

# **RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS**

## **FEVEREIRO 2021**



### **TIJUCAS DO SUL PREV**

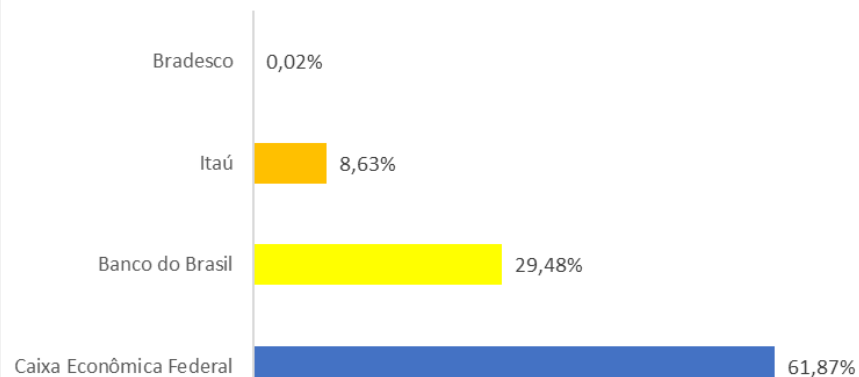
Instituto de Previdência  
dos Servidores Públicos do  
Município de Tijucas do Sul

**Instituto de Previdência dos Servidores Públicos do Município de Tijucas do Sul – PR**

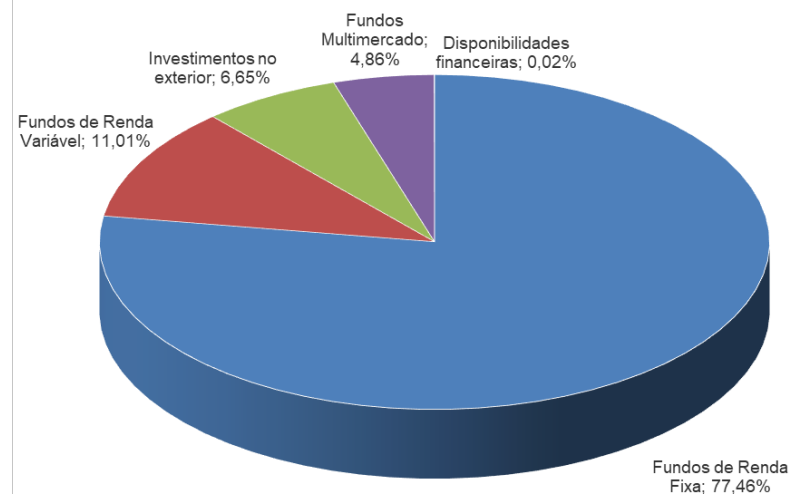
## DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS		
ATIVOS	%	FEVEREIRO
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>	<b>77,46%</b>	<b>R\$ 20.452.048,46</b>
BB Previdenciário IMA-B Títulos Públicos	0,46%	R\$ 121.187,00
BB Previdenciário Renda Fixa IMAB 5	5,38%	R\$ 1.421.636,66
BB Previdenciário Renda Fixa IDKA 2	6,02%	R\$ 1.588.490,68
BB Previdenciário Renda Fixa IRF-M	3,29%	R\$ 867.638,14
BB Previdenciário RF Alocação Ativa	6,36%	R\$ 1.678.318,02
BB Previdenciário RF IRFM 1 Títulos Públicos	0,88%	R\$ 231.108,41
Caixa FI Brasil IRFM-1 Títulos Públicos	13,85%	R\$ 3.655.592,41
Caixa FI Brasil IMA-B Títulos Públicos	3,93%	R\$ 1.036.816,88
Caixa FI Brasil IMAB 5 Títulos Públicos	3,59%	R\$ 948.525,47
Caixa FI Brasil IMA Geral Títulos Públicos	2,59%	R\$ 683.411,29
Caixa Brasil IMA-B 5+ Títulos Públicos	2,56%	R\$ 675.378,83
Caixa Brasil IRF M1+ Títulos Públicos	2,61%	R\$ 689.501,69
Caixa FI Brasil IDKA IPCA 2A Títulos Públicos	5,63%	R\$ 1.486.794,15
Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF	10,38%	R\$ 2.741.612,92
BB Previdenciário RF Ref. DI LP Perfil	0,03%	R\$ 7.999,45
BB Previdenciário RF Fluxo FIC FI	0,31%	R\$ 80.627,41
BB Previd. RF Alocação Ativa Retorno Total	1,70%	R\$ 449.675,17
Caixa FI Aliança Títulos Públicos RF	2,75%	R\$ 726.415,42
Caixa FIC RF Ativa LP	1,59%	R\$ 420.999,41
Itaú Institucional Alocação Dinâmica	2,98%	R\$ 787.167,92
Itaú Global Dinâmico	0,58%	R\$ 153.151,13
<b>FUNDOS MULTIMERCADO</b>	<b>4,86%</b>	<b>R\$ 1.282.887,04</b>
Caixa FIC Alocação Macro Multimercado LP	3,03%	R\$ 799.486,88
Itaú Private Multimercado S&P500	1,83%	R\$ 483.400,16
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>11,01%</b>	<b>R\$ 2.906.675,51</b>
BB Ações Valor	2,62%	R\$ 691.581,40
BB Ações Construção Civil	1,49%	R\$ 394.590,84
BB Ações Retorno Total	0,30%	R\$ 80.057,53
BB Ações Quantitativo	0,32%	R\$ 84.755,57
BB Ações Infraestrutura	0,33%	R\$ 86.617,71
Caixa FI Ações Consumo	2,32%	R\$ 613.158,55
Caixa FI Ações Dividendos	0,38%	R\$ 101.056,57
Itaú Ações Small Caps	2,05%	R\$ 540.543,92
Itaú Institucional FOF Genesis	1,19%	R\$ 314.313,42
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>6,65%</b>	<b>R\$ 1.755.363,77</b>
Caixa BDR Nível I	6,65%	R\$ 1.755.363,77
<b>DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS</b>	<b>0,02%</b>	<b>R\$ 4.782,83</b>
Ag. 6105, CC 2496-1, Banco Bradesco	0,02%	R\$ 4.782,83
<b>TOTAL DA CARTEIRA</b>		<b>R\$ 26.401.757,61</b>

