

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

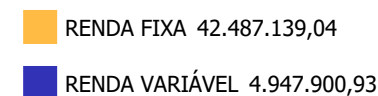
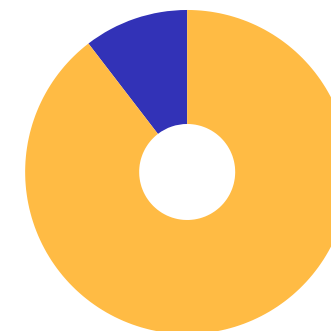
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	5.829.262,49	12,29%	903	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.757.942,36	3,71%	897	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.209.665,76	2,55%	692	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.472.318,92	7,32%	1.012	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	2.207.306,49	4,65%	117	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.849.373,51	12,33%	933	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.899.158,90	10,33%	677	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.170.490,51	2,47%	706	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	4.151.133,75	8,75%	827	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+1	Não há	2.485.377,38	5,24%	458	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	2.648.158,65	5,58%	81	2,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	947.377,16	2,00%	484	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.142.007,19	6,62%	44	1,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	208.343,22	0,44%	778	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.801.166,35	3,80%	53	1,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	708.056,40	1,49%	98	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	570.601,11	1,20%	97	0,05%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.518.701,81	5,31%	966	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	304.617,35	0,64%	123	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.272.951,67	2,68%	9.885	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	281.028,99	0,59%	164	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
Total para cálculo dos limites da Resolução			47.435.039,97				

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

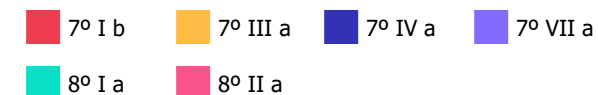
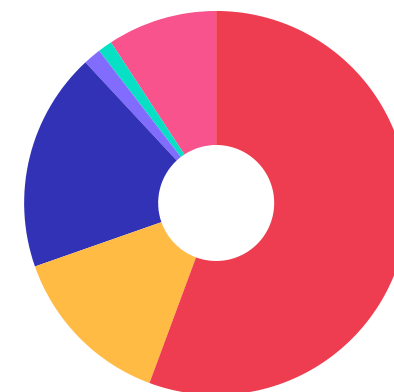
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	26.395.518,94	55,65%	11,35%	52,75%	70,94%	7.254.898,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	6.636.511,13	13,99%	0,00%	0,00%	18,00%	1.901.796,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	8.747.052,57	18,44%	3,91%	19,54%	40,00%	10.226.963,42
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	708.056,40	1,49%	0,00%	1,57%	1,57%	36.673,73
Total Renda Fixa	100,00%	42.487.139,04	89,57%	15,26%	73,86%	130,51%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	570.601,11	1,20%	0,00%	0,00%	1,12%	-39.328,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	4.377.299,82	9,23%	3,69%	18,45%	20,00%	5.109.708,17
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,07%	7,07%	10,00%	4.743.504,00
Total Renda Variável	30,00%	4.947.900,93	10,43%	6,76%	25,52%	31,12%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	2.371.752,00
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	2.371.752,00
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,62%	10,00%	



