

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

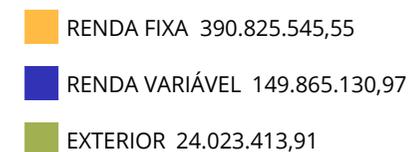
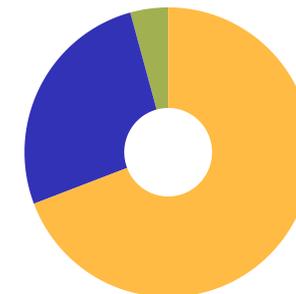
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	18.737.348,55	3,32%	74	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.994.558,93	3,36%	123	2,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	113.082.811,13	20,02%	1.005	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	8.782.569,95	1,56%	165	3,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	73.946.502,03	13,09%	922	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.351.628,20	1,66%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	43.479.415,29	7,70%	885	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	89.368.485,94	15,83%	269	2,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.078.212,32	1,96%	120	1,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.752.795,73	0,49%	641	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.251.217,48	0,22%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	8.747.819,74	1,55%	1.656	0,70%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	14.635.838,13	2,59%	202	1,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	10.260.403,51	1,82%	6.310	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	9.304.470,73	1,65%	12.157	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.059.658,93	1,60%	1.423	2,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	14.734.765,09	2,61%	5.816	0,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	6.648.640,50	1,18%	1.400	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	12.816.294,04	2,27%	55	1,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.372.481,90	1,13%	1.837	0,29%	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
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.352.283,50	1,30%	18.236	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	20.571.050,50	3,64%	110	2,80%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.271.490,98	1,29%	22.197	0,61%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.445.211,08	2,03%	882	1,29%	Artigo 8º, Inciso III
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	10.004.959,78	1,77%	51.370	0,42%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA F...	Não se ...	Não se aplica	639.762,56	0,11%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	7.577.322,00	1,34%	48	0,54%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	7.672.024,91	1,36%	7.150	0,73%	Artigo 9º - A, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.774.067,00	1,55%	704	0,47%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			564.714.090,43				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	286.374.834,08	50,71%	35,00%	55,50%	65,00%	80.689.324,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	84.707.113,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	103.199.493,99	18,27%	15,00%	16,00%	30,00%	66.214.733,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.251.217,48	0,22%	0,00%	0,50%	0,50%	1.572.352,97
Total Renda Fixa	100,00%	390.825.545,55	69,21%	50,00%	72,00%	110,50%	



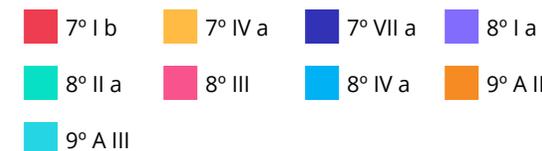
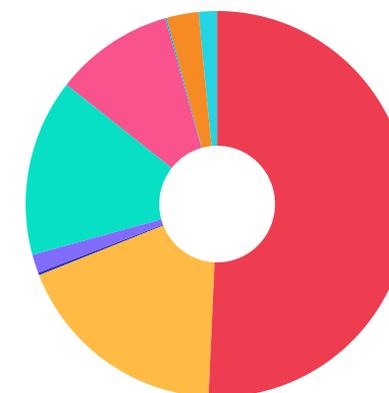
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	35,00%	8.747.819,74	1,55%	0,00%	1,50%	2,50%	5.370.032,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	25,00%	83.832.552,83	14,85%	6,00%	11,50%	15,00%	874.560,73
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	56.644.995,84	10,03%	6,00%	9,50%	10,00%	-173.586,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	639.762,56	0,11%	0,00%	0,50%	1,00%	5.007.378,34
Total Renda Variável	35,00%	149.865.130,97	26,54%	12,00%	23,00%	28,50%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	15.249.346,91	2,70%	0,00%	3,00%	3,00%	1.692.075,80
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	8.774.067,00	1,55%	0,00%	2,00%	2,00%	2.520.214,81
Total Exterior	10,00%	24.023.413,91	4,25%	0,00%	5,00%	5,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	186.044.416,76	32,94	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.054.213,72	17,54	0,01
ITAÚ UNIBANCO	89.368.485,94	15,83	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	40.002.878,96	7,08	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	29.345.117,50	5,20	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	19.612.031,71	3,47	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	18.750.237,23	3,32	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	14.734.765,09	2,61	0,05
ITAÚ DTVM	12.816.294,04	2,27	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	11.445.211,08	2,03	0,00
VINCI GESTÃO DE PATRIMÔNIO LTD...	10.004.959,78	1,77	0,01
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	9.304.470,73	1,65	0,03
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	9.059.658,93	1,60	0,01
WESTERN ASSET	7.271.490,98	1,29	0,01
VINCI PARTNERS	6.648.640,50	1,18	0,01
PETRA CAPITAL	1.251.217,48	0,22	0,02

