




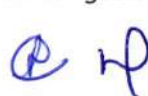



# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021

*mplcalta*  *mano*      

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 (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			273.918.701,98	29,49%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	40.535.976,70	4,36%	706	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	11.100.934,35	1,20%	677	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	15.500.727,11	1,67%	1.211	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	16.696.237,48	1,80%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2022	11.074.012,50	1,19%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	11.081.700,00	1,19%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	183.397.584,28	19,75%	903	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	13.085.570,56	1,41%	1.012	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.465.480,01	1,56%	989	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.386.929,69	0,36%	1.341	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	31.710.797,12	3,41%	484	1,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	435.524,04	0,05%	195	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	3.254.461,18	0,35%	81	3,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.064.303,31	1,84%	114	2,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	13.604.043,87	1,46%	264	0,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	24.955.507,32	2,69%	142	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ...	Não há	9.911.646,81	1,07%	17.284	1,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	67.766,72	0,01%	41	3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	15.883.714,69	1,71%	9.885	2,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

*(Handwritten signatures and initials)*

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	10.859.916,41	1,17%	5.915	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	2.266.427,02	0,24%	35	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	14.148.955,82	1,52%	727	3,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	8.116.198,57	0,87%	6.286	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	7.142.068,90	0,77%	781	6,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	8.048.159,01	0,87%	123	1,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.091.391,66	0,23%	6.474	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	20.585.766,93	2,22%	4.722	6,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	D+32	Não há	6.348.687,85	0,68%	1.166	2,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	12.570.577,19	1,35%	40.797	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	9.984.834,08	1,08%	132	0,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	6.169.029,30	0,66%	39.311	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	21.239.181,65	2,29%	175	6,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	4.804.991,09	0,52%	279	5,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	18.615.538,64	2,00%	3.180	1,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	10.343.669,16	1,11%	96	8,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	8.508.262,94	0,92%	10.642	0,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	7.958.848,19	0,86%	3.427	5,14%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.038.276,50	0,22%	78	2,05%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	1.681.981,81	0,18%	167	4,78%	Artigo 8º, Inciso III

*mpfcolta* *manu* *[assinatura]* *[assinatura]* *[assinatura]* *[assinatura]* *[assinatura]* *[assinatura]* *[assinatura]* *[assinatura]* *[assinatura]*

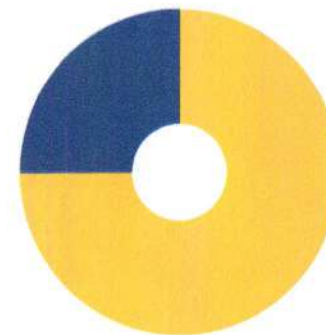
**Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.779.728,12	0,30%	99	0,70%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	10.826.235,69	1,17%	26	4,46%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	3.004.838,44	0,32%		0,12%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	3.771.428,10	0,41%		3,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	13.781.893,74	1,48%		26,95%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.059.609,23	0,11%		0,00%	DF - Artigo 6º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>928.818.506,53</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>1.059.609,23</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>929.878.115,76</b>				

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.

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 ' a '	100,00%	273.918.701,98	29,49%	0,00%	30,80%	35,00%	51.167.775,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	320.325.152,68	34,49%	4,65%	23,28%	40,00%	51.202.249,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	100.936.283,65	10,87%	4,09%	15,43%	40,00%	270.591.118,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	67.766,72	0,01%	0,00%	0,01%	0,01%	25.115,13
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>695.247.905,03</b>	<b>74,85%</b>	<b>8,74%</b>	<b>69,52%</b>	<b>115,01%</b>	