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

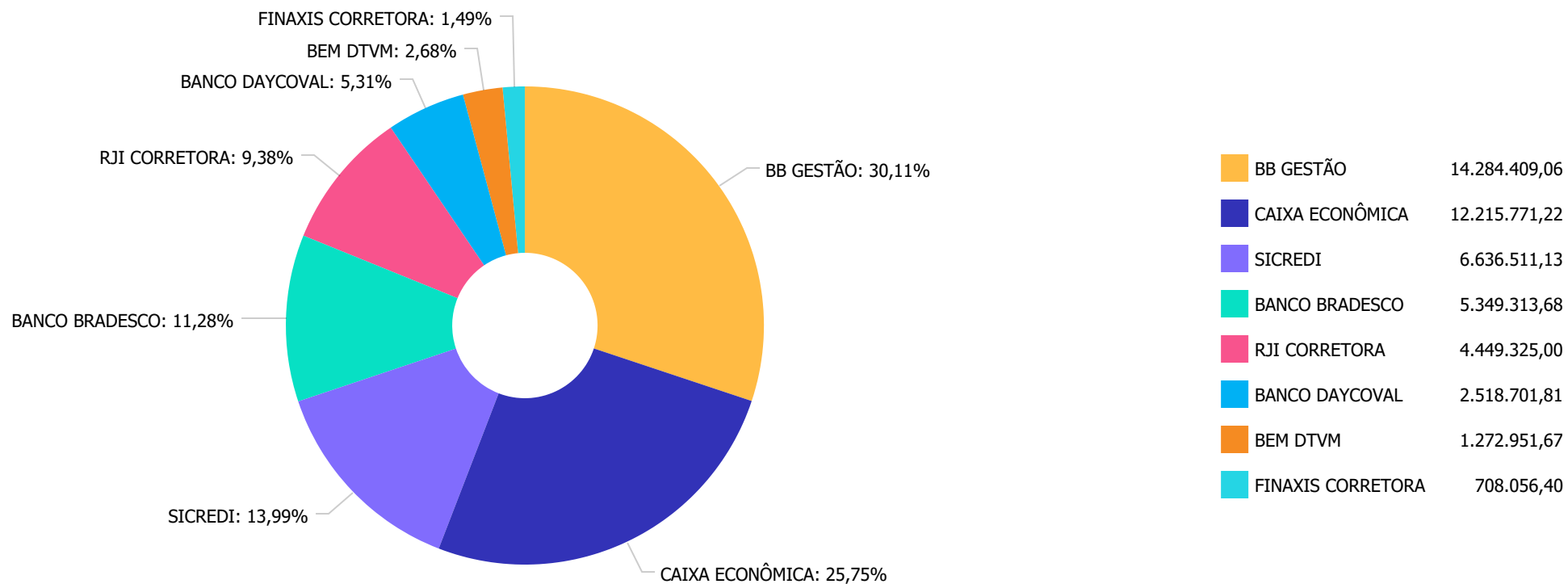
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.284.409,06	30,11	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.630.124,88	24,52	-
SICREDI	6.636.511,13	13,99	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.349.313,68	11,28	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	4.449.325,00	9,38	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.518.701,81	5,31	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.272.951,67	2,68	-
PETRA CAPITAL	708.056,40	1,49	-
VINCI PARTNERS	585.646,34	1,23	-

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)

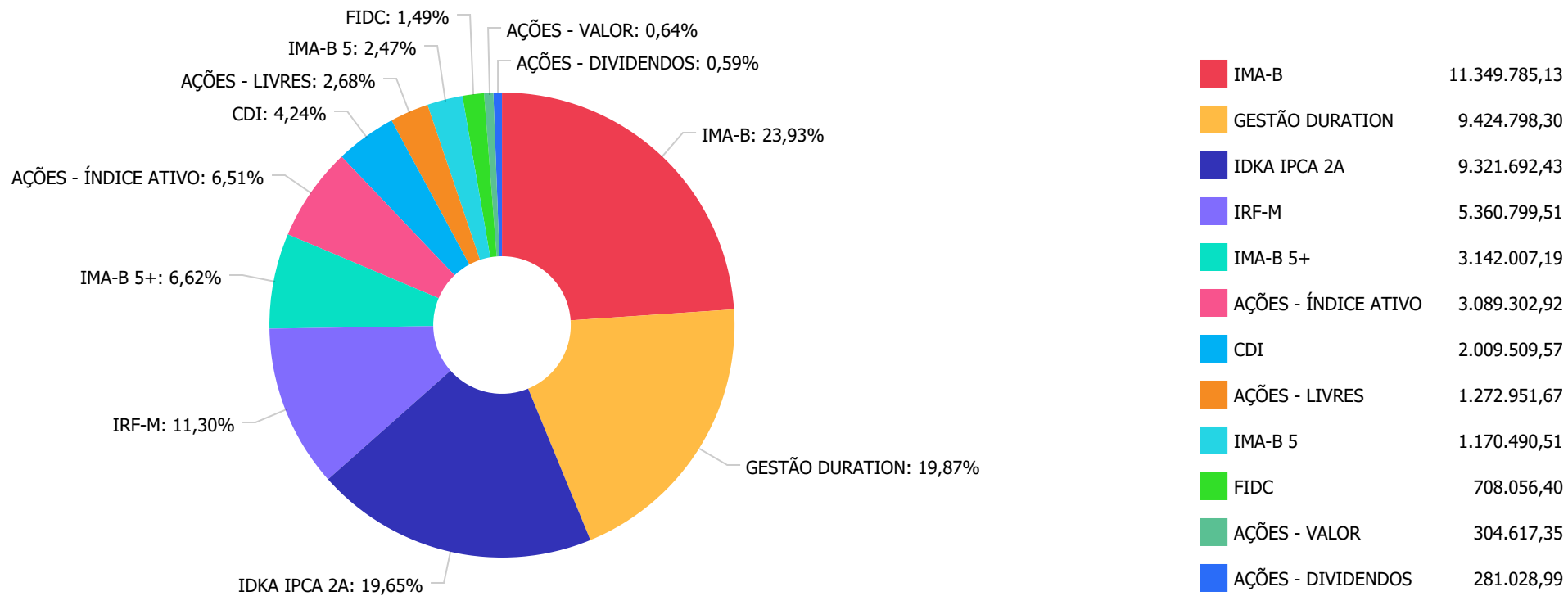
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	26.395.518,94	55,65	11,35	70,94
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	6.636.511,13	13,99	0,00	18,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	8.747.052,57	18,44	3,91	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	708.056,40	1,49	0,00	1,57
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	4.377.299,82	9,23	18,45	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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



