

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

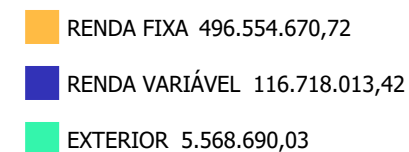
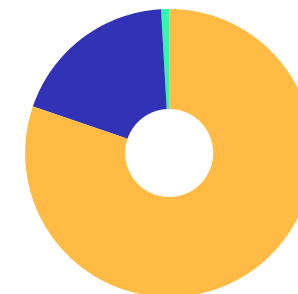
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			96.404.438,24	15,58%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	51.205.126,20	8,27%	892	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	48.207.732,21	7,79%	591	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	44.320.426,28	7,16%	443	1,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	71.790.702,04	11,60%	677	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	65.162.805,52	10,53%	1.004	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	63.201.372,95	10,21%	1.212	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	587.080,01	0,09%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.736.662,87	0,60%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.113.417,59	0,18%	18	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	47.221.203,80	7,63%	264	1,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	5	0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.767.271,06	0,29%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	11	0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	2	0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.836.431,92	0,30%	70	2,52%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	27.868.164,80	4,50%	41.775	0,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	27.995.160,05	4,52%	10.322	3,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	28.746.247,61	4,65%	1.385	9,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	22.944.886,67	3,71%	5.938	1,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	229.422,75	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	217.006,80	0,04%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	78,73	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.528.633,97	0,25%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	291.815,40	0,05%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se ...	Não se aplica	2.274.000,00	0,37%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.037.092,42	0,33%		5,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.585.504,22	0,42%		5,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	5.568.690,03	0,90%	22	6,76%	Artigo 9º - A, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			618.841.374,17				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			676.361,20				Artigo 6º
PL Total			619.517.735,37				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	96.404.438,24	15,58%	5,00%	10,00%	100,00%	522.436.935,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	343.888.165,20	55,57%	10,00%	52,50%	100,00%	274.953.208,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	52.658.364,27	8,51%	0,00%	10,00%	40,00%	194.878.185,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	3.603.703,01	0,58%	0,00%	0,50%	3,00%	14.961.538,22
Total Renda Fixa	100,00%	496.554.670,72	80,24%	15,00%	73,00%	243,00%	

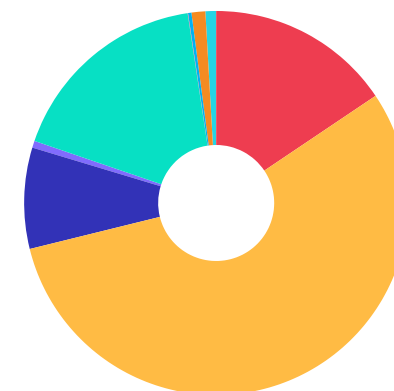


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

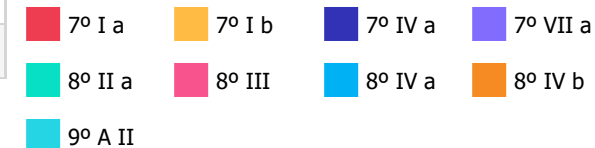


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	92.826.206,13
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	92.826.206,13
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	107.554.459,13	17,38%	5,00%	17,50%	20,00%	16.213.815,70
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.942.068,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	229.422,75	0,04%	0,00%	0,50%	5,00%	30.712.645,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	1.745.719,50	0,28%	0,00%	1,00%	5,00%	29.196.349,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	7.188.412,04	1,16%	0,00%	1,00%	5,00%	23.753.656,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.942.068,71
Total Renda Variável	35,00%	116.718.013,42	18,86%	5,00%	22,00%	75,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	30.942.068,71
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	5.568.690,03	0,90%	0,00%	5,00%	10,00%	56.315.447,39
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	30.942.068,71
Total Exterior	10,00%	5.568.690,03	0,90%	0,00%	5,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	183.199.807,20	29,60	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	160.688.358,00	25,97	0,03
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	96.404.438,24	15,58	-
ITAÚ UNIBANCO	75.089.368,60	12,13	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	50.940.046,72	8,23	0,18
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	28.746.247,61	4,65	0,05
GRAPHEN INVESTIMENTOS	5.573.094,79	0,90	2,67
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.568.690,03	0,90	0,12
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	4.114.138,19	0,66	0,93
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.274.000,00	0,37	0,69
REDITUS INVESTIMENTOS	2.037.092,42	0,33	-
PETRA CAPITAL	1.767.271,06	0,29	0,03
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.113.417,59	0,18	0,04
INTERATIVA INVESTIMENTOS	587.080,01	0,09	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	291.815,40	0,05	0,00
ÚNICA ADMINISTRADORA	229.422,75	0,04	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	217.006,83	0,04	-
VALORA INVESTIMENTOS	78,73	0,00	0,00