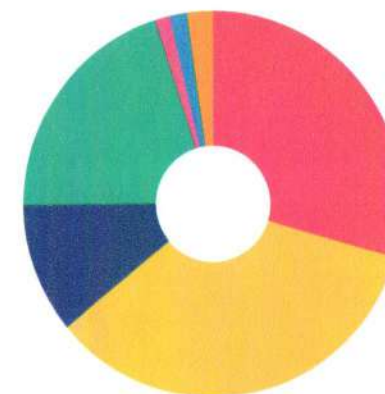


RENDA FIXA 695.247.905,03  
RENDA VARIÁVEL 233.570.601,50

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 II, Alínea 'a'	20,00%	187.727.370,91	20,21%	3,58%	17,91%	20,00%	-1.963.669,60
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.679.106,50	1,26%	3,14%	8,14%	10,00%	81.202.744,15
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	13.605.963,81	1,46%	0,00%	1,24%	5,00%	32.834.961,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	20.558.160,28	2,21%	0,00%	2,34%	5,00%	25.882.765,05
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>233.570.601,50</b>	<b>25,15%</b>	<b>6,72%</b>	<b>29,63%</b>	<b>40,00%</b>	

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%	0,42%	5,00%	46.440.925,33
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,43%	5,00%	46.440.925,33
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,85%</b>	<b>10,00%</b>	



Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom left of the page.

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom center of the page.

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	273.918.701,98	29,49	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	236.491.277,04	25,46	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	131.731.905,08	14,18	-
ITAÚ UNIBANCO	59.392.787,75	6,39	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	36.968.906,31	3,98	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	24.955.507,32	2,69	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	24.125.562,90	2,60	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	22.677.158,59	2,44	-
META ASSET MANAGEMENT	21.239.181,65	2,29	-
OCCAM BRASIL	18.615.538,64	2,00	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	18.037.995,59	1,94	-
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	10.826.235,69	1,17	-
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	9.911.646,81	1,07	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	8.508.262,94	0,92	-
VINCI PARTNERS	8.048.159,01	0,87	-
MULTINVEST CAPITAL	6.486.972,90	0,70	-
ICATU VANGUARDA	6.348.687,85	0,68	-
ZION INVEST	3.771.428,10	0,41	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.254.461,18	0,35	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.004.838,44	0,32	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	435.524,04	0,05	-
PLURAL	67.766,72	0,01	-

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 '	273.918.701,98	29,49	0,00	35,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	320.325.152,68	34,49	4,66	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	91.024.636,84	9,80	4,09	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	67.766,72	0,01	0,00	0,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	187.727.370,91	20,21	17,91	20,00
Artigo 8º, Inciso III	11.679.106,50	1,26	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	13.605.963,81	1,46	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	20.558.160,28	2,21	0,00	5,00
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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,38%	0,81%	1,28%	2,61%	5,90%	15,70%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,17%	9,64%	0,60%	37,88%	109,79%	351,78%	-	1,19%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-2,33%	-3,98%	3,24%	3,38%	0,95%	23,20%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,75%	1,83%	10,22%	4,30%	8,23%	15,25%	1,71%	0,14%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,04%	0,08%	0,39%	0,94%	3,08%	9,80%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,04%	0,35%	0,70%	2,71%	9,12%	0,10%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02%	0,04%	0,33%	0,82%	2,87%	9,36%	0,10%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,60%	-0,49%	1,33%	2,75%	6,23%	19,15%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,62%	-0,52%	1,28%	2,64%	5,94%	18,61%	1,16%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,62%	-0,54%	1,27%	2,60%	5,92%	18,50%	1,17%	0,04%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	-0,78%	-0,85%	1,10%	2,35%	6,00%	18,64%	1,30%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-1,52%	-2,36%	2,38%	3,07%	3,16%	21,74%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,53%	-2,38%	2,34%	2,96%	2,89%	21,16%	2,31%	0,11%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,63%	-2,67%	2,14%	2,52%	3,72%	24,08%	2,38%	0,11%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,86%	1,11%	2,48%	4,95%	5,20%	9,41%	-	-



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	0,28%	1,50%	3,41%	7,19%	21,09%	0,71%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,93%	-1,39%	1,27%	1,32%	-	-	1,29%	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,96%	-1,53%	0,91%	0,42%	2,22%	13,17%	1,16%	0,05%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,51%	-0,48%	0,83%	1,04%	4,64%	19,53%	0,95%	0,03%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,99%	-0,68%	0,99%	4,53%	5,11%	9,80%	4,87%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,53%	-0,39%	1,25%	2,68%	6,48%	17,50%	1,30%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,06%	0,19%	0,40%	0,35%	2,45%	12,28%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,99%	-0,69%	0,97%	4,50%	5,05%	9,73%	4,87%	0,04%

