


# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021



Don R. 10/2/21



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

## Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

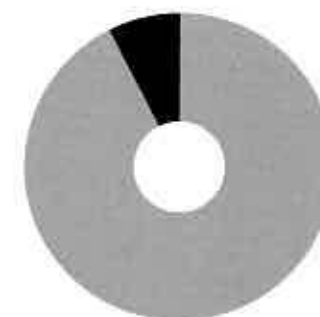
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	19.083.694,70	14,13%	892	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	21.857.703,58	16,18%	977	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	8.188.756,09	6,06%	1.212	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	30.297.813,43	22,43%	1.348	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.083.705,21	11,17%	262	1,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	988.207,95	0,73%	75	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	5.499.694,88	4,07%	18	3,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.628.470,63	2,69%	264	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	5.654.455,82	4,19%	578	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BARCELONA FI RENDA FIXA	D+1 ou ...	90 dias	2.515.427,11	1,86%	10	5,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+60	Não há	3.165.516,41	2,34%	23	1,28%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	10.983,52	0,01%	41	0,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
ILLUMINATI FIDC	D+1 ou ...	30 dias	3.258.424,35	2,41%	11	2,57%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.677.840,58	2,72%	33	2,27%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	40.017,09	0,03%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	1.874.840,00	1,39%	77	0,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.108.318,45	1,56%	1.797	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	3.205.703,92	2,37%	14	1,76%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	993.612,08	0,74%	17	3,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	309.785,78	0,23%	7	7,40%	Artigo 8º, Inciso IV, 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
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	43.401,36	0,03%	33	0,54%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
SÃO DOMINGOS FII - FID11	Não se ...	Não se aplica	1.436.180,78	1,06%		3,84%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	759.076,12	0,56%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	955.003,94	0,71%		1,33%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou...	1800 dias	413.557,53	0,31%	7	3,64%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			135.050.191,31				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			37.422,65				Artigo 6º
PL Total			135.087.613,96				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	100,00%	94.511.673,01	69,98%	15,00%	25,00%	100,00%	40.538.518,30
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	81.030.114,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'	40,00%	18.286.256,39	13,54%	10,00%	30,00%	40,00%	35.733.820,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	20.257.528,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'a'	5,00%	10.152.781,95	7,52%	2,00%	5,00%	5,00%	-3.400.272,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b'	5,00%	1.874.840,00	1,39%	0,00%	0,00%	5,00%	-4.877.669,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.752.509,57
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>124.825.551,35</b>	<b>92,43%</b>	<b>32,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>230,00%</b>	

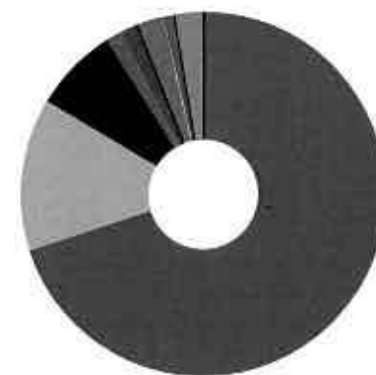


RENDA FIXA 124.825.551,35

RENDA VARIÁVEL 10.224.639,96

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	2.108.318,45	1,56%	7,00%	10,00%	20,00%	24.901.719,81
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.205.703,92	2,37%	7,00%	10,00%	10,00%	10.299.315,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	1.346.799,22	1,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.405.710,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	3.150.260,84	2,33%	2,00%	5,00%	5,00%	3.602.248,73
Desenquadrado - RV	0,00%	413.557,53	0,31%	0,00%	0,00%	0,00%	-413.557,53
Total Renda Variável	30,00%	10.224.639,96	7,57%	18,00%	30,00%	40,00%	



