

CRÉDITO e MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2021

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 (Junho / 2021)

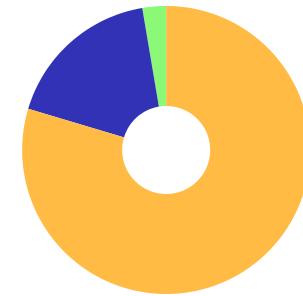
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.061.070,70	1,46%	595	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.446.004,76	17,16%	992	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	643.985,48	0,89%	1.169	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.202.320,49	9,93%	974	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.061.745,42	16,63%	1.044	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.182.561,02	8,52%	1.309	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.004.149,75	1,38%	659	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.138.738,38	2,95%	196	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.519.834,61	8,99%	302	1,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.287.034,49	7,29%	483	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	179.100,89	0,25%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	215.786,07	0,30%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	Não há	940.746,12	1,30%		5,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.157.537,54	1,60%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	716.696,38	0,99%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	401.228,37	0,55%	986	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.745.075,50	2,41%	112	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.217.337,96	3,06%	15.652	1,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.213.646,27	3,05%	18	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.109.023,76	1,53%	16.692	0,03%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	18.429,39	0,03%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	1.161.351,99	1,60%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.487.701,04	3,43%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	418.064,49	0,58%		0,29%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.079.849,34	1,49%		1,48%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	959.963,14	1,32%	23.721	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	971.095,54	1,34%	427	0,03%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução				72.540.078,89			

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	39.597.687,87	54,59%	9,80%	52,10%	80,00%	18.434.375,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.254.007,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	15.344.644,19	21,15%	3,56%	17,50%	40,00%	13.671.387,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2.814.980,04	3,88%	0,00%	5,00%	5,00%	812.023,90
Total Renda Fixa	100,00%	57.757.312,10	79,62%	13,36%	74,60%	135,00%	

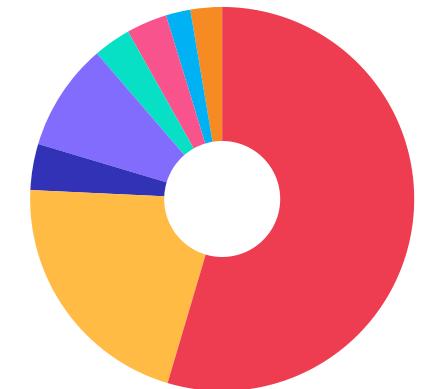


- █ RENDA FIXA 57.757.312,10
- █ RENDA VARIÁVEL 12.851.708,11
- █ EXTERIOR 1.931.058,68

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.254.007,89
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	6.577.288,10	9,07%	1,00%	14,00%	20,00%	7.930.727,68
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.288.805,14	3,16%	3,00%	5,00%	10,00%	4.965.202,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	2.487.701,04	3,43%	0,00%	3,70%	5,00%	1.139.302,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.497.913,83	2,06%	0,00%	2,25%	5,00%	2.129.090,11
Total Renda Variável	30,00%	12.851.708,11	17,72%	4,00%	24,95%	50,00%	

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%	0,20%	5,00%	3.627.003,94
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.931.058,68	2,66%	0,00%	0,25%	5,00%	1.695.945,26
Total Exterior	10,00%	1.931.058,68	2,66%	0,00%	0,45%	10,00%	



■ 7º I b	■ 7º IV a	■ 7º VII a	■ 8º II a
■ 8º III	■ 8º IV a	■ 8º IV b	■ 9º A III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	41.078.690,83	56,63	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.516.402,20	22,77	0,00
TRÍGONO CAPITAL	4.430.984,23	6,11	0,17
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.913.258,77	5,39	3,77
KPTL	2.487.701,04	3,43	0,47
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.138.738,38	2,95	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.161.351,99	1,60	0,12
ZION INVEST	418.064,49	0,58	0,05
PLURAL	215.786,07	0,30	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	179.100,89	0,25	0,00

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 '	39.597.687,87	54,59	9,80	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	15.344.644,19	21,15	3,56	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	2.814.980,04	3,88	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	6.577.288,10	9,07	14,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.288.805,14	3,16	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	2.487.701,04	3,43	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.497.913,83	2,06	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.931.058,68	2,66	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,18%	7,74%	3,62%	7,74%	16,98%	29,07%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-	-	-	-	-	-	-	-