*mpkater*  
*manu*  
*g*  
*h*  
*ru*

*g*  
*h*  
*ru*  
*g*  
*h*  
*ru*

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,42%	2,29%	4,37%	8,93%	13,51%	27,46%	-	-
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	0,04%	-0,22%	-0,40%	-0,94%	-	-	-	0,10%
<b>IBX (Benchmark)</b>	-3,45%	-6,38%	2,19%	11,97%	6,92%	18,84%	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-1,38%	-5,91%	-1,99%	2,52%	-2,13%	7,60%	10,69%	0,38%
META VALOR FI AÇÕES	-4,65%	-10,50%	-3,78%	0,01%	-1,02%	17,21%	10,15%	0,52%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,93%	-6,46%	1,88%	12,02%	1,77%	12,66%	11,84%	0,43%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,40%	-4,98%	2,32%	4,10%	-4,06%	12,03%	11,82%	0,45%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-2,30%	-6,10%	0,59%	6,62%	-4,45%	7,71%	11,06%	0,42%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-2,57%	-6,41%	-0,53%	5,98%	-8,76%	20,18%	10,09%	0,41%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-3,49%	-6,63%	0,55%	0,79%	-12,28%	8,56%	11,48%	0,49%
MULTINVEST FI AÇÕES	-2,64%	-4,75%	2,67%	7,71%	-0,08%	19,45%	10,83%	0,45%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	-3,68%	-5,65%	2,28%	7,86%	5,25%	25,91%	9,96%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,30%	-7,08%	0,32%	0,73%	-20,50%	-4,05%	10,53%	0,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,47%	-1,00%	5,24%	12,85%	4,60%	25,63%	10,10%	0,41%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-1,84%	-5,21%	1,92%	9,84%	2,20%	38,68%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,81%	-1,12%	5,73%	8,73%	-4,31%	38,53%	11,62%	0,48%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	-1,10%	-0,62%	0,79%	0,75%	-	-	1,52%	-
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	0,37%	0,33%	0,93%	-0,81%	-3,51%	4,13%	1,23%	0,02%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	-1,23%	-1,99%	0,12%	-0,31%	-1,72%	6,66%	1,65%	0,08%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	-0,04%	-0,10%	-0,10%	-	-
OCCAM FIC AÇÕES	-3,36%	-6,39%	3,08%	8,40%	10,55%	27,02%	12,80%	0,38%
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	-0,25%	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,53%	-3,13%	1,94%	5,65%	10,28%	37,75%	8,73%	0,42%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-4,15%	-7,59%	-2,05%	2,89%	-3,71%	16,07%	11,50%	0,37%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,39%	-7,39%	1,02%	8,83%	-0,22%	28,90%	10,78%	0,42%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-4,35%	-5,71%	-16,46%	-26,67%	-44,54%	-61,18%	11,93%	0,50%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1,61%	0,00%	1,91%	3,79%	-12,73%	83,15%	-	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,77%	-1,16%	5,69%	8,74%	-5,01%	-	11,67%	0,48%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	-3,82%	-7,56%	-0,21%	5,07%	-10,50%	-	8,10%	0,38%

