

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2021

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

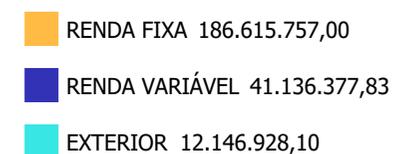
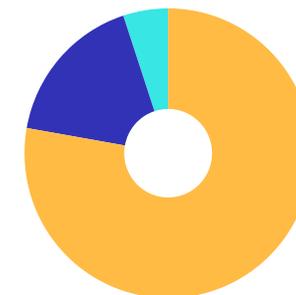
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	1.477.616,99	0,62%	95	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	26.235.107,88	10,94%	903	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	41.392.013,55	17,25%	989	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	874.282,34	0,36%	692	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	29.556.425,56	12,32%	1.012	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	22.631.817,24	9,43%	933	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	16.779.473,00	6,99%	677	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	853.600,80	0,36%	359	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.859.768,89	1,19%	1.211	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.222.220,24	5,51%	121	2,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.255.604,42	1,77%	437	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	845.319,50	0,35%	104	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.400.185,58	1,83%	1.341	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	5.020.760,18	2,09%	264	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	16.211.560,83	6,76%	137	1,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	5.406.371,62	2,25%	1.675	0,47%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.525.703,02	3,14%	4.052	5,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.170.264,54	1,74%	19.147	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.035.845,84	1,27%	40.797	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	10.429.208,19	4,35%	6.286	0,38%	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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.717.332,36	2,38%	5.915	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	D+4	Não há	2.659.836,67	1,11%	926	1,47%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.191.815,59	0,91%	32	0,74%	Artigo 8º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.284.647,90	0,95%	35.466	0,26%	Artigo 9º - A, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	9.862.280,20	4,11%	239	0,41%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>239.899.062,93</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>11.333,05</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>239.910.395,98</b>				

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

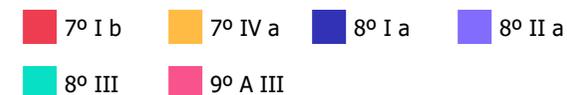
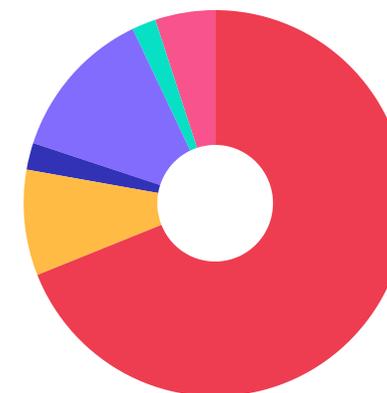
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	165.383.435,99	68,94%	11,52%	57,60%	72,00%	7.343.889,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	21.232.321,01	8,85%	4,07%	20,36%	40,00%	74.727.304,16
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>186.615.757,00</b>	<b>77,79%</b>	<b>15,59%</b>	<b>77,96%</b>	<b>112,00%</b>	



**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%	5.406.371,62	2,25%	0,00%	0,00%	2,14%	-272.531,67
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	30.878.353,95	12,87%	3,65%	18,24%	20,00%	17.101.458,64
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.851.652,26	2,02%	3,09%	3,09%	10,00%	19.138.254,03
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>41.136.377,83</b>	<b>17,15%</b>	<b>6,74%</b>	<b>21,33%</b>	<b>32,14%</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%	0,35%	5,00%	11.994.953,15
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	12.146.928,10	5,06%	0,00%	0,35%	5,00%	-151.974,95
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>12.146.928,10</b>	<b>5,06%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,70%</b>	<b>10,00%</b>	