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 '	286.374.834,08	50,71	35,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	103.199.493,99	18,27	15,00	30,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.251.217,48	0,22	0,00	0,50
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	8.747.819,74	1,55	0,00	2,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	83.832.552,83	14,85	6,00	15,00
Artigo 8º, Inciso III	56.644.995,84	10,03	6,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	639.762,56	0,11	0,00	1,00
Artigo 9º - A, Inciso II	15.249.346,91	2,70	0,00	3,00
Artigo 9º - A, Inciso III	8.774.067,00	1,55	0,00	2,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

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 PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	1,97%	8,49%	1,71%	1,77%	8,49%	21,39%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,96%	8,24%	1,69%	1,63%	8,24%	20,80%	0,01%	0,03%
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%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,53%	3,78%	3,94%	2,32%	3,78%	16,00%	0,01%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	5,61%	2,89%	3,91%	5,61%	16,66%	0,01%	0,02%
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%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,15%	-4,83%	-0,46%	-3,33%	-4,83%	-13,52%	0,00%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,20%	2,86%	0,39%	0,58%	2,86%	15,12%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,01%	0,02%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,61%	2,70%	0,75%	0,71%	2,70%	16,76%	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
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,83%	-28,15%	3,63%	-28,28%	-28,15%	-22,56%	0,01%	0,32%

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
S&P 500 (Benchmark)	3,71%	16,26%	11,69%	21,15%	16,26%	49,83%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,19%	12,17%	11,55%	19,85%	12,17%	48,40%	0,04%	0,27%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3,07%	12,58%	11,36%	19,62%	12,58%	48,60%	0,05%	0,26%
IPCA + 10,00% ao ano (Benchmark)	2,20%	14,93%	5,62%	9,59%	14,93%	31,91%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,30%	-	-1,26%	-2,79%	-	-78,74%	0,00%	0,10%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	0,74%	7,34%	2,11%	3,72%	7,34%	20,72%	0,01%	0,02%
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%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,23%	7,88%	12,39%	17,68%	7,88%	50,20%	0,07%	0,43%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7,70%	-12,57%	17,26%	17,08%	-12,57%	29,24%	0,07%	0,50%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8,55%	2,60%	22,63%	21,85%	2,60%	45,60%	0,07%	0,41%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	7,90%	-3,67%	20,63%	27,64%	-3,67%	22,88%	0,07%	0,41%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	9,20%	3,48%	21,18%	22,19%	3,48%	54,75%	0,06%	0,42%