Distribuição por instituição financeira



Por segmento



## RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO (EM REAIS)

RESULTADO POR ATIVO EM REAIS - 2021	Janeiro	Fevereiro	Março	Abril	Mai	Junho	2021,00
<b>FUNDOS DE RENDA FIXA</b>	<b>(45169,01)</b>	<b>(132617,89)</b>					<b>(177786,90)</b>
BB Previdenciário RF IMAB-5	1378,35	(8790,50)					(7412,15)
BB Previdenciário Perfil FIC FI	141,18	22,20					163,38
BB Previdenciário IRFM 1	72,56	9,75					82,31
BB Previdenciário RF Fluxo	225,98	69,66					295,64
BB Previdenciário Renda Fixa IDKA 2 TP	2942,33	(8752,17)					(5809,84)
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B	(1072,32)	(1886,53)					(2958,85)
BB Previdenciário Títulos Públicos IRF-M	(7070,40)	(10454,40)					(17524,80)
BB Previdenciário RF Alocação Ativa FIC	(9407,75)	(15480,24)					(24887,99)
BB Previdenciário RF Retorno Total	(2125,78)	(4213,54)					(6339,32)
Caixa Aliança Títulos Públicos RF	1074,00	419,86					1493,86
Caixa Brasil Títulos Públicos IRFM1	921,52	660,05					1581,57
Caixa Brasil IMA-B5 Títulos Públicos RF LP	793,90	(5915,03)					(5121,13)
Caixa Brasil Títulos Públicos IDKA 2 IPCA	1994,43	(7859,42)					(5864,99)
Caixa Brasil Gestão Estratégica	696,72	(13985,82)					(13289,10)
Caixa Brasil RF Ativa LP	291,39	(2212,60)					(1921,21)
Caixa Brasil Títulos Públicos IMAB	(9268,48)	(16222,56)					(25491,04)
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA Geral	(3163,56)	(5720,92)					(8884,48)
Caixa Brasil IMAB 5+ Títulos Públicos RF LP	(11936,14)	(16248,89)					(28185,03)
Caixa Brasil IRFM1+ Títulos Públicos RF	(12306,83)	(16211,65)					(28518,48)
Itaú Institucional Alocação Dinâmica RF FIC	827,22	386,05					1213,27
Itaú Institucional Global Dinâmico RF	(177,33)	(231,19)					(408,52)
<b>MULTIMERCADO</b>	<b>(6444,24)</b>	<b>4193,64</b>					<b>(2250,60)</b>
Caixa Alocação Macro Multimercado LP	(710,80)	(4598,40)					(5309,20)
Itaú Private Multimercado SP500 BRL FIC FI	(5733,44)	8792,04					3058,60
BB Multimercado Juros e Moedas							0,00
<b>FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL</b>	<b>(121020,32)</b>	<b>(140750,64)</b>					<b>(261770,96)</b>
BB Ações Construção Civil	(29187,43)	(44618,06)					(73805,49)
BB Ações Valor	(43568,00)	(35526,66)					(79094,66)
BB Ações Retorno Total	(4253,87)	(1096,79)					(5350,66)
BB Ações Quantitativo	(4460,17)	(3284,26)					(7744,43)
BB Ações Infraestrutura	(4627,63)	(1254,66)					(5882,29)
Caixa Ações Consumo	(9451,89)	(34451,33)					(43903,22)
Caixa Ações Dividendos	(7110,66)	(6639,68)					(13750,34)
Itaú Ações Small Caps Valuation	(12978,68)	(3617,34)					(16596,02)
Itaú Institucional Genesis	(5381,99)	(10261,86)					(15643,85)
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>	<b>87438,43</b>	<b>58163,46</b>					<b>145601,89</b>
Caixa FIA Institucional BDR Nível I	87438,43	58163,46					145601,89
<b>TOTAL</b>	<b>(85195,14)</b>	<b>(211011,43)</b>					<b>(296206,57)</b>