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,32%	1,87%	1,91%	1,87%	7,06%	16,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,28%	1,56%	1,59%	1,56%	6,40%	15,12%	1,53%	0,02%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,10%	7,25%	3,39%	7,25%	15,90%	26,69%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,03%	-0,34%	-0,42%	-0,34%	-9,20%	-26,03%	0,09%	0,06%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,12%	-2,10%	0,50%	-2,10%	-3,88%	-7,96%	-	0,04%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,21%	0,81%	0,68%	0,81%	2,04%	8,17%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,66%	0,60%	0,66%	1,65%	7,46%	0,16%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	0,70%	0,64%	0,70%	1,82%	7,71%	0,16%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,45%	-0,75%	-0,10%	-0,75%	-23,82%	-36,67%	0,72%	0,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,15%	-23,56%	-16,90%	-23,56%	-66,87%	-75,85%	0,21%	0,54%

CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,33%	1,32%	0,82%	1,32%	2,35%	6,51%	0,02%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	1,16%	0,72%	1,16%	1,78%	6,51%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,33%	-0,80%	1,29%	-0,80%	2,01%	8,38%	1,16%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00%	0,72%	0,90%	0,72%	2,68%	12,77%	0,97%	0,02%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,24%	0,86%	0,57%	0,86%	1,41%	5,20%	0,01%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	1,42%	1,42%	1,42%	6,38%	15,08%	1,36%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,68%	1,22%	-0,68%	2,58%	9,05%	1,23%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,37%	8,95%	4,21%	8,95%	19,68%	35,11%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,12%	2,59%	-1,65%	2,59%	1,65%	-	-	-
IDIV (Benchmark)	-2,17%	2,06%	5,45%	2,06%	23,79%	23,60%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	6,00%	53,12%	27,13%	53,12%	106,28%	146,85%	8,94%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,73%	54,50%	30,58%	54,50%	89,65%	-	8,75%	0,21%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,17%	3,12%	2,40%	3,12%	7,86%	14,62%	1,32%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,16%	2,58%	0,26%	2,58%	5,12%	-8,88%	0,49%	0,03%
IFIX (Benchmark)	-2,19%	-4,02%	-3,23%	-4,02%	-1,83%	4,90%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,53%	15,71%	50,00%	15,71%	14,09%	-54,75%	30,23%	0,61%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,97%	6,89%	9,62%	6,89%	33,04%	21,41%	4,74%	0,21%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,87%	19,92%	15,78%	19,92%	42,88%	-	6,80%	0,19%
HAZ FII - ATCR11	1,40%	1,06%	1,29%	1,06%	1,09%	390,54%	-	-