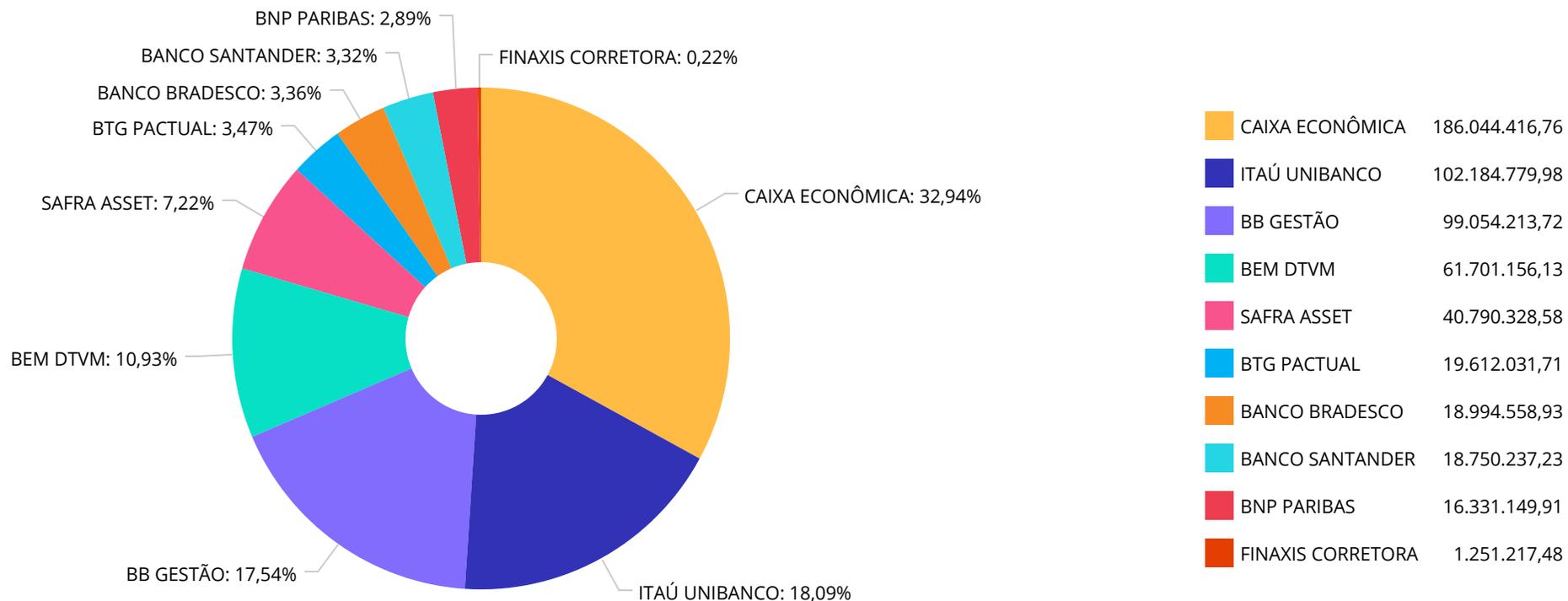
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	7,52%	-0,65%	22,54%	25,33%	-0,65%	57,16%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6,93%	-3,16%	16,95%	21,44%	-3,16%	44,95%	0,06%	0,49%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,76%	3,08%	1,50%	1,45%	3,08%	9,73%	0,00%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,56%	2,52%	6,28%	5,81%	2,52%	16,57%	0,02%	0,12%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,61%	-1,90%	14,88%	16,21%	-1,90%	41,74%	0,06%	0,42%

