	8,83%	13,36%	28,34%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-0,03%	-	-0,49%	-0,59%	-	-	-	0,01%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

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



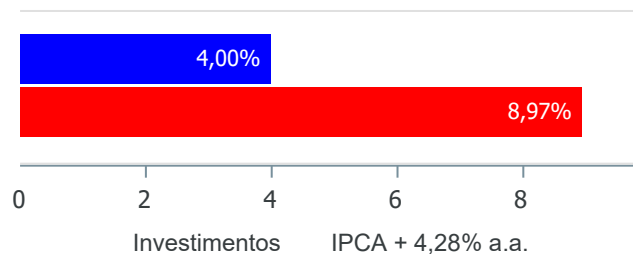
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

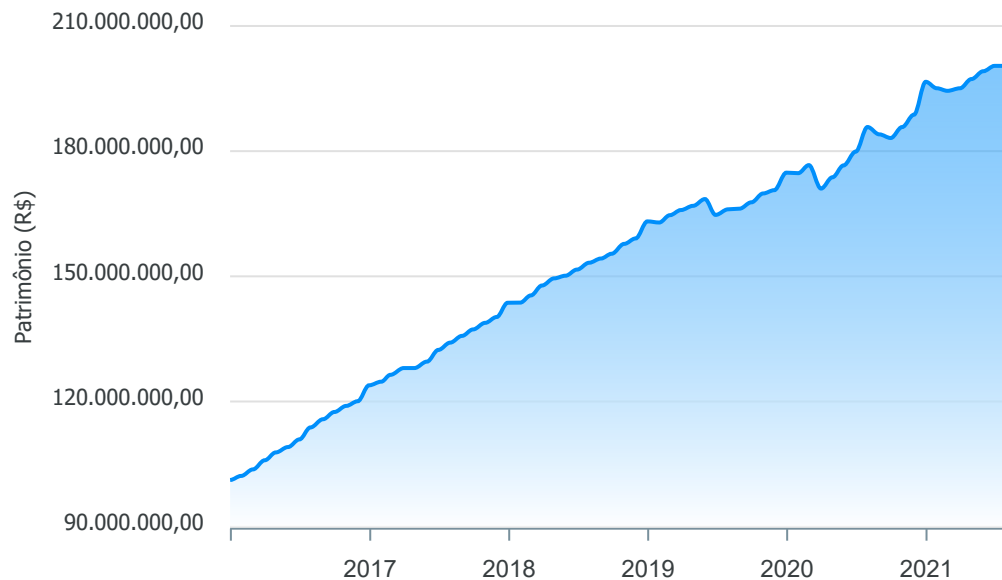
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	173.852.474,32	965.270,75	565.000,00	174.708.333,19	455.588,12	455.588,12	0,26%	0,26%	0,58%	0,58%	45,29%	2,46%
Fevereiro	174.708.333,19	1.804.795,36	601.000,00	176.624.335,45	712.206,90	1.167.795,02	0,40%	0,67%	0,55%	1,13%	59,01%	1,86%
Março	176.624.335,45	1.402.000,00	570.000,00	171.002.885,86	-6.453.449,59	-5.285.654,57	-3,64%	-2,99%	0,44%	1,57%	-190,33%	13,06%
Abril	171.002.885,86	2.176.000,00	1.155.002,72	173.694.285,96	1.670.402,82	-3.615.251,75	0,97%	-2,05%	0,02%	1,60%	-128,60%	7,74%
Mai	173.694.285,96	1.639.897,68	516.016,47	176.558.944,29	1.740.777,12	-1.874.474,63	1,00%	-1,08%	-0,05%	1,55%	-69,60%	3,49%
Junho	176.558.944,29	1.904.947,58	766.677,80	179.890.888,16	2.193.674,09	319.199,46	1,23%	0,14%	0,61%	2,17%	6,69%	3,95%
Julho	179.890.888,16	8.904.165,42	7.818.931,15	185.785.480,56	4.809.358,13	5.128.557,59	2,66%	2,81%	0,74%	2,93%	95,86%	9,19%
Agosto	185.785.480,56	2.747.724,69	1.701.377,08	184.023.758,80	-2.808.069,37	2.320.488,22	-1,50%	1,26%	0,59%	3,54%	35,67%	2,43%
Setembro	184.023.758,80	4.486.146,10	3.174.223,16	183.155.374,97	-2.180.306,77	140.181,45	-1,18%	0,07%	0,99%	4,56%	1,53%	3,73%
Outubro	183.155.374,97	38.951.360,47	37.639.124,79	185.777.940,97	1.310.330,32	1.450.511,77	0,71%	0,78%	1,21%	5,83%	13,39%	2,70%
Novembro	185.777.940,97	10.743.952,65	9.667.985,39	188.739.782,44	1.885.874,21	3.336.385,98	1,01%	1,80%	1,23%	7,13%	25,22%	1,97%
Dezembro	188.739.782,44	9.285.743,20	5.566.710,14	196.621.059,54	4.162.244,04	7.498.630,02	2,16%	4,00%	1,72%	8,97%	44,57%	2,11%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