## 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
<b>130% do CDI (Benchmark)</b>	0,19%	0,19%	0,60%	1,22%	3,30%	11,13%	-	-
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,19%	0,19%	0,60%	1,23%	3,31%	11,15%	0,00%	0,00%
<b>IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,90%	0,90%	4,59%	8,61%	13,34%	28,17%	-	-
ILLUMINATI FIDC	10,03%	10,03%	-9,49%	-13,00%	-23,46%	-16,38%	0,21%	0,22%
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,42%	0,42%	1,32%	2,68%	6,07%	16,15%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9,83%	9,83%	1,16%	192,94%	129,68%	295,93%	-	1,26%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,07%	0,07%	-0,55%	1.226,37%	1.004,83%	4.155,46%	-	-
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,79%	0,79%	4,23%	7,86%	11,79%	24,66%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3,90%	3,90%	3,88%	3,74%	-15,81%	-26,90%	-	0,05%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,53%	0,90%	3,22%	9,83%	0,00%	0,01%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	0,03%	0,55%	0,82%	3,08%	9,60%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	3,22%	3,64%	7,25%	19,86%	0,01%	0,04%

## 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
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%
<b>Selic (Benchmark)</b>	0.15%	0.15%	0.46%	0.94%	2.53%	8.46%	-	-
BARCELONA FI RENDA FIXA	-0.02%	-0.02%	-0.20%	-0.48%	-4.86%	-	0.00%	0.03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0.15%	0.15%	0.46%	0.94%	2.53%	8.46%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0.17%	0.17%	0.58%	0.94%	2.21%	7.89%	0.00%	0.00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	-0.28%	-0.28%	-0.02%	0.85%	6.24%	16.68%	0.00%	0.03%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0.25%	0.25%	2.51%	4.30%	4.56%	8.94%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0.00%	0.00%	3.01%	2.00%	6.72%	22.98%	0.01%	0.05%
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

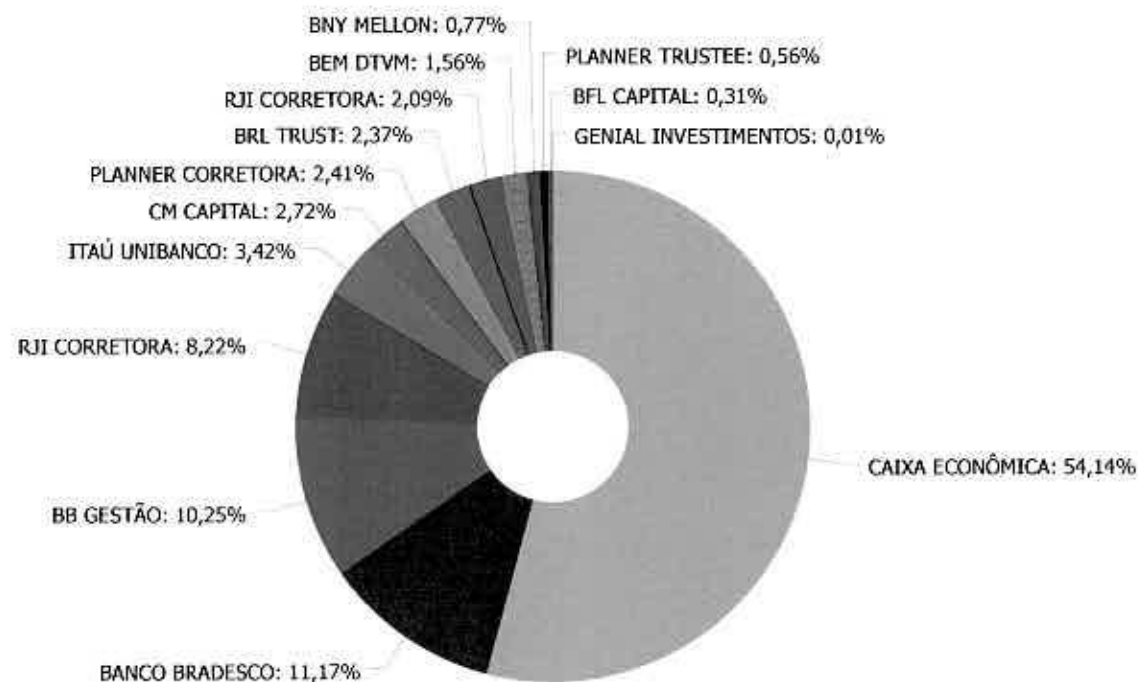
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,05%	1,05%	5,06%	9,60%	15,40%	32,92%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,46%	-0,46%	-3,29%	-	-	-97,02%	-	0,83%
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,86%	0,86%	4,47%	8,36%	12,82%	26,99%	-	-
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	-0,48%	-0,48%	-3,44%	-	-	-	-	0,06%
<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,71%	0,71%	3,99%	7,36%	10,76%	22,35%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,04%	-0,04%	-0,44%	2,62%	-9,22%	-18,20%	0,00%	0,11%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	-2,32%	-2,32%	14,39%	12,59%	-	-2,35%	0,06%	0,27%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	-0,46%	-0,46%	-0,33%	-0,47%	1,99%	383,14%	-	-
SÃO DOMINGOS FII - FID11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,16%	-0,16%	-0,47%	-1,00%	-	-	-	0,00%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,43%	-1,43%	-12,66%	-27,37%	-40,00%	-60,57%	0,07%	0,51%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,28%	-4,28%	21,53%	8,42%	-7,17%	3,04%	0,12%	0,39%