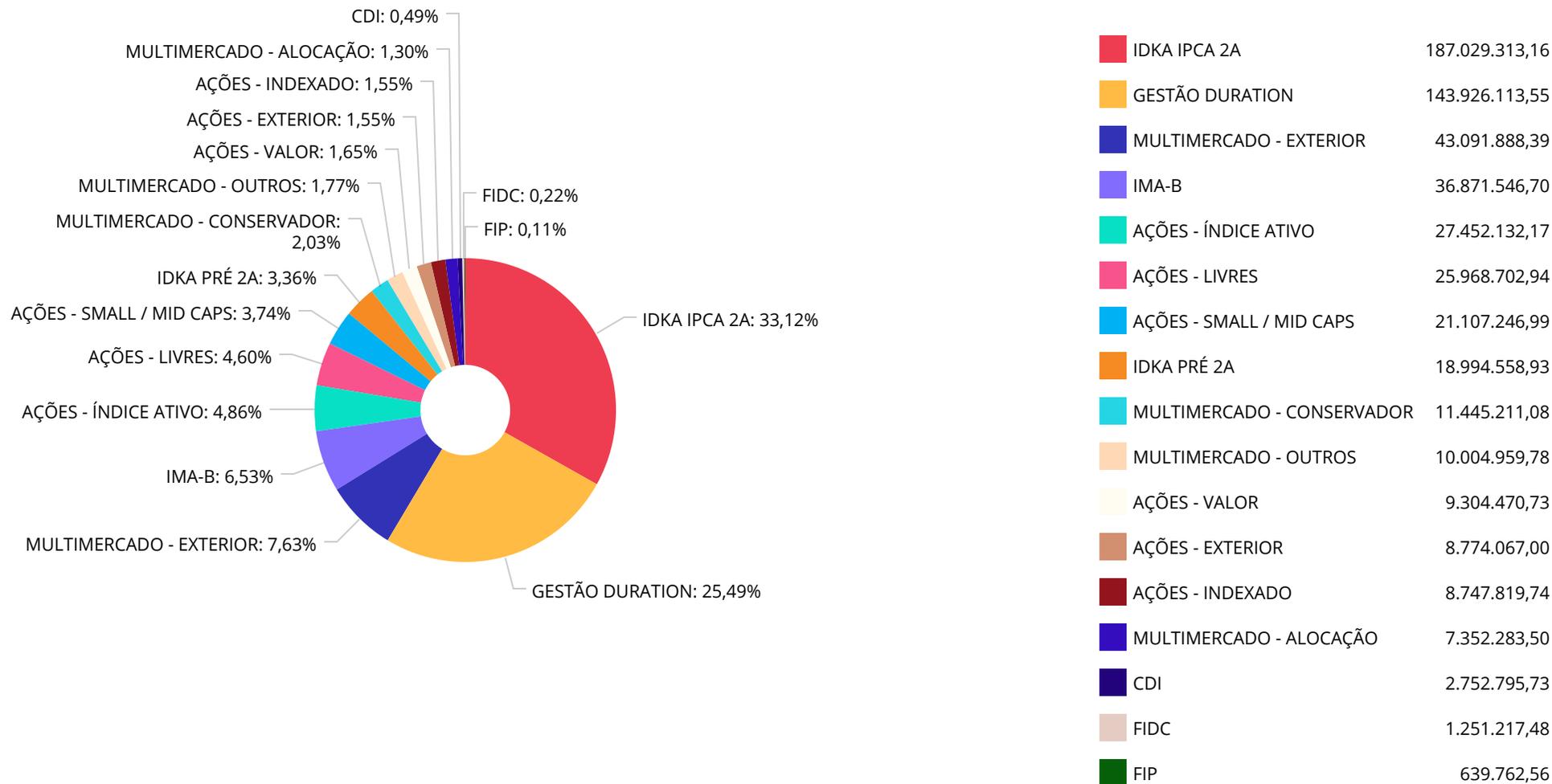
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	0,93%	54,01%	1,70%	16,29%	54,01%	108,94%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,35%	44,45%	1,33%	16,88%	44,45%	98,40%	0,08%	0,24%
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%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	1,09%	51,88%	7,76%	21,48%	51,88%	101,94%	0,11%	0,22%

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



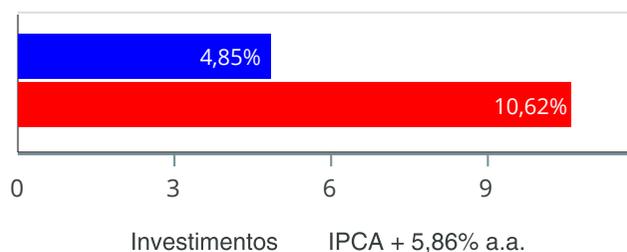
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