*Handwritten signature*

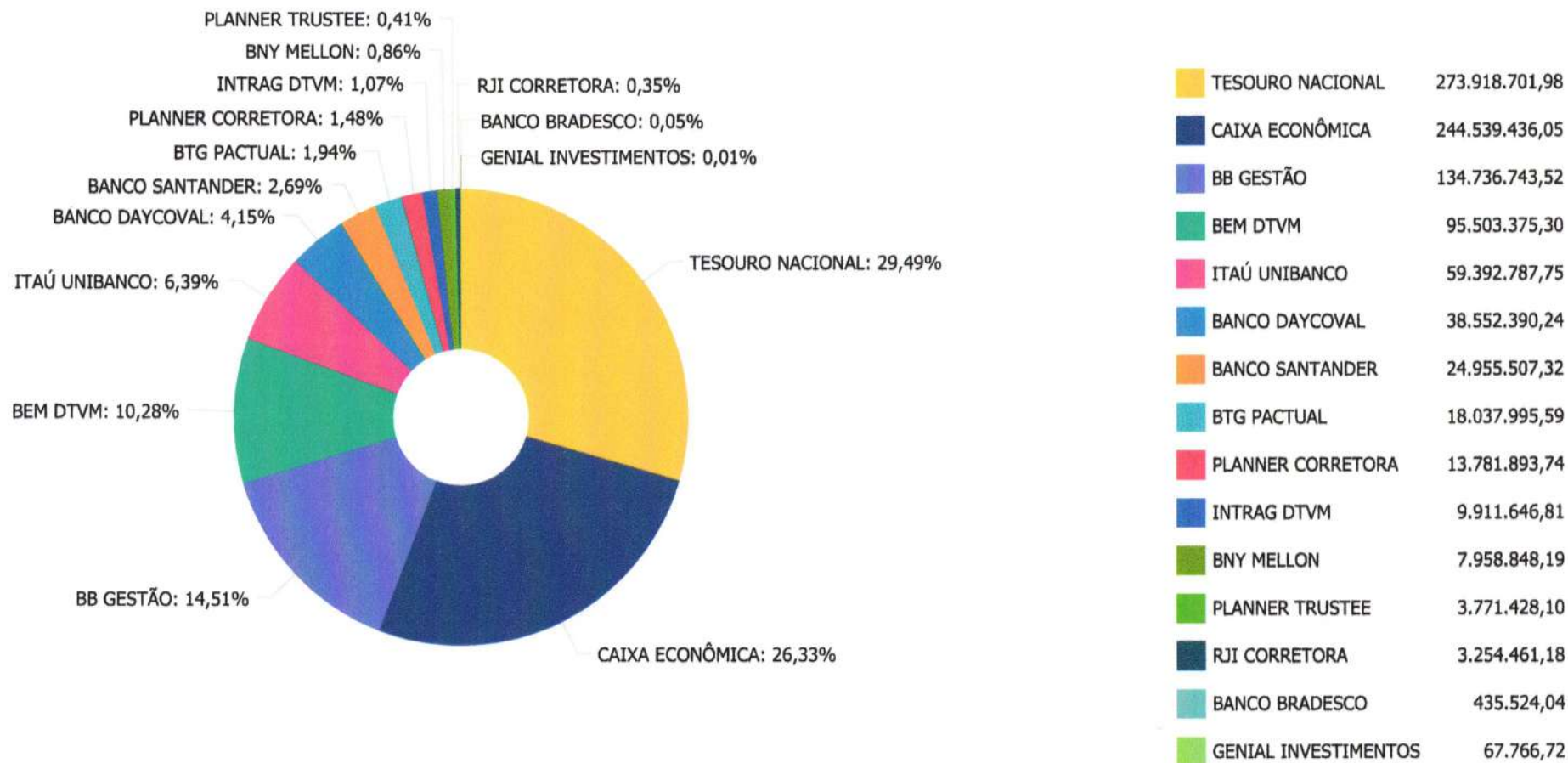
*Handwritten signature*

*Handwritten signature*

*Handwritten signature*

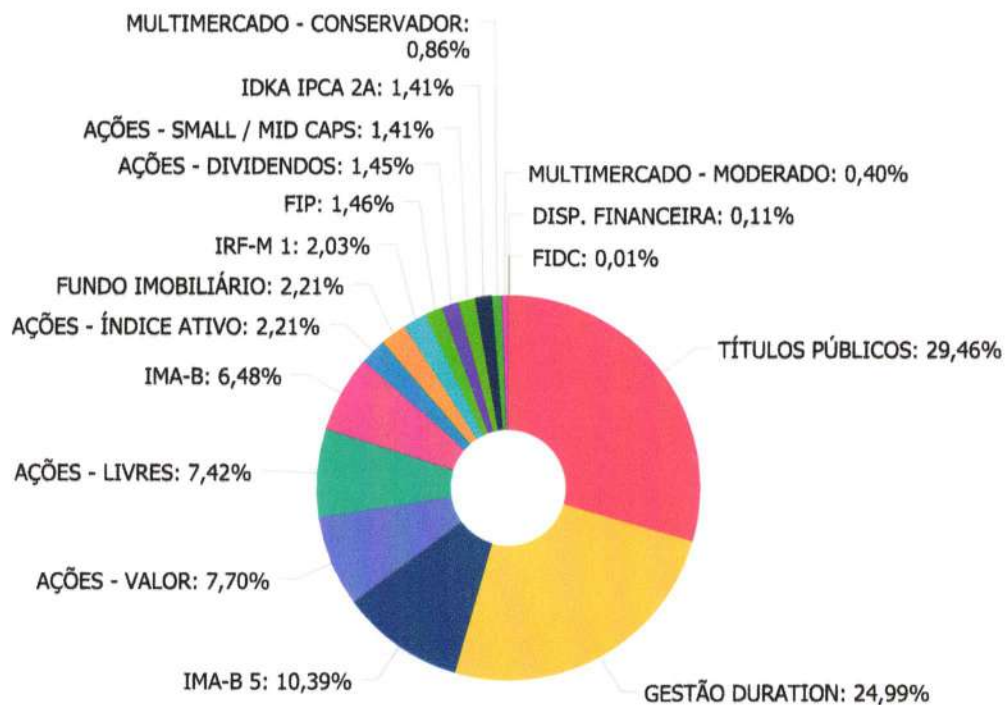
*Handwritten signature*

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



Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.

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



TÍTULOS PÚBLICOS	273.918.701,98
GESTÃO DURATION	232.402.410,49
IMA-B 5	96.653.201,51
AÇÕES - VALOR	71.559.802,49
AÇÕES - LIVRES	68.964.701,31
IMA-B	60.232.596,97
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	20.585.766,93
FUNDO IMOBILIÁRIO	20.558.160,28
IRF-M 1	18.887.656,80
FIP	13.605.963,81
AÇÕES - DIVIDENDOS	13.490.756,75
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	13.126.343,43
IDKA IPCA 2A	13.085.570,56
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	7.958.848,19
MULTIMERCADO - MODERADO	3.720.258,31
DISP. FINANCEIRA	1.059.609,23
FIDC	67.766,72

*[Handwritten signatures]*

*[Handwritten signatures]*

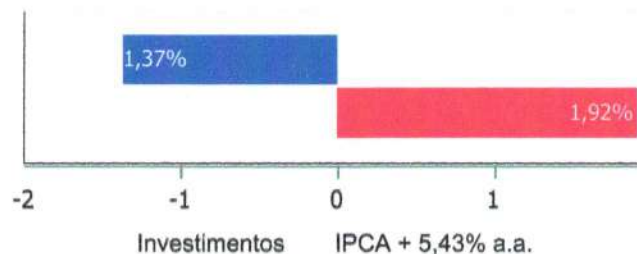
**Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 2021)**

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7.000	3.029,485123	3.588,522674	21.206.395,86	25.119.658,72	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10.000	2.967,972738	3.588,522674	29.679.727,38	35.885.226,74	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10.000	2.980,886631	3.588,522674	29.808.866,31	35.885.226,74	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10.000	2.971,010111	3.588,522674	29.710.101,11	35.885.226,74	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15.000	2.963,303079	3.733,951403	44.449.546,19	56.009.271,05	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13.000	2.979,58205	3.733,951403	38.734.566,65	48.541.368,24	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9.800	2.911,042410	3.733,951403	28.528.215,62	36.592.723,75	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	930.296.012,91	6.594.800,00	2.150.000,00	928.165.411,75	-6.575.401,16	-6.575.401,16	-0,70%	-0,70%	0,67%	0,67%	-104,74%	4,69%
Fevereiro	928.165.411,75	32.146.615,82	25.231.182,31	928.818.508,53	-6.262.338,73	-12.837.739,89	-0,67%	-1,37%	1,24%	1,92%	-71,21%	4,25%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