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 '	96.404.438,24	15,58	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	343.888.165,20	55,57	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	52.658.364,27	8,51	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	107.554.459,13	17,38	10,00	20,00
Artigo 9º - A, Inciso II	5.568.690,03	0,90	0,00	10,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,44%	-0,44%	2,38%	0,96%	3,87%	15,36%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,55%	2,68%	0,93%	4,00%	15,84%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,13%	3,03%	4,04%	7,68%	18,78%	0,01%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,79%	0,79%	4,23%	7,86%	11,79%	24,66%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	0,03%	0,11%	-1,37%	-4,58%	-4,73%	0,00%	0,03%
120% do CDI (Benchmark)	0,18%	0,18%	0,56%	1,13%	3,04%	10,23%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,00%	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	0,00%	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	0,00%	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	0,54%	0,79%	3,07%	9,59%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,34%	-0,34%	-6,49%	-10,55%	-11,75%	-32,70%	0,01%	0,07%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,86%	-0,86%	6,00%	2,62%	4,95%	23,66%	0,03%	0,11%
BRA1 FI RENDA FIXA	-0,30%	-0,30%	-6,66%	-14,37%	-39,31%	-76,96%	0,01%	0,21%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,28%	-0,28%	1,25%	-0,70%	-2,74%	5,69%	0,00%	0,06%

IRF-M (Benchmark)	-0,80%	-0,80%	1,50%	-0,15%	4,92%	16,95%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,77%	-0,77%	1,51%	-0,25%	4,73%	16,38%	0,02%	0,03%

IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,20%	-0,20%	-0,51%	5,71%	-4,51%	-13,57%	0,00%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,13%	0,13%	0,44%	0,16%	2,65%	12,60%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,01%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,05%	1,05%	5,06%	9,60%	15,40%	32,92%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,46%	-0,46%	-3,29%	-	-	-97,02%	-	0,83%
IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)	1,08%	1,08%	5,17%	9,84%	15,92%	34,12%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-25,67%	-25,67%	-77,83%	-82,27%	-	-99,96%	-	0,77%
Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,64%	-2,64%	14,42%	4,55%	-9,84%	12,05%	0,12%	0,46%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-3,25%	-3,25%	20,20%	9,42%	0,04%	22,84%	0,11%	0,41%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,46%	-1,46%	17,60%	12,10%	-6,09%	23,46%	0,11%	0,43%
SMLL (Benchmark)	-3,43%	-3,43%	21,10%	10,52%	-4,50%	38,71%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,91%	-1,91%	17,05%	4,39%	-10,96%	33,55%	0,14%	0,48%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,38%	-0,38%	-1,15%	-2,42%	-4,07%	2,27%	0,00%	0,01%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	1,31%	1,31%	3,93%	-1,21%	-21,80%	-12,08%	0,04%	0,21%
ÁQUILLA FII - AQLL11	-1,53%	-1,53%	-19,99%	-3,99%	6,38%	-14,66%	0,03%	0,53%