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

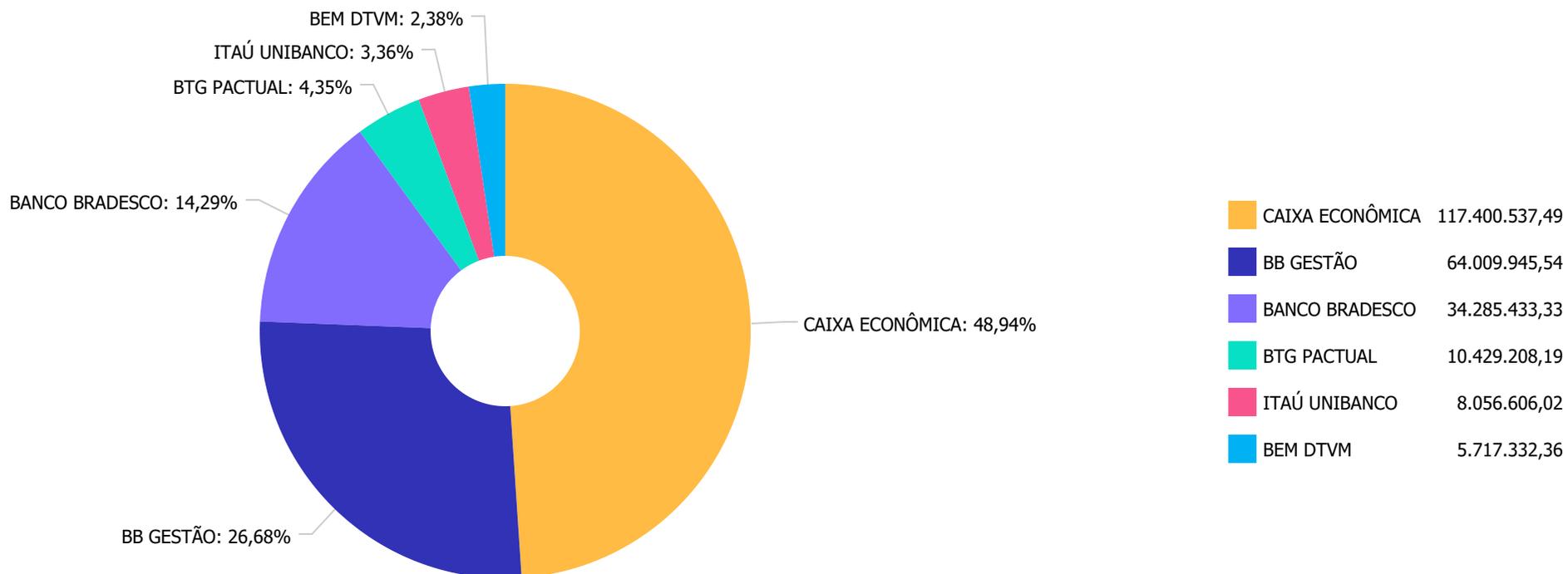
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	117.400.537,49	48,94	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.009.945,54	26,68	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	34.285.433,33	14,29	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	10.429.208,19	4,35	-
ITAÚ UNIBANCO	8.056.606,02	3,36	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.717.332,36	2,38	-

**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)

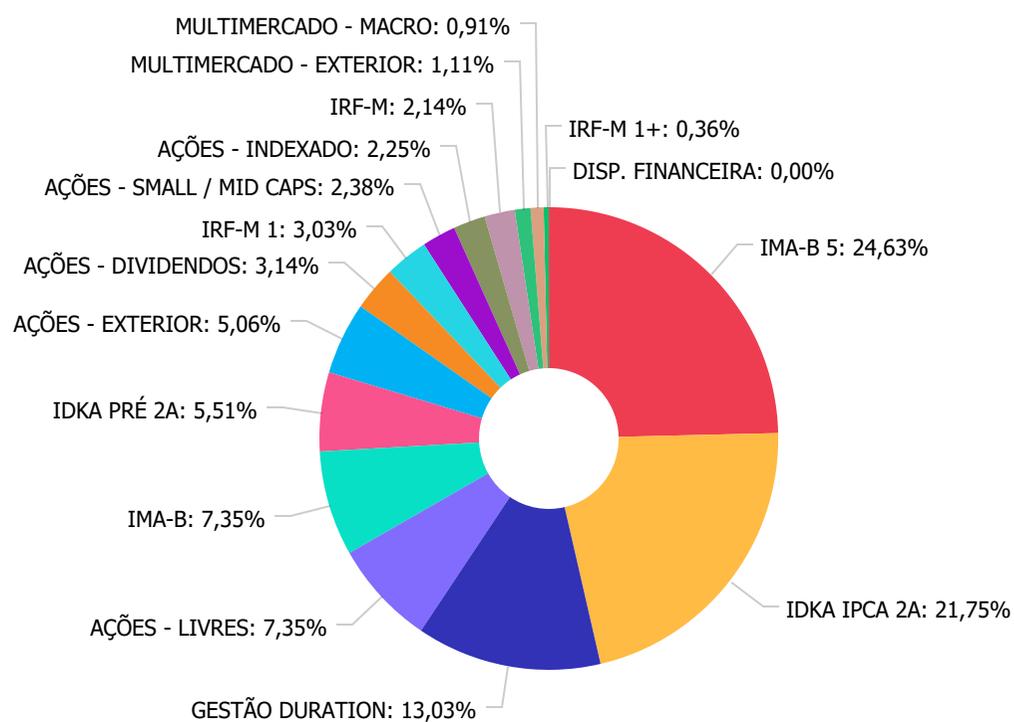
**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	165.383.435,99	68,94	11,52	72,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	21.232.321,01	8,85	4,07	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30.878.353,95	12,87	18,24	20,00
Artigo 8º, Inciso III	4.851.652,26	2,02	3,09	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	12.146.928,10	5,06	0,00	5,00