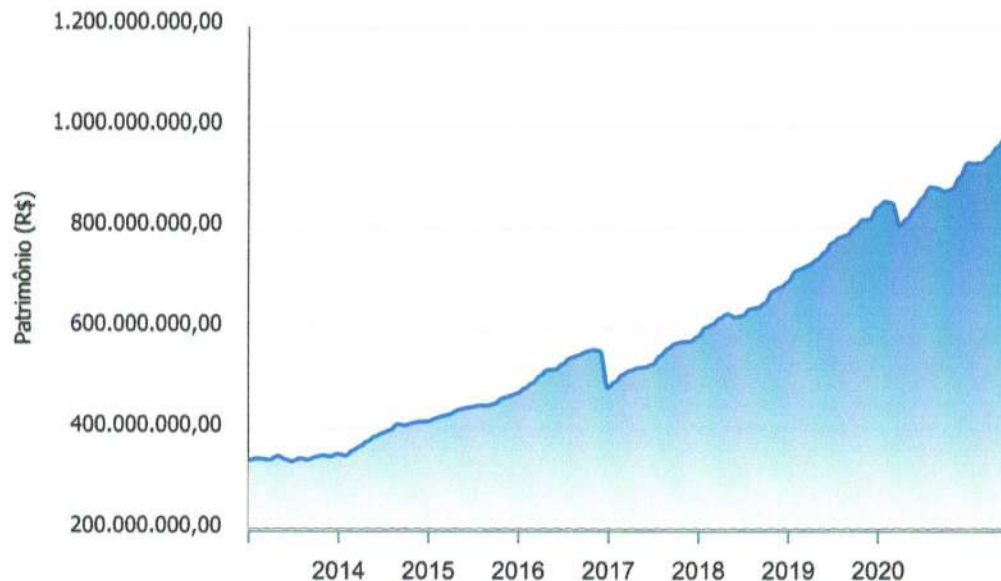
*[Handwritten signatures]*

*[Handwritten signatures]*

*[Handwritten signatures]*

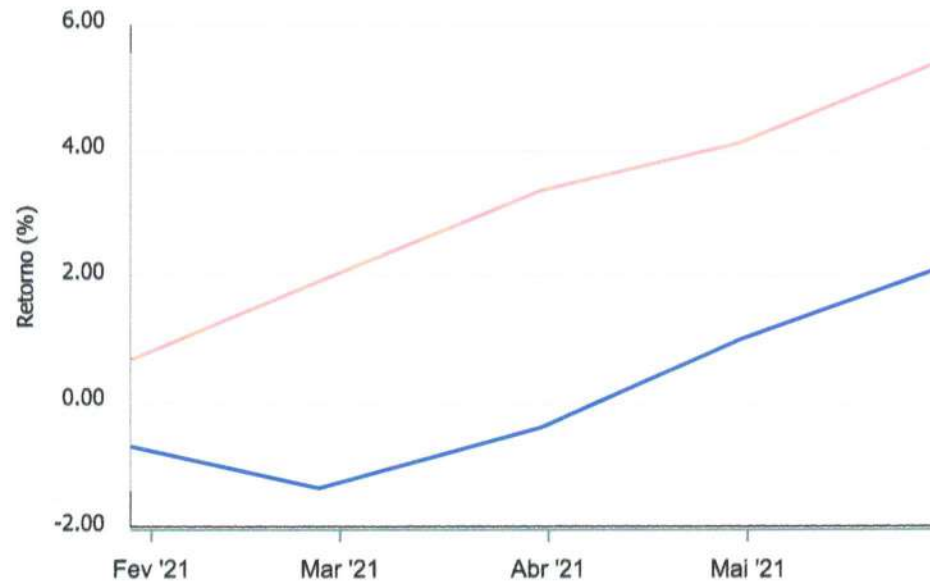
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