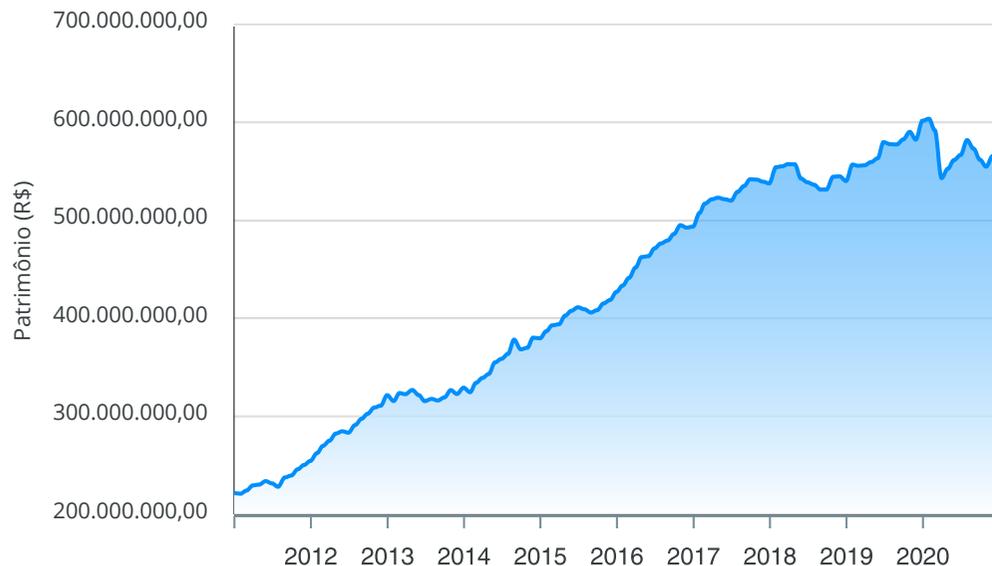
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	601.757.165,89	33.792.081,99	34.429.117,89	603.762.413,32	2.642.283,33	2.642.283,33	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,89%	2,07%
Fevereiro	603.762.413,32	118.776.753,06	122.569.044,97	591.890.201,50	-8.079.919,91	-5.437.636,58	-1,34%	-0,91%	0,66%	1,37%	-65,93%	4,18%
Março	591.890.201,50	19.290.056,34	21.502.334,97	543.161.369,33	-46.516.553,54	-51.954.190,12	-7,86%	-8,69%	0,57%	1,95%	-445,95%	15,79%
Abril	543.161.369,33	35.294.520,01	39.137.466,90	552.732.885,77	13.414.463,33	-38.539.726,79	2,47%	-6,44%	0,14%	2,09%	-307,50%	8,16%
Mai	552.732.885,77	33.482.139,00	37.311.288,32	561.503.943,68	12.600.207,23	-25.939.519,56	2,28%	-4,31%	0,07%	2,17%	-198,72%	4,07%
Junho	561.503.943,68	25.232.606,58	32.392.567,75	566.779.910,66	12.435.928,15	-13.503.591,41	2,21%	-2,19%	0,74%	2,92%	-74,87%	3,64%
Julho	566.779.910,66	13.534.143,80	17.603.452,90	581.950.094,04	19.239.492,48	5.735.901,07	3,39%	1,13%	0,88%	3,83%	29,64%	2,91%
Agosto	581.950.094,04	205.867.975,03	212.983.934,58	573.188.442,12	-1.645.692,37	4.090.208,70	-0,28%	0,85%	0,72%	4,57%	18,56%	2,56%
Setembro	573.188.442,12	13.339.177,27	17.826.554,35	561.968.375,05	-6.732.689,99	-2.642.481,29	-1,17%	-0,34%	1,12%	5,74%	-5,85%	3,37%
Outubro	561.968.375,05	21.738.909,23	27.830.971,88	554.898.696,53	-977.615,87	-3.620.097,16	-0,17%	-0,51%	1,34%	7,16%	-7,11%	2,97%
Novembro	554.898.696,53	18.252.549,50	23.588.993,85	565.684.252,34	16.122.000,16	12.501.903,00	2,91%	2,38%	1,35%	8,60%	27,68%	2,73%
Dezembro	565.684.252,34	76.851.657,70	91.471.057,02	564.714.090,43	13.649.237,41	26.151.140,41	2,41%	4,85%	1,86%	10,62%	45,70%	2,08%

