

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2021

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.802,03	0,01%	1.212	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.890.091,39	6,81%	42	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.199.124,81	4,86%	689	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.003.728,31	8,10%	892	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	458.861,40	0,53%	1.348	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.190.535,22	7,16%	122	1,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.134.161,96	2,47%	591	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.584.699,00	4,15%	977	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	6.079.787,38	7,03%	926	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	1.577.372,55	1,82%	81	1,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.916.001,90	8,00%	114	1,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.386.160,42	2,76%	634	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	32.535,25	0,04%	576	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.605.825,80	4,17%	264	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.144.261,73	4,79%	75	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.401.662,43	5,09%	196	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	D+21	Não há	1.659.334,60	1,92%	1.121	0,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.380.481,79	3,91%	5.098	1,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	D+32	Não há	1.025.497,59	1,19%	1.226	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	2.029.417,22	2,35%	35	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, 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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.102.111,99	3,59%	41.775	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.364.301,27	2,73%	134	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	233.450,69	0,27%	200	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.415.467,67	5,11%	10.322	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.568.710,41	1,81%	98	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	1.632.323,07	1,89%	172	4,33%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.076.449,28	4,72%	18.477	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	788.571,33	0,91%		0,65%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	776.115,42	0,90%	53	0,05%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	787.395,95	0,91%	33.144	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>86.452.239,86</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>29.565,97</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>86.481.805,83</b>				

**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>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	-0,87%	-0,87%	1,55%	0,00%	6,54%	18,79%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,85%	-0,85%	1,58%	-0,12%	6,32%	18,27%	0,02%	0,03%
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	-0,44%	-0,44%	2,38%	0,96%	3,87%	15,36%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,55%	2,68%	0,93%	4,00%	15,84%	0,01%	0,04%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,18%	3,07%	4,24%	7,69%	18,77%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-1,69%	-1,69%	8,43%	2,01%	3,68%	26,83%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	8,38%	3,87%	6,55%	13,83%	0,02%	0,13%
<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%
<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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	0,01%	0,04%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,35%	0,35%	4,13%	4,61%	6,96%	19,20%	0,01%	0,06%

**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>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,88%	-0,88%	5,95%	2,61%	4,93%	23,58%	0,03%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,05%	-1,05%	5,99%	2,22%	6,18%	26,80%	0,03%	0,10%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16%	0,16%	0,68%	0,95%	2,20%	7,87%	0,00%	0,00%
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%	-	-
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%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,58%	-0,58%	2,68%	0,52%	3,61%	14,74%	0,01%	0,04%

**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>Ibovespa (Benchmark)</b>	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-2,64%	-2,64%	14,42%	4,55%	-9,84%	12,05%	0,12%	0,46%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-3,89%	-3,89%	17,38%	2,83%	-10,01%	8,22%	0,10%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-2,91%	-2,91%	19,43%	1,12%	-24,63%	-1,24%	0,13%	0,53%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,48%	-2,48%	13,85%	13,11%	-4,84%	13,16%	0,12%	0,41%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-1,46%	-1,46%	17,60%	12,10%	-6,09%	23,46%	0,11%	0,43%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,09%	-0,09%	4,50%	3,05%	2,72%	17,79%	0,02%	0,08%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	-0,77%	-0,77%	2,43%	-0,19%	-0,26%	9,14%	0,01%	0,08%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-1,43%	-1,43%	-12,66%	-27,37%	-40,00%	-60,57%	0,07%	0,51%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,23%	0,23%	4,92%	2,44%	3,04%	-	0,02%	0,11%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,91%	-1,91%	17,10%	4,52%	-11,40%	-	0,14%	0,48%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS 30 FI AÇÕES	-3,90%	-3,90%	17,77%	4,34%	-13,47%	-	0,10%	0,39%