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

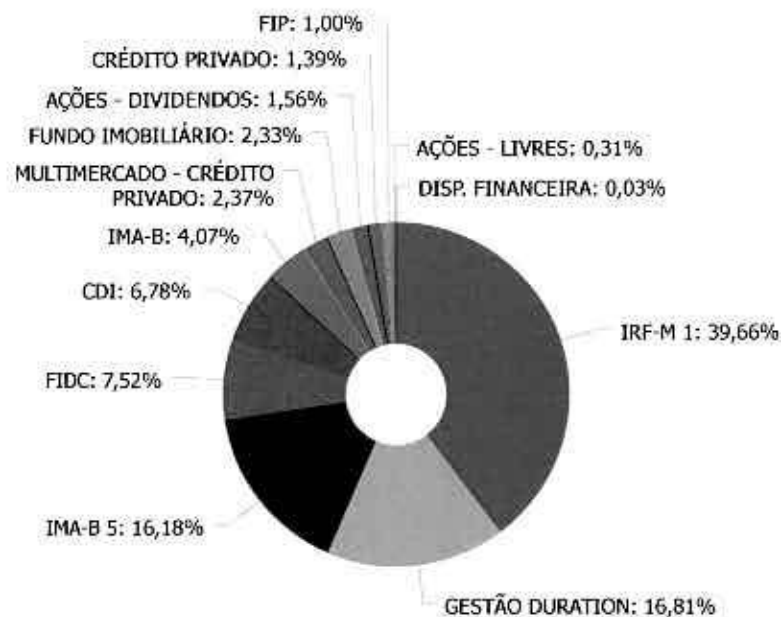
Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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



CAIXA ECONÔMICA	73.114.051,71
BANCO BRADESCO	15.083.705,21
BB GESTÃO	13.843.211,91
RJI CORRETORA	11.096.583,52
ITAÚ UNIBANCO	4.616.678,58
CM CAPITAL	3.677.840,58
PLANNER CORRETORA	3.258.424,35
BRL TRUST	3.205.533,50
RJI CORRETORA	2.825.212,89
BEM DTVM	2.108.318,45
BNY MELLON	1.037.013,44
PLANNER TRUSTEE	759.076,12
BFL CAPITAL	413.557,53
GENIAL INVESTIMENTOS	10.983,52