Investimentos x Meta Atuarial



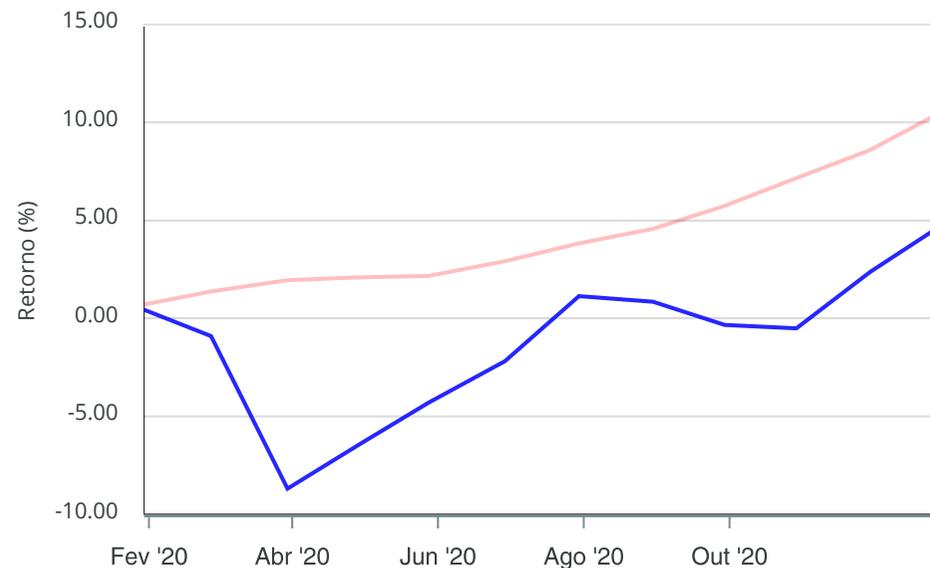
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO



- 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
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	7.164.487,50	0,00	7.373.068,85	0,00	208.581,35	2,91%	4,58%	1,99%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.274.484,92	0,00	0,00	18.737.348,55	462.863,63	2,53%	2,53%	1,26%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.183.416,40	0,00	0,00	9.351.628,20	168.211,80	1,83%	1,83%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	79.108.702,62	999.419,55	7.290.000,00	73.946.502,03	1.128.379,86	1,41%	1,53%	0,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	119.848.308,43	20.166.917,08	28.837.572,40	113.082.811,13	1.905.158,02	1,36%	1,65%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	42.912.683,35	0,00	0,00	43.479.415,29	566.731,94	1,32%	1,32%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.677.873,85	0,00	0,00	8.782.569,95	104.696,10	1,21%	1,21%	0,64%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	18.286.916,48	0,00	18.423.465,72	0,00	136.549,24	0,75%	4,83%	2,03%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	18.117.675,57	29.971.855,35	29.376.950,05	18.994.558,93	281.978,06	0,59%	1,96%	1,19%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	11.023.465,72	0,00	11.078.212,32	54.746,60	0,50%	0,61%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.912.719,90	0,00	170.000,00	2.752.795,73	10.075,83	0,35%	0,36%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	89.188.183,27	0,00	0,00	89.368.485,94	180.302,67	0,20%	0,20%	0,02%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.253.055,50	0,00	0,00	1.251.217,48	-1.838,02	-0,15%	-0,15%	0,01%
Total Renda Fixa	414.928.507,79	62.161.657,70	91.471.057,02	390.825.545,55	5.206.437,08	1,09%		0,56%

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
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	6.088.503,76	0,00	0,00	6.648.640,50	560.136,74	9,20%	9,20%	5,61%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8.044.078,03	0,00	0,00	8.747.819,74	703.741,71	8,75%	8,75%	6,71%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.867.413,96	0,00	0,00	6.372.481,90	505.067,94	8,61%	8,61%	5,68%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.345.746,96	0,00	0,00	9.059.658,93	713.911,97	8,55%	8,55%	6,52%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11.826.903,55	0,00	0,00	12.816.294,04	989.390,49	8,37%	8,37%	6,16%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	13.563.723,90	0,00	0,00	14.635.838,13	1.072.114,23	7,90%	7,90%	6,96%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8.639.550,11	0,00	0,00	9.304.470,73	664.920,62	7,70%	7,70%	6,62%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.780.393,96	0,00	0,00	14.734.765,09	954.371,13	6,93%	6,93%	5,86%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.750.041,38	0,00	0,00	10.260.403,51	510.362,13	5,23%	5,23%	6,81%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.046.748,98	0,00	0,00	7.271.490,98	224.742,00	3,19%	3,19%	4,36%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	19.958.713,61	0,00	0,00	20.571.050,50	612.336,89	3,07%	3,07%	4,55%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.168.716,23	0,00	0,00	7.352.283,50	183.567,27	2,56%	2,56%	1,80%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.358.426,33	0,00	0,00	11.445.211,08	86.784,75	0,76%	0,76%	0,31%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.931.332,81	0,00	0,00	10.004.959,78	73.626,97	0,74%	0,74%	0,57%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIELABORATÓRIA FIP	641.716,15	0,00	0,00	639.762,56	-1.953,59	-0,30%	-0,30%	0,01%
Total Renda Variável	142.012.009,72	0,00	0,00	149.865.130,97	7.853.121,25	5,53%		4,92%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS EFETIVOS DE BAURU - FUNPREV
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
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,00	7.290.000,00	0,00	7.577.322,00	287.322,00	3,94%	1,09%	10,67%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	0,00	7.400.000,00	0,00	7.672.024,91	272.024,91	3,68%	0,48%	8,64%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.743.734,83	0,00	0,00	8.774.067,00	30.332,17	0,35%	0,35%	8,10%
Total Renda Variável	8.743.734,83	14.690.000,00	0,00	24.023.413,91	589.679,08	2,52%		9,08%