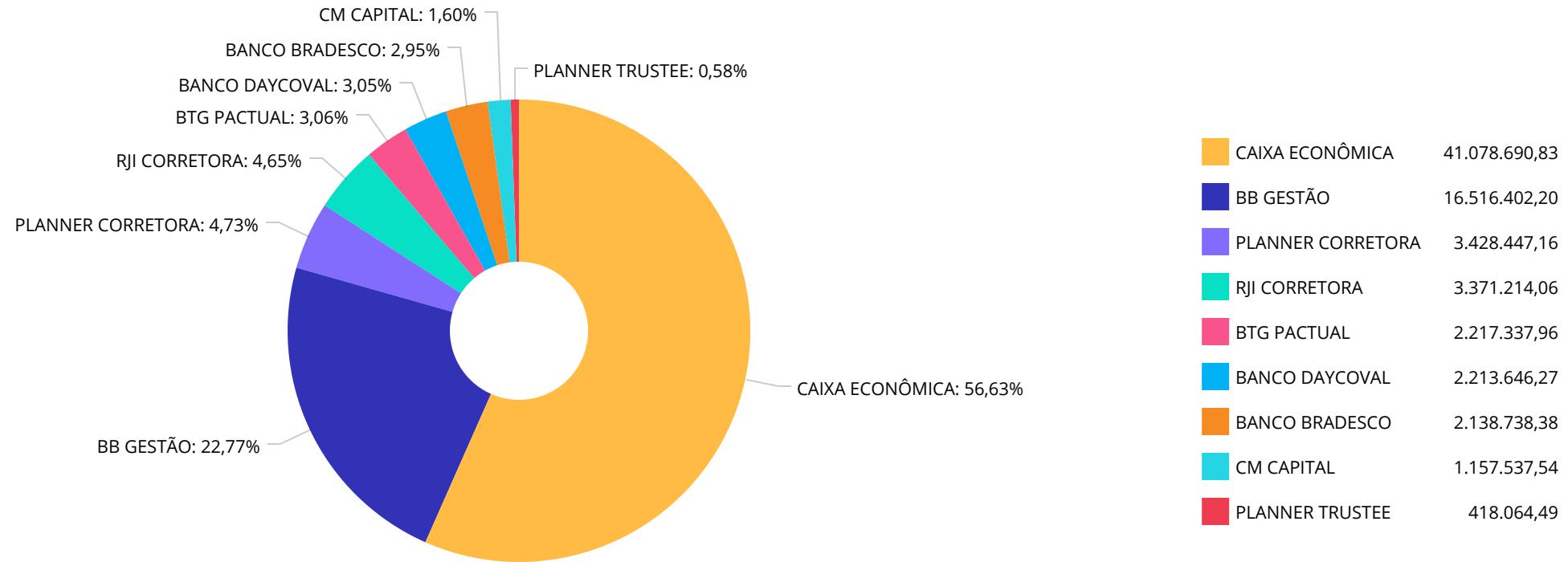
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,40%	-2,40%	-1,19%	-2,40%	-4,73%	-3,80%	0,00%	0,00%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

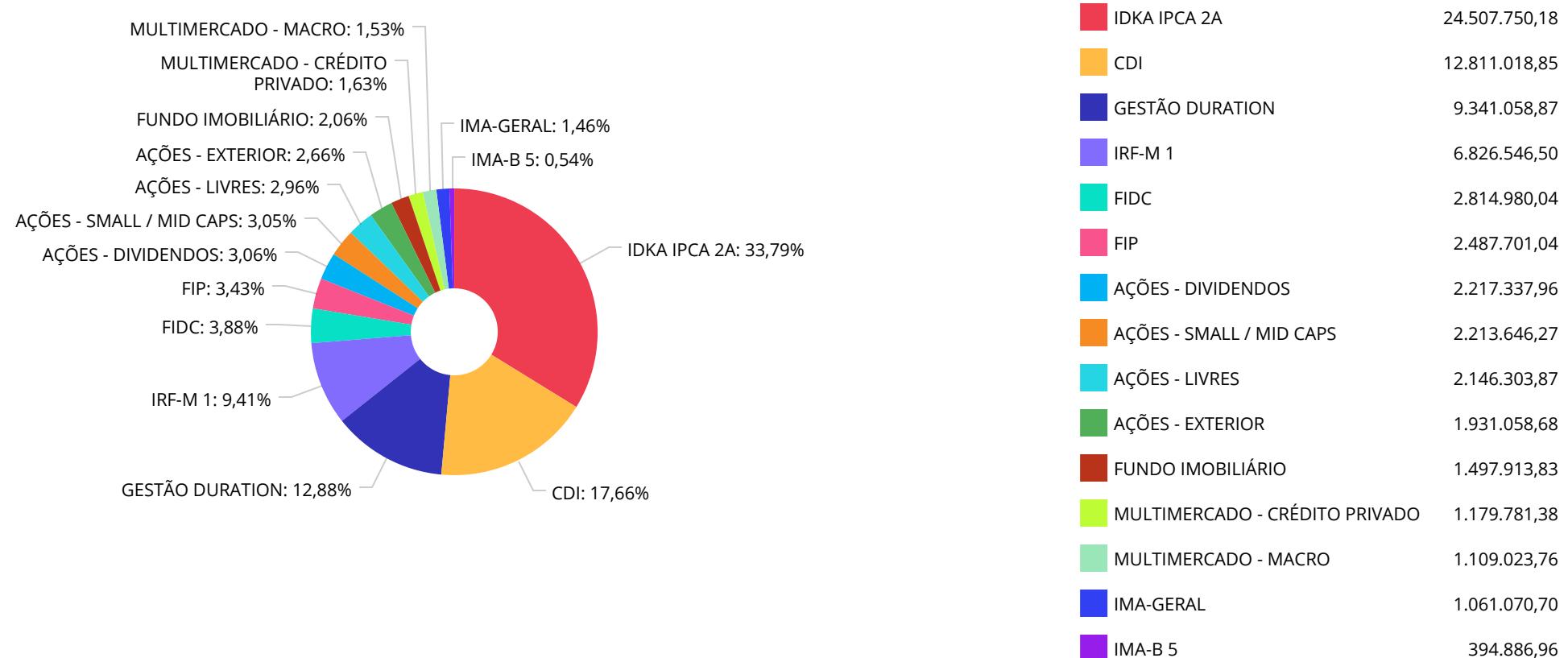
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,28%	10,06%	-3,18%	10,06%	27,98%	98,13%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,33%	7,98%	-4,69%	7,98%	22,80%	81,83%	4,97%	0,17%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,19%	8,36%	-4,36%	8,36%	26,23%	95,14%	5,33%	0,17%