*(Assinaturas manuscritas em azul)*



**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	3.198.545,87	0,00	0,00	3.254.461,18	55.915,31	1,75%	1,75%	1,71%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.306.617,50	0,00	312.772,66	11.081.700,00	87.855,16	0,78%	-1,99%	4,87%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.299.267,50	0,00	312.541,50	11.074.012,50	87.286,50	0,77%	-1,99%	4,87%
TÍTULOS PÚBLICOS	276.778.121,21	0,00	3.858.115,82	273.918.701,98	998.696,59	0,36%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	13.595.912,80	0,00	0,00	13.604.043,87	8.131,07	0,06%	0,06%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.694.296,50	0,00	308.112,41	3.386.929,69	745,60	0,02%	0,02%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	15.500.072,75	0,00	0,00	15.500.727,11	654,36	0,00%	0,00%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	17.135.540,86	0,00	439.639,92	16.696.237,48	336,54	0,00%	-0,01%	0,71%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	67.879,21	0,00	0,00	67.766,72	-112,49	-0,17%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	172.232.656,23	12.130.115,82	0,00	183.397.584,28	-965.187,77	-0,52%	-0,51%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.154.742,88	0,00	0,00	13.085.570,56	-69.172,32	-0,53%	-0,53%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	40.786.625,66	0,00	0,00	40.535.976,70	-250.648,96	-0,61%	-0,61%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.555.687,27	0,00	0,00	14.465.480,01	-90.207,26	-0,62%	-0,62%	1,17%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	25.152.477,53	0,00	0,00	24.955.507,32	-196.970,21	-0,78%	-0,78%	1,30%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	439.736,26	0,00	0,00	435.524,04	-4.212,22	-0,96%	-0,96%	1,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	12.052.951,09	20.016.500,00	0,00	31.710.797,12	-358.653,97	-1,12%	-0,93%	1,29%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.273.743,73	0,00	0,00	11.100.934,35	-172.809,38	-1,53%	-1,53%	2,31%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	17.346.830,32	0,00	0,00	17.064.303,31	-282.527,01	-1,63%	-1,63%	2,38%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>659.571.705,17</b>	<b>32.146.615,82</b>	<b>5.231.182,31</b>	<b>685.336.258,22</b>	<b>-1.150.880,46</b>	<b>-0,17%</b>		<b>1,27%</b>

*Handwritten signatures and initials in blue ink.*

*Handwritten signatures and initials in blue ink.*

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 SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10.772.726,61	0,00	0,00	10.859.916,41	87.189,80	0,81%	0,81%	11,62%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.249.049,37	0,00	0,00	2.266.427,02	17.377,65	0,77%	0,77%	11,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	12.511.359,17	0,00	0,00	12.570.577,19	59.218,02	0,47%	0,47%	10,10%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	7.929.187,38	0,00	0,00	7.958.848,19	29.660,81	0,37%	0,37%	1,23%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	34.053.703,56	0,00	20.000.000,00	14.148.955,82	95.252,26	0,28%	-2,93%	11,84%
BTG ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	2.780.110,34	0,00	0,00	2.779.728,12	-382,22	-0,01%	-	-
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	10.839.239,34	0,00	0,00	10.826.235,69	-13.003,65	-0,12%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.012.586,86	0,00	0,00	3.004.838,44	-7.748,42	-0,26%	0,00%	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	13.831.692,85	0,00	0,00	13.781.893,74	-49.799,11	-0,36%	1,60%	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	2.061.033,20	0,00	0,00	2.038.276,50	-22.756,70	-1,10%	-1,10%	1,52%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.702.994,02	0,00	0,00	1.681.981,81	-21.012,21	-1,23%	-1,23%	1,65%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.488.541,10	0,00	0,00	10.343.669,16	-144.871,94	-1,38%	-1,38%	10,69%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	21.069.960,96	0,00	0,00	20.585.766,93	-484.194,03	-2,30%	-2,30%	11,06%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	16.274.375,73	0,00	0,00	15.883.714,69	-390.661,04	-2,40%	-2,40%	11,82%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.326.690,94	0,00	0,00	8.116.198,57	-210.492,37	-2,53%	-2,53%	8,73%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.146.491,96	0,00	0,00	2.091.391,66	-55.100,30	-2,57%	-2,57%	10,09%
MULTINVEST FI AÇÕES	4.935.321,92	0,00	0,00	4.804.991,09	-130.330,83	-2,64%	-2,64%	10,83%
OCCAM FIC AÇÕES	19.263.354,72	0,00	0,00	18.615.538,64	-647.816,08	-3,36%	-3,36%	12,80%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8.815.923,59	0,00	0,00	8.508.262,94	-307.660,65	-3,49%	-3,49%	11,48%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	6.404.905,45	0,00	0,00	6.169.029,30	-235.876,15	-3,68%	-3,68%	9,96%