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

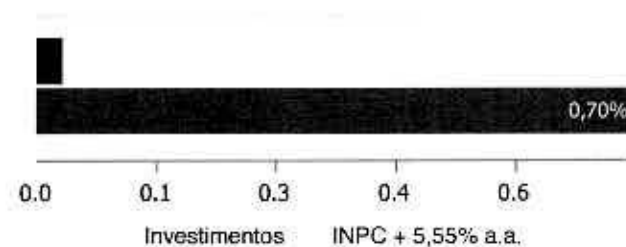


IRF-M 1	53.570.274,73
GESTÃO DURATION	22.712.165,33
IMA-B 5	21.857.703,58
FIDC	10.152.781,95
CDI	9.158.090,88
IMA-B	5.499.694,88
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	3.205.703,92
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.150.260,84
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.108.318,45
CRÉDITO PRIVADO	1.874.840,00
FIP	1.346.799,22
AÇÕES - LIVRES	413.557,53
DISP. FINANCEIRA	37.422,65

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

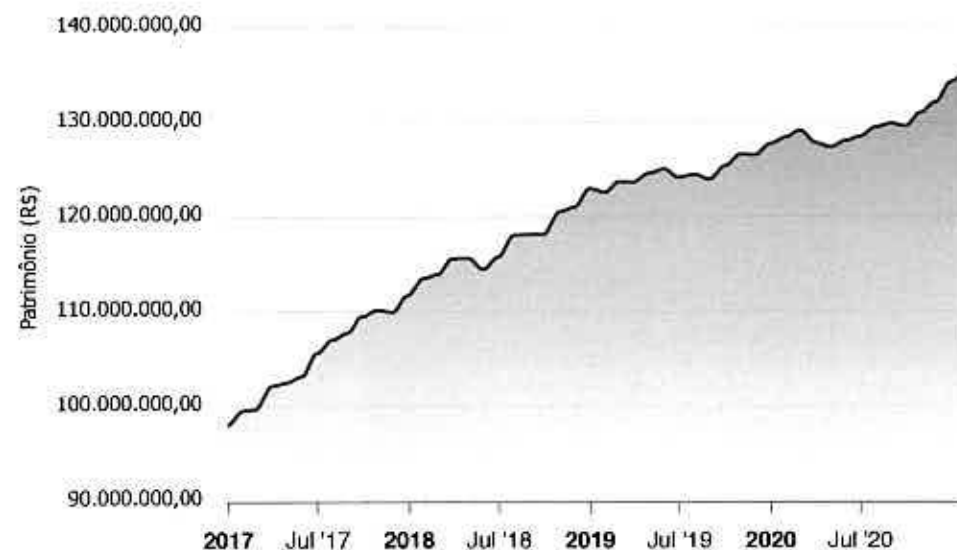
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	134.222.931,22	1.721.250,58	930.000,00	135.050.191,31	36.009,53	36.009,53	0,03%	0,03%	0,70%	0,70%	3,81%	1,21%

## Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

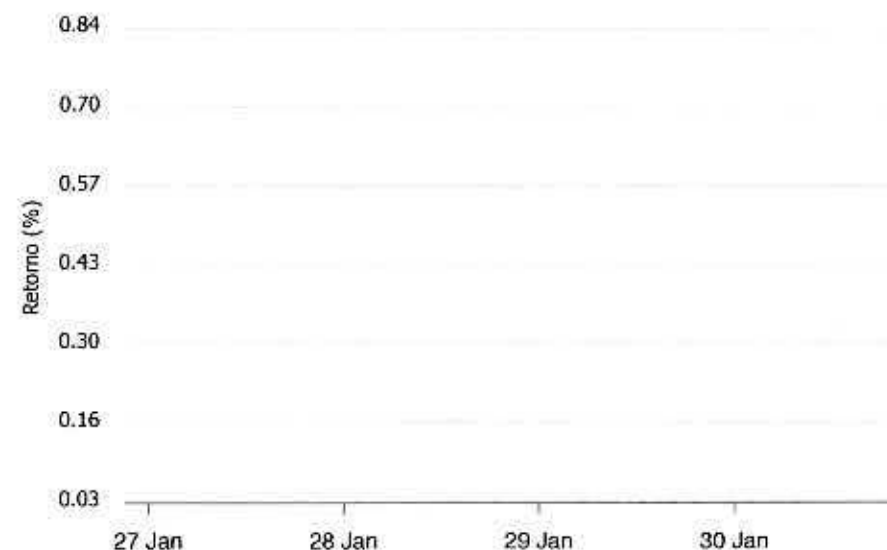
Evolução do Patrimônio



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
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	10.000,94	0,00	0,00	10.983,52	982,58	9,82%	-	-
ILLUMINATI FIDC	3.134.419,33	0,00	0,00	3.258.424,35	124.005,02	3,96%	10,03%	20,76%
SUL BRASIL ABERTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.159.375,25	0,00	0,00	3.165.516,41	6.141,16	0,19%	0,19%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.645.133,61	0,00	0,00	5.654.455,82	9.322,21	0,17%	0,17%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.623.617,39	0,00	0,00	3.628.470,83	4.853,24	0,13%	0,13%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.839.522,20	0,00	0,00	21.857.703,58	18.181,38	0,08%	0,08%	1,04%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	39.988,03	0,00	0,00	40.017,09	29,06	0,07%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.186.184,97	0,00	0,00	8.188.756,09	2.571,12	0,03%	0,03%	0,15%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.079.374,42	0,00	0,00	15.083.705,21	4.330,79	0,03%	0,03%	0,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	29.498.328,00	1.721.250,56	930.000,00	30.297.813,43	8.234,87	0,03%	0,03%	0,15%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.676.896,29	0,00	0,00	3.677.840,58	944,29	0,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	19.078.869,45	0,00	0,00	19.083.694,70	4.825,25	0,03%	0,03%	0,76%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.874.882,00	0,00	0,00	1.874.840,00	-42,00	0,00%	0,00%	1,01%
BARCELONA FI RENDA FIXA	2.516.043,24	0,00	0,00	2.515.427,11	-616,13	-0,02%	-0,02%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	991.015,00	0,00	0,00	988.207,95	-2.807,05	-0,28%	-0,28%	0,32%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.518.905,54	0,00	0,00	5.499.694,88	-19.210,66	-0,35%	-0,34%	1,32%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>123.872.555,66</b>	<b>1.721.250,56</b>	<b>930.000,00</b>	<b>124.825.551,35</b>	<b>161.745,13</b>	<b>0,13%</b>		<b>1,01%</b>

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
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.207.504,01	0,00	0,00	3.205.703,92	-1.800,09	-0,06%	-0,04%	0,20%
SÃO DOMINGOS FII - FID11	1.437.237,29	0,00	0,00	1.436.180,78	-1.056,51	-0,07%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	995.183,37	0,00	0,00	993.612,08	-1.571,29	-0,16%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	43.602,41	0,00	0,00	43.401,36	-201,05	-0,46%	-	-
HAZ FII - ATCR11	959.494,19	0,00	0,00	955.003,94	-4.490,25	-0,47%	-0,46%	-
GESTÃO EMPRESARIAL MULTISTRATÉGIA FIP	311.281,25	0,00	0,00	309.785,78	-1.495,47	-0,48%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	770.062,56	0,00	0,00	759.076,12	-10.986,44	-1,43%	-1,43%	7,37%
ROMA INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	423.379,00	0,00	0,00	413.557,53	-9.821,47	-2,32%	-2,32%	6,40%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.202.631,48	0,00	0,00	2.108.318,45	-94.313,03	-4,28%	-4,28%	11,56%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>10.350.375,56</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>10.224.639,96</b>	<b>-125.735,60</b>	<b>-1,21%</b>		<b>4,20%</b>