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



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



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

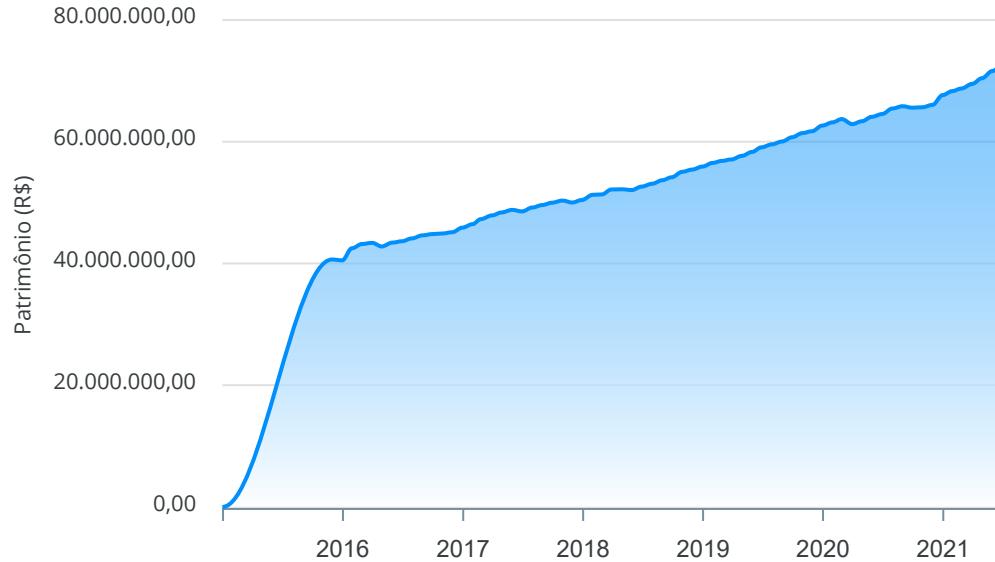
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	67.656.852,62	1.020.204,38	319.089,73	68.308.677,47	-49.289,80	-49.289,80	-0,07%	-0,07%	0,68%	0,68%	-10,66%	0,83%
Fevereiro	68.308.677,47	1.065.703,57	372.839,51	68.745.429,68	-256.111,85	-305.401,65	-0,37%	-0,44%	1,25%	1,93%	-22,95%	1,19%
Março	68.745.429,68	1.177.148,87	272.159,02	69.509.377,76	-141.041,77	-446.443,42	-0,20%	-0,64%	1,42%	3,38%	-19,06%	1,12%
Abril	69.509.377,76	1.099.850,75	356.501,08	70.442.385,96	189.658,53	-256.784,89	0,27%	-0,38%	0,74%	4,14%	-9,09%	0,99%
Maio	70.442.385,96	14.095.470,75	13.338.701,02	71.613.240,97	414.085,28	157.300,39	0,58%	0,20%	1,28%	5,48%	3,71%	1,98%
Junho	71.613.240,97	8.877.259,80	8.173.293,74	72.540.078,89	222.871,86	380.172,25	0,31%	0,51%	0,98%	6,51%	7,86%	1,86%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