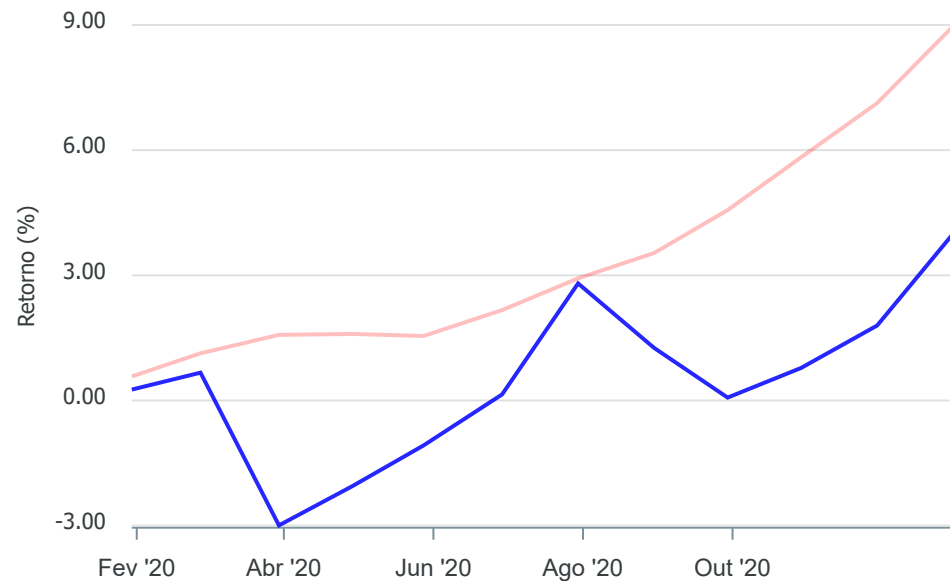
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta de Rentabilidade 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...	14.684.288,87	0,00	0,00	15.794.858,64	1.110.569,77	7,56%	7,56%	3,42%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	32.267.015,96	0,00	0,00	34.678.862,08	2.411.846,12	7,47%	7,47%	3,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.387.190,62	0,00	0,00	2.502.631,16	115.440,54	4,84%	4,84%	2,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	6.261.054,38	3.651.907,64	0,00	10.114.600,06	201.638,04	2,03%	3,04%	1,69%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	869.308,77	0,00	0,00	886.385,74	17.076,97	1,96%	1,96%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.793.584,75	0,00	0,00	18.117.391,57	323.806,82	1,82%	1,82%	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	31.766.686,08	0,00	0,00	32.291.682,35	524.996,27	1,65%	1,65%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	34.582.300,72	1.410.500,00	0,00	36.457.981,29	465.180,57	1,29%	1,32%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.276.313,08	0,00	0,00	5.295.450,48	19.137,40	0,36%	0,36%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	29.319,78	0,00	0,00	29.411,54	91,76	0,31%	0,31%	0,10%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	22.930,09	4.223.335,56	4.204.710,14	53.783,84	12.228,33	0,29%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.068.426,32	0,00	75.000,00	4.004.967,16	11.540,84	0,28%	0,28%	0,10%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.680.522,59	0,00	1.287.000,00	2.401.752,97	8.230,38	0,22%	0,27%	0,03%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	46,21	0,00	0,00	46,22	0,01	0,02%	0,01%	0,00%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	26.743.818,37	0,00	0,00	25.689.415,87	-1.054.402,50	-3,94%	-3,94%	6,03%
Total Renda Fixa	180.432.806,59	9.285.743,20	5.566.710,14	188.319.220,97	4.167.381,32	2,26%		2,16%