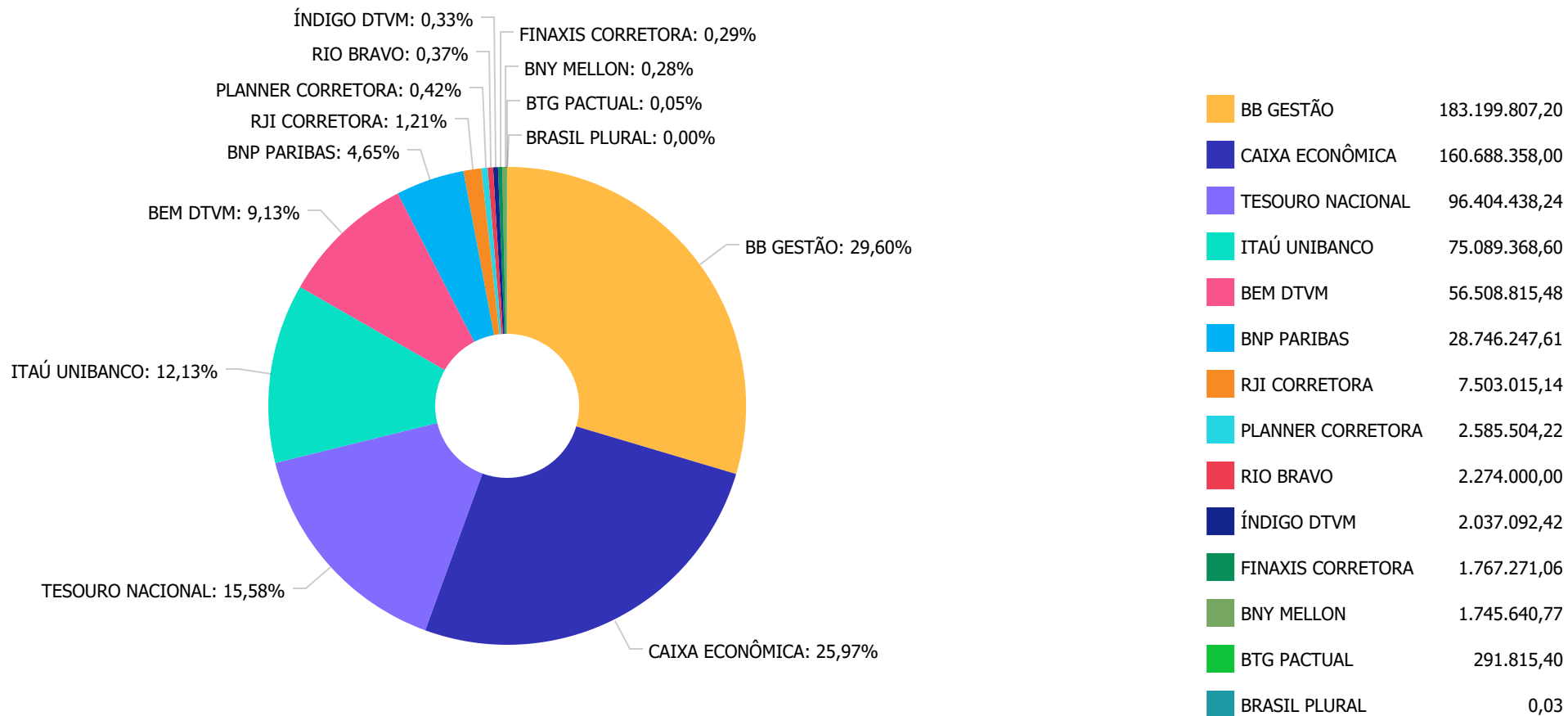
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	-1,91%	4,12%	-12,25%	83,15%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,16%	-0,16%	-0,47%	-1,00%	-	-	-	0,00%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	-3,64%	-3,64%	-5,76%	-10,71%	-24,71%	-90,45%	0,04%	0,29%