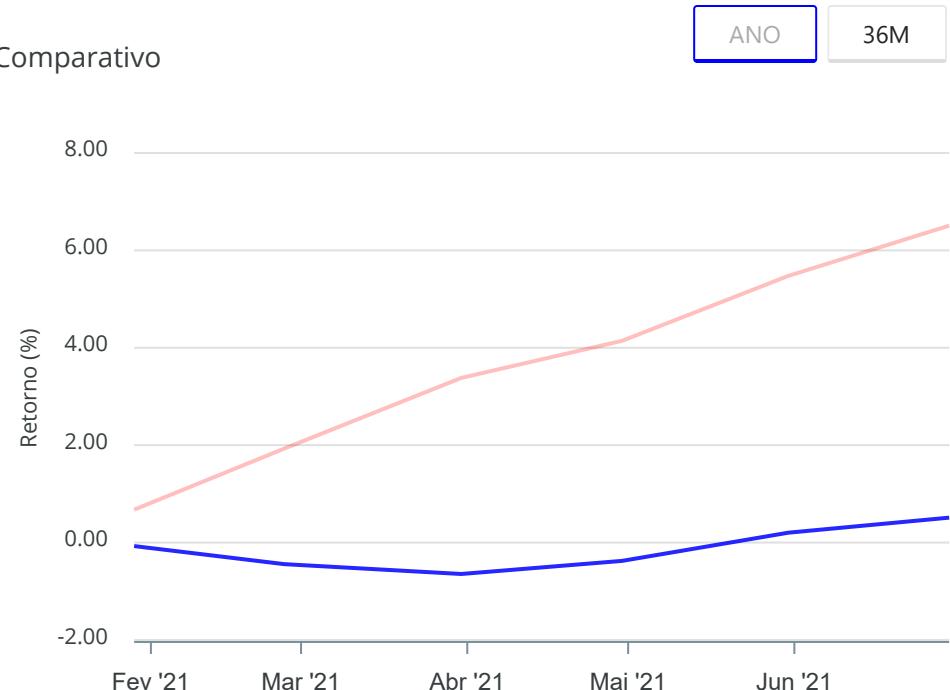


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos <input type="checkbox"/> IMA-B 5 <input type="checkbox"/> IMA-B 5+ <input type="checkbox"/> IMA Geral <input type="checkbox"/> Ibovespa 	Meta de Rentabilidade <input type="checkbox"/> CDI <input type="checkbox"/> IMA-B <input type="checkbox"/> IRF-M <input type="checkbox"/> IRF-M 1 <input type="checkbox"/> IRF-M 1+ <input type="checkbox"/> IBX <input type="checkbox"/> SMILL <input type="checkbox"/> IDIV
---	---

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.131.683,74	0,00	0,00	2.138.738,38	7.054,64	0,33%	0,33%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.000.857,95	0,00	0,00	1.004.149,75	3.291,80	0,33%	0,33%	0,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.270.676,12	0,00	0,00	5.287.034,49	16.358,37	0,31%	0,31%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.170.920,53	0,00	0,00	6.182.561,02	11.640,49	0,19%	0,19%	0,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	642.828,08	0,00	0,00	643.985,48	1.157,40	0,18%	0,18%	0,16%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	715.855,84	0,00	0,00	716.696,38	840,54	0,12%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.059.888,97	0,00	0,00	1.061.070,70	1.181,73	0,11%	0,11%	1,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.214.421,75	8.463.938,08	8.173.293,74	6.519.834,61	14.768,52	0,10%	0,24%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.157.207,57	0,00	0,00	1.157.537,54	329,97	0,03%	0,03%	0,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.202.537,71	0,00	0,00	7.202.320,49	-217,22	0,00%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.457.653,72	0,00	0,00	12.446.004,76	-11.648,96	-0,09%	-0,09%	1,36%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	216.118,69	0,00	0,00	215.786,07	-332,62	-0,15%	-0,15%	0,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.682.434,05	413.321,72	0,00	12.061.745,42	-34.010,35	-0,28%	-0,28%	1,53%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	179.908,30	0,00	0,00	179.100,89	-807,41	-0,45%	-0,45%	0,72%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	949.255,62	0,00	0,00	940.746,12	-8.509,50	-0,90%	-	-
Total Renda Fixa	57.052.248,64	8.877.259,80	8.173.293,74	57.757.312,10	1.097,40	0,00%		0,85%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.091.828,88	0,00	0,00	2.217.337,96	125.509,08	6,00%	6,00%	8,94%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.093.639,70	0,00	0,00	2.213.646,27	120.006,57	5,73%	5,73%	8,75%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	407.741,91	0,00	0,00	418.064,49	10.322,58	2,53%	2,53%	30,23%
HAZ FII - ATCR11	1.064.911,84	0,00	0,00	1.079.849,34	14.937,50	1,40%	1,40%	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	397.365,73	0,00	0,00	401.228,37	3.862,64	0,97%	0,97%	4,74%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.159.452,27	0,00	0,00	1.161.351,99	1.899,72	0,16%	0,16%	0,49%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.490.715,16	0,00	0,00	2.487.701,04	-3.014,12	-0,12%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.110.898,06	0,00	0,00	1.109.023,76	-1.874,30	-0,17%	-0,15%	1,32%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.502,68	0,00	0,00	18.429,39	-73,29	-0,40%	-0,40%	0,00%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.760.320,99	0,00	0,00	1.745.075,50	-15.245,49	-0,87%	-0,87%	6,80%
Total Renda Variável	12.595.377,22	0,00	0,00	12.851.708,11	256.330,89	2,04%		7,28%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	982.775,54	0,00	0,00	971.095,54	-11.680,00	-1,19%	-1,19%	5,33%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	982.839,57	0,00	0,00	959.963,14	-22.876,43	-2,33%	-2,33%	4,97%
Total Exterior	1.965.615,11	0,00	0,00	1.931.058,68	-34.556,43	-1,76%		5,15%