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
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.262.243,95	0,00	0,00	4.260.974,54	-1.269,41	-0,03%	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.044.731,90	0,00	0,00	4.040.864,03	-3.867,87	-0,10%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	8.306.975,85	0,00	0,00	8.301.838,57	-5.137,28	-0,06%		0,00%

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	31.417.472,87	0,00	0,00	34.678.862,08	3.261.389,21	10,38%	10,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	26.666.985,24	0,00	12.401.372,13	15.794.858,64	1.529.245,53	5,73%	10,56%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	31.336.577,91	0,00	0,00	32.291.682,35	955.104,44	3,05%	3,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.724.006,86	28.964.385,02	6.000.000,00	36.457.981,29	769.589,41	1,85%	2,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.452.368,52	14.200.432,28	0,00	18.117.391,57	464.590,77	2,63%	3,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	25.228.898,29	3.651.907,64	18.934.741,70	10.114.600,06	168.535,83	0,58%	2,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.335.966,33	0,00	0,00	2.502.631,16	166.664,83	7,13%	7,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.261.830,45	0,00	0,00	5.295.450,48	33.620,03	0,64%	0,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.104.718,44	0,00	126.000,00	4.004.967,16	26.248,72	0,64%	0,64%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.218.553,14	0,00	1.838.000,00	2.401.752,97	21.199,83	0,50%	0,58%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	869.072,38	0,00	0,00	886.385,74	17.313,36	1,99%	1,99%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	93.379,31	12.164.331,38	12.216.345,15	53.783,84	12.418,30	0,10%	0,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	29.228,85	0,00	0,00	29.411,54	182,69	0,63%	0,63%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	46,20	0,00	0,00	46,22	0,02	0,04%	0,04%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	27.081.190,25	0,00	1.357.361,34	25.689.415,87	-34.413,04	-0,13%	-5,14%
				Total Renda Fixa	7.391.689,93	4,09%	

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
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.052.977,84	0,00	0,00	4.040.864,03	-12.113,81	-0,30%	0,00%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.282.102,09	0,00	0,00	4.260.974,54	-21.127,55	-0,49%	-0,49%
				Total Renda Variável	-33.241,36	-0,40%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	30.388.033,34	0,00	509.513,16	32.291.682,35	2.413.162,17	7,94%	8,03%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	33.008.389,01	0,00	0,00	34.678.862,08	1.670.473,07	5,06%	5,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	18.961.446,52	8.756.133,05	18.934.741,70	10.114.600,06	1.331.762,19	4,80%	8,22%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.148.422,83	33.148.348,48	6.000.000,00	36.457.981,29	1.161.209,98	2,81%	6,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	17.622.483,73	0,00	18.117.391,57	494.907,84	2,81%	7,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	28.017.511,11	0,00	12.401.372,13	15.794.858,64	178.719,66	0,64%	5,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.357.850,55	0,00	0,00	2.502.631,16	144.780,61	6,14%	6,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.818.693,28	2.032.477,16	2.978.712,45	4.004.967,16	132.509,17	1,93%	3,63%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.103.102,13	0,00	2.829.748,72	2.401.752,97	128.399,56	2,52%	2,73%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.170.556,08	0,00	0,00	5.295.450,48	124.894,40	2,42%	2,42%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	644.413,71	188.840,70	0,00	886.385,74	53.131,33	6,38%	6,40%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	17.956.657,36	17.915.356,54	53.783,84	12.483,02	0,07%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	28.425,75	0,00	0,00	29.411,54	985,79	3,47%	3,47%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	45,82	0,00	0,00	46,22	0,40	0,87%	0,86%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	23.754.285,76	5.307.063,42	2.865.540,58	25.689.415,87	-506.392,73	-1,74%	-11,41%
				Total Renda Fixa	7.341.026,46	4,06%	

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
MONZA FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	5.076.158,31	0,00	5.307.063,42	0,00	230.905,11	4,55%	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	4.278.457,54	0,00	0,00	4.260.974,54	-17.483,00	-0,41%	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	4.096.682,58	0,00	0,00	4.040.864,03	-55.818,55	-1,36%	0,00%
				Total Renda Variável	157.603,56	1,17%	

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 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas 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 3.922 de 25 de novembro de 2010 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.