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	117.421.295,50	43.016.628,66	50.730.821,81	113.082.811,13	3.375.708,78	2,10%	3,05%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	75.684.995,07	3.126.533,76	7.290.000,00	73.946.502,03	2.424.973,20	3,08%	3,22%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	42.609.607,06	0,00	0,00	43.479.415,29	869.808,23	2,04%	2,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.027.694,26	0,00	0,00	18.737.348,55	709.654,29	3,94%	3,94%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	21.834.407,03	0,00	22.373.068,85	0,00	538.661,82	2,47%	7,00%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	17.898.559,12	0,00	18.423.465,72	0,00	524.906,60	2,93%	7,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	89.025.921,77	0,00	0,00	89.368.485,94	342.564,17	0,38%	0,38%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.024.326,10	0,00	0,00	9.351.628,20	327.302,10	3,63%	3,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.535.583,70	0,00	0,00	8.782.569,95	246.986,25	2,89%	2,89%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	17.468.108,31	44.986.488,29	43.670.272,00	18.994.558,93	210.234,33	0,34%	1,69%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	11.023.465,72	0,00	11.078.212,32	54.746,60	0,50%	0,75%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.104.645,89	0,00	370.000,00	2.752.795,73	18.149,84	0,58%	0,64%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.256.951,44	0,00	0,00	1.251.217,48	-5.733,96	-0,46%	-0,46%
Total Renda Fixa					9.637.962,25	1,84%	

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
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	12.132.538,18	0,00	0,00	14.635.838,13	2.503.299,95	20,63%	20,63%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.537.134,99	0,00	0,00	12.816.294,04	2.279.159,05	21,63%	21,63%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.599.777,04	0,00	0,00	14.734.765,09	2.134.988,05	16,94%	16,94%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18.472.254,20	0,00	0,00	20.571.050,50	2.098.796,30	11,36%	11,36%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	7.031.994,56	0,00	0,00	8.747.819,74	1.715.825,18	24,40%	24,40%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.387.677,25	0,00	0,00	9.059.658,93	1.671.981,68	22,63%	22,63%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.935.030,09	0,00	0,00	9.304.470,73	1.369.440,64	17,26%	17,26%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	5.486.630,64	0,00	0,00	6.648.640,50	1.162.009,86	21,18%	21,18%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.129.332,40	0,00	0,00	10.260.403,51	1.131.071,11	12,39%	12,39%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.546.862,87	0,00	0,00	6.372.481,90	825.619,03	14,88%	14,88%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.518.407,05	0,00	0,00	7.271.490,98	753.083,93	11,55%	11,55%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.917.902,15	0,00	0,00	7.352.283,50	434.381,35	6,28%	6,28%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.798.055,91	0,00	0,00	10.004.959,78	206.903,87	2,11%	2,11%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.275.827,82	0,00	0,00	11.445.211,08	169.383,26	1,50%	1,50%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIELABRATÉGIA FIP	647.934,21	0,00	33.394,37	639.762,56	25.222,72	3,89%	-1,26%
				Total Renda Variável	18.481.165,98	14,06%	