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



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

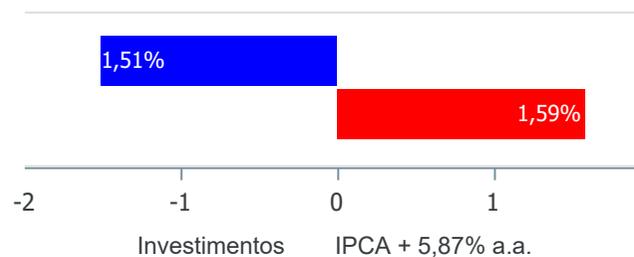


IMA-B 5	59.081.191,37
IDKA IPCA 2A	52.188.242,80
GESTÃO DURATION	31.255.868,06
AÇÕES - LIVRES	17.635.318,57
IMA-B	17.624.792,50
IDKA PRÉ 2A	13.222.220,24
AÇÕES - EXTERIOR	12.146.928,10
AÇÕES - DIVIDENDOS	7.525.703,02
IRF-M 1	7.259.954,47
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	5.717.332,36
AÇÕES - INDEXADO	5.406.371,62
IRF-M	5.129.886,76
MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.659.836,67
MULTIMERCADO - MACRO	2.191.815,59
IRF-M 1+	853.600,80
DISP. FINANCEIRA	11.333,05

**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	240.250.671,65	3.052.815,16	2.170.443,60	239.813.933,54	-1.319.109,67	-1.319.109,67	-0,55%	-0,55%	0,70%	0,70%	-77,61%	3,04%
Fevereiro	239.813.933,54	18.413.678,23	17.960.386,18	237.948.395,70	-2.318.829,89	-3.637.939,56	-0,97%	-1,51%	0,88%	1,59%	-94,70%	3,00%