*[Handwritten signatures and initials in blue ink]*

*[Handwritten signatures and initials in blue ink]*

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
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	6.600.511,91	0,00	0,00	6.348.687,85	-251.824,06	-3,82%	-3,82%	8,10%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	7.451.397,70	0,00	0,00	7.142.068,90	-309.328,80	-4,15%	-4,15%	11,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.433.410,71	0,00	0,00	9.984.834,08	-448.576,63	-4,30%	-4,30%	10,53%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	3.942.856,65	0,00	0,00	3.771.428,10	-171.428,55	-4,35%	-4,35%	11,93%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.417.598,68	0,00	0,00	8.048.159,01	-369.439,67	-4,39%	-4,39%	10,78%
META VALOR FI AÇÕES	22.275.012,56	0,00	0,00	21.239.181,65	-1.035.830,91	-4,65%	-4,65%	10,15%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>258.590.037,28</b>	<b>0,00</b>	<b>20.000.000,00</b>	<b>233.570.601,50</b>	<b>-5.019.435,78</b>	<b>-1,94%</b>		<b>10,41%</b>

Handwritten signatures and initials in blue ink at the bottom of the page.

**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.

**PARECER Nº 001/2021 – COMIN/ANGRAPREV**

Os membros participantes da 2ª Reunião Ordinária de 2021 do Comitê de Investimentos - COMINV do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 16 de março de 2021, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 6º do **DECRETO Nº 8.534 DE 17 DE OUTUBRO DE 2012, APROVAM** o Relatório Mensal de Investimentos referente ao mês de **fevereiro de 2021**.

  
\_\_\_\_\_  
Luciane Pereira Rabha

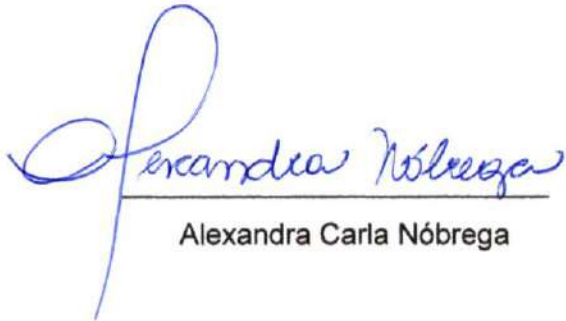
  
\_\_\_\_\_  
Renaldo de Sousa

  
\_\_\_\_\_  
Ednaldo Mascarenhas D. Júnior

  
\_\_\_\_\_  
Jediael Souza Estoduto

**PARECER 02/2021 – CONSELHO FISCAL – CONFIS**

Os membros participantes da 2ª Reunião Ordinária de 2021 do Conselho Fiscal do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 12 de maio de 2021, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Capítulo II, 1.2, Inciso II da Lei Municipal nº 2.074, de 29 de dezembro de 2008, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos, referente ao mês de fevereiro de 2021**, opinam **FAVORAVELMENTE** pela aprovação, submetendo-o assim, à apreciação dos membros conselheiros do Conselho de Administração do ANGRAPREV.



---

Alexandra Carla Nóbrega



---

Luciana Fernandes e Silva



---

Jediael Souza Estoduto



---

Maria Aparecida Lara da Silva




---

Edilson Winckler Moreira

## PARECER Nº 03/2021 – CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO DO ANGRAPREV

Os membros participantes da 2ª Reunião Ordinária de 2021 do Conselho de Administração do Instituto de Previdência de Angra dos Reis - ANGRAPREV, ocorrida em 19 de maio de 2021, no desempenho de suas competências de que trata o artigo 2º do Capítulo II, 1.1, Inciso II da Lei Municipal nº 2.074, de 29 de dezembro de 2008, após examinarem o **Relatório Mensal de Investimentos**, referente ao mês de **fevereiro de 2021**, deliberam por sua **APROVAÇÃO** final.

  
\_\_\_\_\_  
Luciane Pereira Rabha

  
\_\_\_\_\_  
Renaldo de Sousa

  
\_\_\_\_\_  
Ivete Maria Lyra Soares

  
\_\_\_\_\_  
Maria da Conceição Costa Fernandes

  
\_\_\_\_\_  
Charlson Haroldo S. Rodrigues

  
\_\_\_\_\_  
Natália Cristine D. Rodrigues

  
\_\_\_\_\_  
Mauro Ribeiro Garcia