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
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,00	7.290.000,00	0,00	7.577.322,00	287.322,00	3,94%	7,76%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	0,00	7.400.000,00	0,00	7.672.024,91	272.024,91	3,68%	4,21%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.658.920,44	0,00	0,00	8.774.067,00	115.146,56	1,33%	1,33%
				Total Exterior	674.493,47	2,89%	

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...	9.721.124,12	258.976.833,11	159.476.332,05	113.082.811,13	3.861.185,95	1,44%	8,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	50.646.691,03	60.701.630,36	40.902.923,58	73.946.502,03	3.501.104,22	3,14%	7,92%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	40.358.757,61	424.153,10	0,00	43.479.415,29	2.696.504,58	6,61%	6,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	90.774.729,40	0,00	4.000.000,00	89.368.485,94	2.593.756,54	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	100.026.864,49	18.221.704,21	120.141.766,67	0,00	1.893.197,97	1,60%	6,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.054.416,06	0,00	855.420,08	18.737.348,55	1.538.352,57	8,52%	3,78%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	179.313.823,48	161.735.949,08	18.994.558,93	1.416.684,53	0,79%	8,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	24.675.619,60	0,00	16.720.453,43	8.782.569,95	827.403,78	3,35%	5,61%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.015.690,20	0,00	4.449.370,16	9.351.628,20	785.308,16	6,03%	-28,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	35.413.921,86	5.055.494,17	41.112.510,48	0,00	643.094,45	1,59%	6,14%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	18.110.044,05	0,00	18.423.465,72	0,00	313.421,67	1,73%	5,85%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	37.912.957,19	16.000.000,00	54.098.722,30	0,00	185.765,11	0,34%	2,13%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	48.367.093,72	0,00	48.523.068,85	0,00	155.975,13	0,32%	4,97%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.095.136,69	0,00	1.425.000,00	2.752.795,73	82.659,04	2,02%	2,42%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	11.023.465,72	0,00	11.078.212,32	54.746,60	0,50%	2,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	6.745.465,36	6.748.408,61	0,00	2.943,25	0,04%	2,40%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.314.712,69	0,00	0,00	1.251.217,48	-63.495,21	-4,83%	-4,83%
				Total Renda Fixa	20.488.608,34	1,95%	

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
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18.271.871,93	0,00	0,00	20.571.050,50	2.299.178,57	12,58%	12,58%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.511.250,72	0,00	0,00	10.260.403,51	749.152,79	7,88%	7,88%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.320.948,17	0,00	0,00	10.004.959,78	684.011,61	7,34%	7,34%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	6.720.000,00	0,00	7.271.490,98	551.490,98	8,21%	12,17%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.103.594,04	0,00	0,00	11.445.211,08	341.617,04	3,08%	3,08%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	12.547.420,56	0,00	0,00	12.816.294,04	268.873,48	2,14%	2,14%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.829.781,08	0,00	0,00	9.059.658,93	229.877,85	2,60%	2,60%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8.553.052,64	0,00	0,00	8.747.819,74	194.767,10	2,28%	2,28%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	7.200.000,00	0,00	7.352.283,50	152.283,50	2,12%	2,52%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	722.229,59	0,00	33.394,37	639.762,56	-49.072,66	-6,79%	-
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	0,00	6.720.000,00	0,00	6.648.640,50	-71.359,50	-1,06%	3,48%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	6.720.000,00	0,00	6.372.481,90	-347.518,10	-5,17%	-1,90%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.215.455,71	0,00	0,00	14.734.765,09	-480.690,62	-3,16%	-3,16%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	15.193.802,74	0,00	0,00	14.635.838,13	-557.964,61	-3,67%	-3,67%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,00	10.220.000,00	0,00	9.304.470,73	-915.529,27	-8,96%	-12,57%
				Total Renda Variável	3.049.118,16	2,08%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	6.720.000,00	0,00	8.774.067,00	2.054.067,00	30,57%	44,45%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,00	7.290.000,00	0,00	7.577.322,00	287.322,00	3,94%	51,88%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	0,00	7.400.000,00	0,00	7.672.024,91	272.024,91	3,68%	61,34%
				Total Exterior	2.613.413,91	12,21%	