## RENTABILIDADE DA CARTEIRA (%)

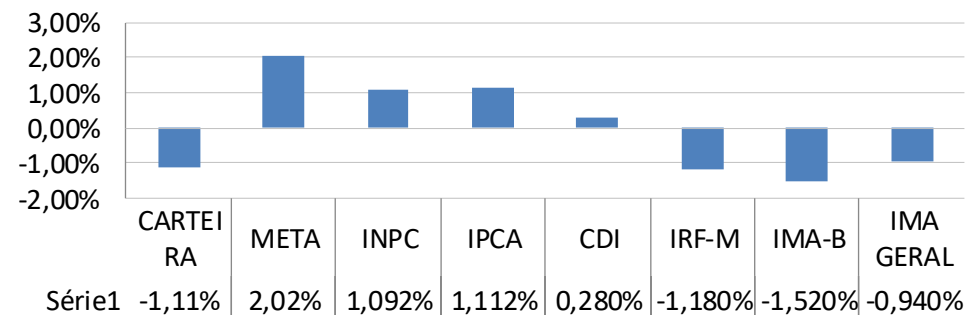
2021	CARTEIRA	META	CDI	IMA GERAL	% Meta	%CDI	% IMA GERAL
JAN	-0,32%	0,70%	0,15%	-0,24%	-45,44%	-213,33%	130,83%
FEV	-0,79%	1,31%	0,13%	-0,69%	-60,11%	-607,69%	114,30%
MAR							
ABR							
MAI							
JUN							
JUL							
AGOS							
SET							
OUT							
NOV							
DEZ							

TOTAL	-1,11%	2,02%	0,28%	-0,94%	-54,99%	-396,43%	118,62%
-------	--------	-------	-------	--------	---------	----------	---------

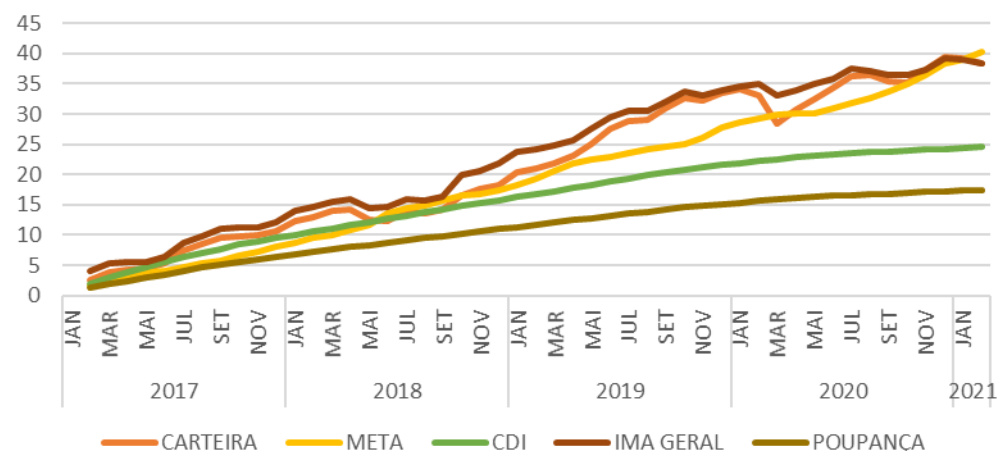
ANO	CARTEIRA	META	CDI	IMA GERAL	% Meta	%CDI	% IMA GERAL
2021	-1,11%	2,02%	0,28%	-0,94%	-55%	-396%	118,62%
2020	6,00%	10,47%	2,73%	5,28%	57%	220%	113,64%
2019	15,24%	10,40%	5,80%	12,16%	147%	263%	125,33%
2018	7,50%	9,43%	6,25%	9,68%	80%	120%	77,48%
2017	10,72%	8,07%	9,51%	12,16%	133%	113%	88,16%