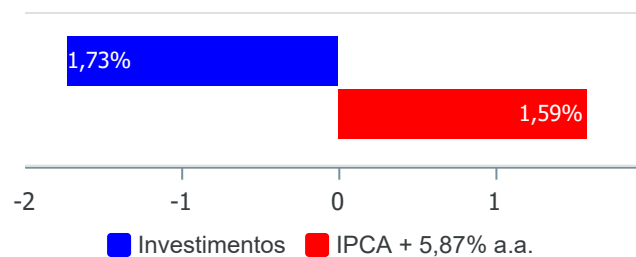
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2021)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

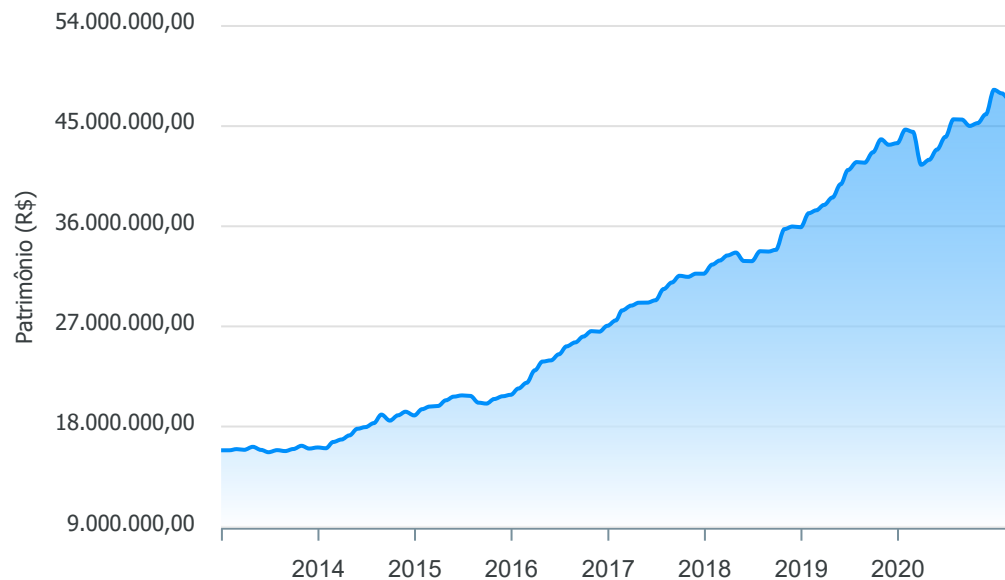
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	48.262.579,72	965.623,11	967.772,64	47.946.315,25	-314.114,94	-314.114,94	-0,65%	-0,65%	0,70%	0,70%	-92,34%	2,89%
Fevereiro	47.946.315,25	1.362.316,98	1.353.988,99	47.435.039,97	-519.603,27	-833.718,21	-1,08%	-1,73%	0,88%	1,59%	-108,55%	2,67%