Investimentos x Meta Atuarial



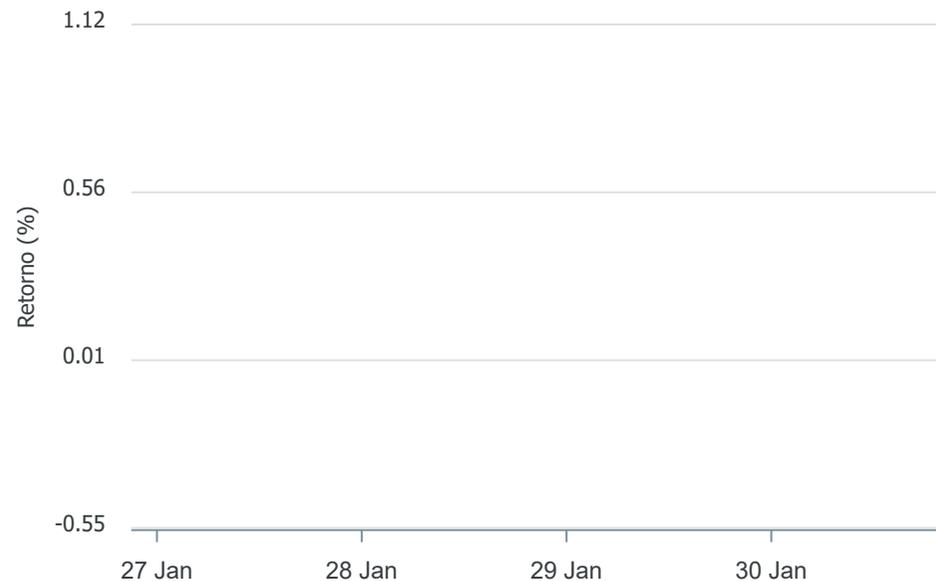
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.017.759,29	0,00	0,00	5.020.760,18	3.000,89	0,06%	0,06%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.399.391,10	0,00	0,00	4.400.185,58	794,48	0,02%	0,02%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.859.461,31	0,00	2.000.000,00	2.859.768,89	307,58	0,01%	0,00%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.516.495,34	0,00	38.908,13	1.477.616,99	29,78	0,00%	-0,01%	0,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	26.368.941,45	0,00	0,00	26.235.107,88	-133.833,57	-0,51%	-0,51%	0,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	29.712.665,32	0,00	0,00	29.556.425,56	-156.239,76	-0,53%	-0,53%	1,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	22.756.577,63	0,00	0,00	22.631.817,24	-124.760,39	-0,55%	-0,55%	1,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.966.885,95	0,00	16.000.000,00	853.600,80	-113.285,15	-0,67%	-1,99%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	34.675.977,52	7.000.000,00	0,00	41.392.013,55	-283.963,97	-0,68%	-0,62%	1,17%
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	16.340.830,77	0,00	0,00	16.211.560,83	-129.269,94	-0,79%	-0,79%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.305.248,35	0,00	0,00	4.255.604,42	-49.643,93	-1,15%	-1,15%	1,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	884.816,80	0,00	0,00	874.282,34	-10.534,46	-1,19%	-1,19%	1,02%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	13.388.229,80	0,00	0,00	13.222.220,24	-166.009,56	-1,24%	-1,24%	1,35%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	879.018,00	0,00	21.478,05	845.319,50	-12.220,45	-1,39%	-3,83%	4,46%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	17.040.680,78	0,00	0,00	16.779.473,00	-261.207,78	-1,53%	-1,53%	2,31%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>199.112.979,41</b>	<b>7.000.000,00</b>	<b>18.060.386,18</b>	<b>186.615.757,00</b>	<b>-1.436.836,23</b>	<b>-0,70%</b>		<b>1,22%</b>

**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
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	2.591.435,85	0,00	0,00	2.659.836,67	68.400,82	2,64%	2,64%	6,68%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.671.430,25	0,00	0,00	5.717.332,36	45.902,11	0,81%	0,81%	11,62%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.021.544,44	0,00	0,00	3.035.845,84	14.301,40	0,47%	0,47%	10,10%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.206.615,17	0,00	0,00	2.191.815,59	-14.799,58	-0,67%	-0,67%	1,11%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.699.688,11	0,00	0,00	10.429.208,19	-270.479,92	-2,53%	-2,53%	8,73%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	5.589.785,45	0,00	0,00	5.406.371,62	-183.413,83	-3,28%	-3,28%	12,62%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	7.893.923,54	0,00	0,00	7.525.703,02	-368.220,52	-4,66%	-4,66%	10,22%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.287.853,04	98.231,02	0,00	4.170.264,54	-215.819,52	-4,92%	-4,85%	13,04%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>41.962.275,85</b>	<b>98.231,02</b>	<b>0,00</b>	<b>41.136.377,83</b>	<b>-924.129,04</b>	<b>-2,20%</b>		<b>9,91%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE MARIANA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 26/02/2021

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

## FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	789.205,83	9.021.478,05	0,00	9.862.280,20	51.596,32	0,53%	3,55%	6,26%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.293.969,16	0,00	2.284.647,90	-9.321,26	-0,41%	0,69%	9,66%
<b>Total Exterior</b>	<b>789.205,83</b>	<b>11.315.447,21</b>	<b>0,00</b>	<b>12.146.928,10</b>	<b>42.275,06</b>	<b>0,35%</b>		<b>6,90%</b>