TOTAL	38,35%	40,39%	24,57%	38,34%	94,95%	156,08%	105,34%
-------	--------	--------	--------	--------	--------	---------	---------

### Carteira x indicadores em 2021



### Rentabilidade acumulada desde janeiro/2017



## ENQUADRAMENTO EM RELAÇÃO À RESOLUÇÃO 3.922/2010 E À POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2021

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS		
ATIVOS	%	RESOLUÇÃO 3922
BB Previdenciário IMA-B Títulos Públicos	0,46%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB Previdenciário Renda Fixa IMAB 5	5,38%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB Previdenciário Renda Fixa IDKA 2	6,02%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB Previdenciário Renda Fixa IRF-M	3,29%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB Previdenciário RF Alocação Ativa	6,36%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB Previdenciário RF IRFM 1 Títulos Públicos	0,88%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa FI Brasil IRFM-1 Títulos Públicos	13,85%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa FI Brasil IMA-B Títulos Públicos	3,93%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa FI Brasil IMAB 5 Títulos Públicos	3,59%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa FI Brasil IMA Geral Títulos Públicos	2,59%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa Brasil IMA-B 5+ Títulos Públicos	2,56%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa Brasil IRF M1+ Títulos Públicos	2,61%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa FI Brasil IDKA IPCA 2A Títulos Públicos	5,63%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica RF	10,38%	Art. 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB Previdenciário RF Ref. DI LP Perfil	0,03%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB Previdenciário RF Fluxo FIC FI	0,31%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB Previdenciário RF Alocação Ativa Retorno Total	1,70%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
Caixa FI Aliança Títulos Públicos RF	2,75%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
Caixa FIC RF Ativa LP	1,59%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
Itaú Institucional Alocação Dinâmica	2,98%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
Itaú Global Dinâmico	0,58%	Art. 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
Caixa FIC Alocação Macro Multimercado LP	3,03%	Art. 8º, Inciso III
Itaú Private Multimercado S&P500	1,83%	Art. 8º, Inciso III
BB Ações Valor	2,62%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
BB Ações Construção Civil	1,49%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
BB Ações Retorno Total	0,30%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
BB Ações Quantitativo	0,32%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
BB Ações Infraestrutura	0,33%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
Caixa FI Ações Consumo	2,32%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
Caixa FI Ações Dividendos	0,38%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
Itaú Ações Small Caps	2,05%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
Itaú Institucional FOF Genesis	1,19%	Art. 8º, Inciso II, Alínea "a"
Caixa BDR Nível I	6,65%	Art. 9º, Inciso III

POR SEGMENTO				Estratégia de Alocação 2021		
Artigo	% Limite Resolução	Total R\$	% Carteira	Inferior	Alvo	Superior
Art. 7º, I, b	100%	R\$ 17.826.012,55	67,52%	0%	59,50%	100%
Art. 7º, IV, a	40%	R\$ 2.626.035,91	9,95%	0%	14,00%	40%
Art. 8º, II, a	20%	R\$ 2.906.675,51	11,01%	0%	13,00%	20%
Art. 8º, III	10%	R\$ 1.282.887,04	4,86%	0%	5,00%	10%
Art. 9º, a, II	10%	R\$ -	0,00%	0%	2,00%	10%
Art. 9º, a, III	10%	R\$ 1.755.363,77	6,65%	0%	6,50%	10%