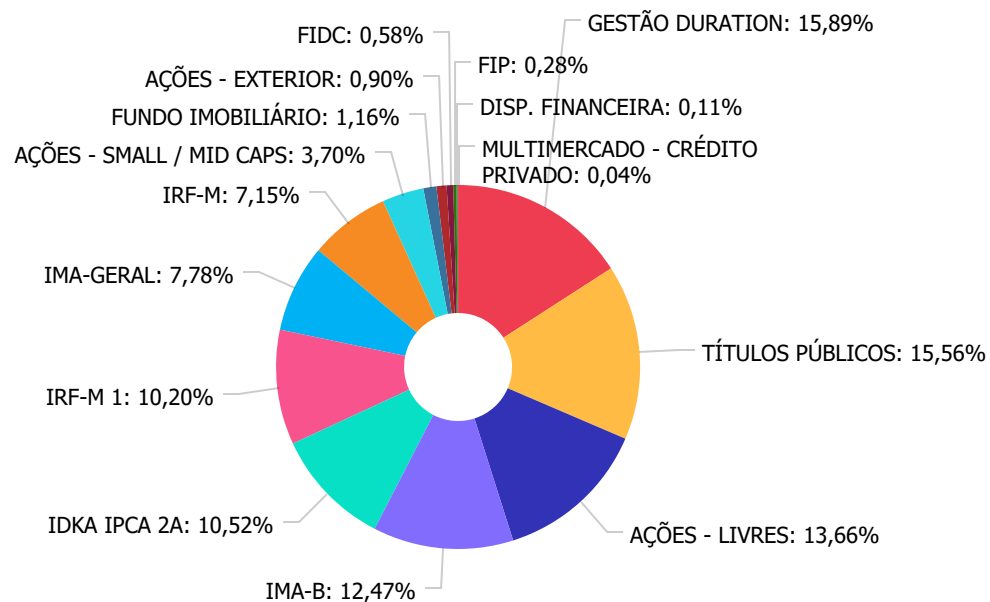
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6,27%	6,27%	11,76%	-	-	-	0,12%	-

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



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



GESTÃO DURATION	98.426.330,00
TÍTULOS PÚBLICOS	96.404.438,24
AÇÕES - LIVRES	84.609.572,46
IMA-B	77.227.862,51
IDKA IPCA 2A	65.162.805,52
IRF-M 1	63.201.372,95
IMA-GERAL	48.207.732,21
IRF-M	44.320.426,28
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	22.944.886,67
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.188.412,04
AÇÕES - EXTERIOR	5.568.690,03
FIDC	3.603.703,01
FIP	1.745.719,50
DISP. FINANCEIRA	676.361,20
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	229.422,75

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	4.012,369905	992.130,00	3.009.277,43	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	4.012,369905	998.799,60	3.049.401,13	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	4.012,369905	1.000.585,27	3.089.524,83	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	4.012,369905	1.124.114,15	3.410.514,42	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	4.012,369905	1.006.644,67	3.009.277,43	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	4.012,369905	999.750,00	3.009.277,43	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1.100	1.352,073136	4.012,369905	1.487.280,45	4.413.606,90	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	4.012,369905	859.423,87	2.527.793,04	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	4.012,369905	136.416,48	401.236,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	4.012,369905	997.614,60	2.929.030,03	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1.100	1.345,077073	4.012,369905	1.479.584,78	4.413.606,90	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	4.012,369905	1.098.188,08	3.530.885,52	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.550,157596	895.805,83	2.775.596,13	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1.010	1.468,534139	4.550,157596	1.483.219,48	4.595.659,17	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1.180	1.468,534144	4.550,157596	1.732.870,29	5.369.185,96	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.550,157596	1.249.170,73	4.167.944,36	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	5.386,304331	960.617,17	3.231.782,60	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	5.386,304331	1.479.336,56	5.052.353,46	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	5.386,304331	798.050,50	2.693.152,17	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	5.386,304331	1.002.194,60	3.716.549,99	Mercado