Investimentos x Meta Atuarial



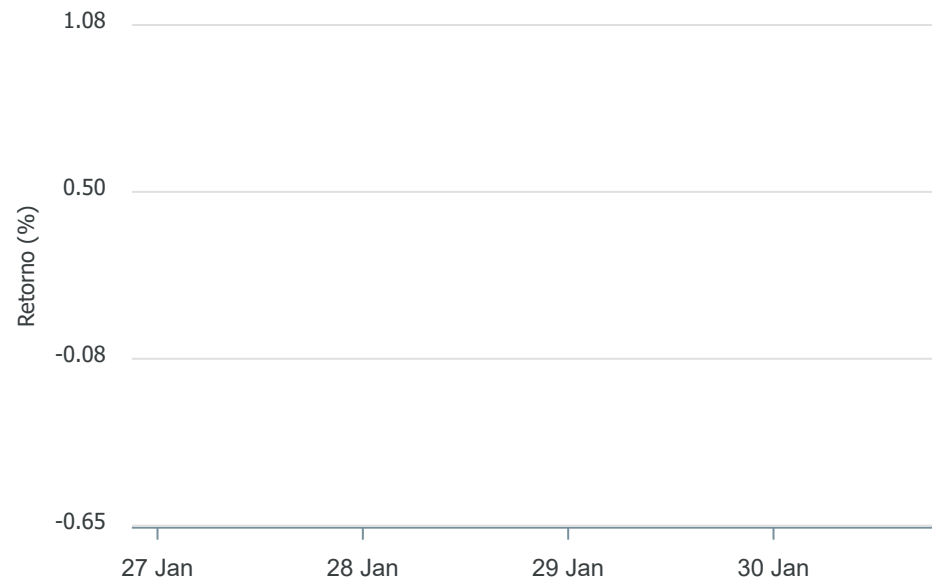
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2.602.660,31	0,00	0,00	2.648.158,65	45.498,34	1,75%	1,75%	1,71%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1.781.900,47	0,00	0,00	1.801.166,35	19.265,88	1,08%	1,08%	0,55%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	563.216,77	998.820,14	1.353.988,99	208.343,22	295,30	0,02%	0,05%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	709.461,89	0,00	0,00	708.056,40	-1.405,49	-0,20%	-0,20%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.858.999,40	0,00	0,00	5.829.262,49	-29.736,91	-0,51%	-0,51%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.490.674,13	0,00	0,00	3.472.318,92	-18.355,21	-0,53%	-0,53%	1,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.881.618,83	0,00	0,00	5.849.373,51	-32.245,32	-0,55%	-0,55%	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.177.728,08	0,00	0,00	1.170.490,51	-7.237,57	-0,61%	-0,61%	1,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	593.889,38	363.496,84	0,00	947.377,16	-10.009,06	-1,05%	-0,93%	1,29%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.224.241,34	0,00	0,00	1.209.665,76	-14.575,58	-1,19%	-1,19%	1,02%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	4.208.043,08	0,00	0,00	4.151.133,75	-56.909,33	-1,35%	-1,35%	1,25%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	2.523.984,21	0,00	0,00	2.485.377,38	-38.606,83	-1,53%	-1,53%	2,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.975.424,61	0,00	0,00	4.899.158,90	-76.265,71	-1,53%	-1,53%	2,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.785.448,01	0,00	0,00	1.757.942,36	-27.505,65	-1,54%	-1,54%	2,32%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.241.844,51	0,00	0,00	2.207.306,49	-34.538,02	-1,54%	-1,54%	2,32%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3.212.958,44	0,00	0,00	3.142.007,19	-70.951,25	-2,21%	-2,21%	3,69%
Total Renda Fixa	42.832.093,46	1.362.316,98	1.353.988,99	42.487.139,04	-353.282,41	-0,82%		1,62%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.304.260,01	0,00	0,00	1.272.951,67	-31.308,34	-2,40%	-2,40%	11,82%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2.606.149,44	0,00	0,00	2.518.701,81	-87.447,63	-3,36%	-3,36%	11,24%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	591.516,39	0,00	0,00	570.601,11	-20.915,28	-3,54%	-3,54%	13,10%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	293.695,56	0,00	0,00	281.028,99	-12.666,57	-4,31%	-4,31%	11,89%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	318.600,39	0,00	0,00	304.617,35	-13.983,04	-4,39%	-4,39%	10,78%
Total Renda Variável	5.114.221,79	0,00	0,00	4.947.900,93	-166.320,86	-3,25%		11,61%