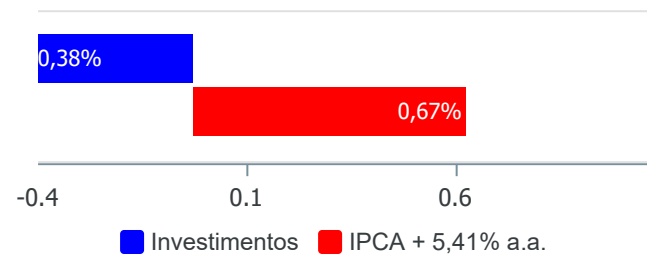
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	5.386,304331	258.043,50	969.534,78	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	5.386,304331	909.797,78	3.398.758,03	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	5.386,304331	429.654,20	1.615.891,30	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1.300	1.602,545169	5.386,304331	2.083.308,72	7.002.195,63	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	5.386,304331	1.411.663,50	4.766.879,33	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	5.386,304331	1.171.463,51	3.996.637,81	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	5.386,304331	798.050,50	2.693.152,17	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	5.386,304331	1.046.269,96	3.565.733,47	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

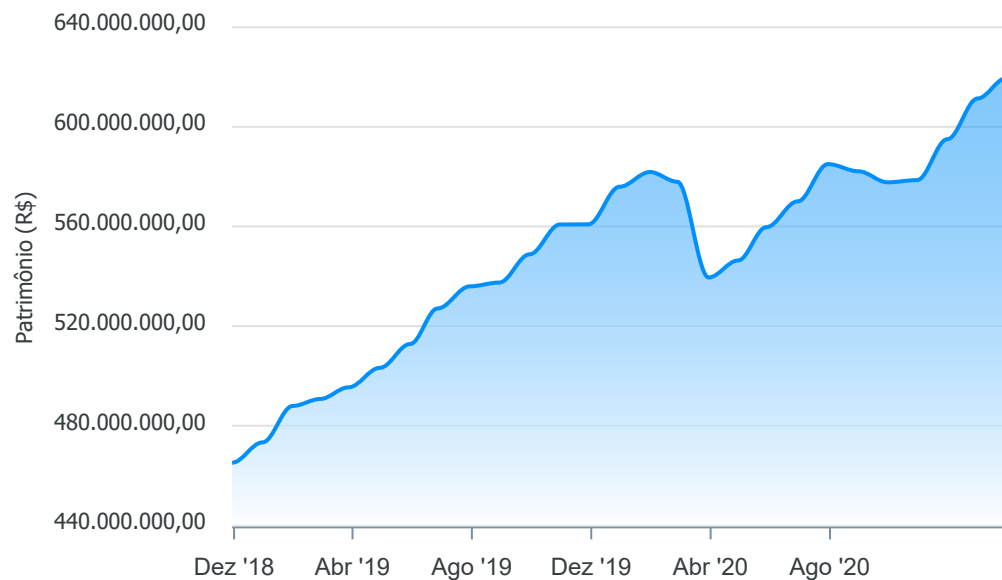
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	600.192.395,18	13.350.000,00	3.570.623,00	607.651.985,78	-2.319.786,40	-2.319.786,40	-0,38%	-0,38%	0,67%	0,67%	-56,76%	3,49%

Investimentos x Meta Atuarial



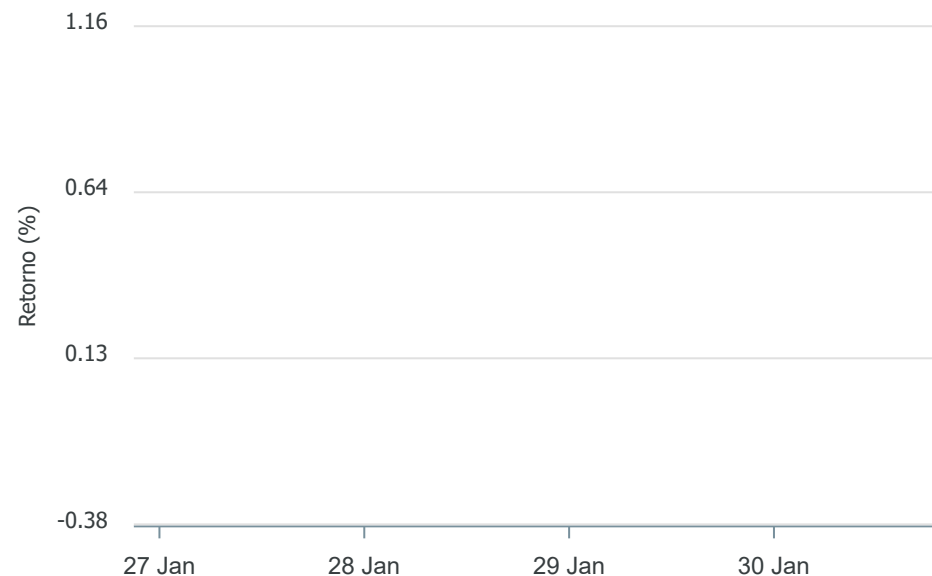
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TÍTULOS PÚBLICOS	95.287.356,19	0,00	0,00	96.404.438,24	1.117.082,05	1,17%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	47.158.043,34	0,00	0,00	47.221.203,80	63.160,46	0,13%	0,13%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	65.075.853,74	0,00	0,00	65.162.805,52	86.951,78	0,13%	0,13%	1,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	53.074.807,27	13.650.000,00	3.550.000,00	63.201.372,95	26.565,68	0,04%	0,03%	0,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.835.861,87	0,00	0,00	1.836.431,92	570,05	0,03%	0,09%	0,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	51.192.179,13	0,00	0,00	51.205.126,20	12.947,07	0,03%	0,03%	0,76%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.770.892,46	0,00	0,00	1.767.271,06	-3.621,40	-0,20%	-0,20%	0,05%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.747.135,36	0,00	0,00	3.736.662,87	-10.472,49	-0,28%	-0,28%	0,42%
BRA1 FI RENDA FIXA	588.856,99	0,00	0,00	587.080,01	-1.776,98	-0,30%	-0,30%	0,60%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.117.214,29	0,00	0,00	1.113.417,59	-3.796,70	-0,34%	-0,34%	1,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.475.489,13	0,00	0,00	48.207.732,21	-267.756,92	-0,55%	-0,55%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	44.664.843,77	0,00	0,00	44.320.426,28	-344.417,49	-0,77%	-0,77%	1,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	72.416.199,36	0,00	0,00	71.790.702,04	-625.497,32	-0,86%	-0,86%	2,59%
Total Renda Fixa	486.404.732,93	13.650.000,00	3.550.000,00	496.554.670,72	49.937,79	0,01%		1,11%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	288.050,04	0,00	1.623,00	291.815,40	5.388,36	1,87%	1,31%	4,07%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.040.285,96	0,00	0,00	2.037.092,42	-3.193,54	-0,16%	-1,53%	2,58%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	1.531.051,33	0,00	0,00	1.528.633,97	-2.417,36	-0,16%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	230.305,58	0,00	0,00	229.422,75	-882,83	-0,38%	-0,38%	0,12%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	218.012,05	0,00	0,00	217.006,80	-1.005,25	-0,46%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28.282.216,50	0,00	0,00	27.868.164,80	-414.051,70	-1,46%	-1,46%	10,78%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.626.105,95	0,00	0,00	2.585.504,22	-40.601,73	-1,55%	0,00%	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	23.392.520,88	0,00	0,00	22.944.886,67	-447.634,21	-1,91%	-1,91%	14,28%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	28.753.732,43	0,00	0,00	27.995.160,05	-758.572,38	-2,64%	-2,64%	11,67%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.360.000,00	0,00	19.000,00	2.274.000,00	-67.000,00	-2,84%	-3,64%	4,09%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	29.710.745,46	0,00	0,00	28.746.247,61	-964.497,85	-3,25%	-3,25%	11,36%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	105,92	0,00	0,00	78,73	-27,19	-25,67%	-	-
Total Renda Variável	119.433.132,10	0,00	20.623,00	116.718.013,42	-2.694.495,68	-2,26%		11,54%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

HORTOPREV - INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE HORTOLÂNDIA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/01/2021

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	5.240.339,18	0,00	0,00	5.568.690,03	328.350,85	6,27%	6,27%	11,97%
Total Exterior	5.240.339,18	0,00	0,00	5.568.690,03	328.350,85	6,27%		11,97%