Retorno dos Investimentos apóas as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.467.874,17	413.321,72	0,00	12.061.745,42	180.549,53	1,52%	1,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.271.563,67	0,00	0,00	12.446.004,76	174.441,09	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.116.880,82	0,00	7.000.000,00	6.182.561,02	65.680,20	0,50%	0,64%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	9.681.819,26	10.659.259,58	13.868.495,84	6.519.834,61	47.251,61	0,23%	0,57%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.163.883,20	5.000.000,00	0,00	7.202.320,49	38.437,29	0,54%	0,90%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.249.069,31	0,00	0,00	5.287.034,49	37.965,18	0,72%	0,72%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.111.430,04	0,00	0,00	2.138.738,38	27.308,34	1,29%	1,29%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.048.302,45	0,00	0,00	1.061.070,70	12.768,25	1,22%	1,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.636.712,86	0,00	1.000.000,00	643.985,48	7.272,62	0,44%	0,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.004.149,75	4.149,75	0,41%	0,81%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	713.161,33	0,00	0,00	716.696,38	3.535,05	0,50%	0,50%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	179.282,15	0,00	0,00	179.100,89	-181,26	-0,10%	-0,10%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.162.445,40	0,00	0,00	1.157.537,54	-4.907,86	-0,42%	-0,42%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	259.682,14	0,00	0,00	215.786,07	-43.896,07	-16,90%	-16,90%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	1.311.617,57	0,00	0,00	940.746,12	-370.871,45	-28,28%	-100,00%
				Total Renda Fixa	179.502,27	0,23%	

Retorno dos Investimentos apóas as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.217.337,96	217.337,96	10,87%	27,13%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.213.646,27	213.646,27	10,68%	30,58%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	278.709,66	0,00	0,00	418.064,49	139.354,83	50,00%	50,00%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	635.365,91	1.000.000,00	0,00	1.745.075,50	109.709,59	6,71%	15,78%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	366.022,95	0,00	0,00	401.228,37	35.205,42	9,62%	9,62%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.083.068,23	0,00	0,00	1.109.023,76	25.955,53	2,40%	2,40%
HAZ FII - ATCR11	1.066.067,96	0,00	0,00	1.079.849,34	13.781,38	1,29%	1,29%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.158.322,04	0,00	0,00	1.161.351,99	3.029,95	0,26%	0,26%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.651,51	0,00	0,00	18.429,39	-222,12	-1,19%	-1,19%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.529.445,13	0,00	0,00	2.487.701,04	-41.744,09	-1,65%	-1,65%
				Total Renda Variável	716.054,72	5,90%	

Retorno dos Investimentos apóas as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.470.726,10	413.321,72	0,00	12.061.745,42	177.697,60	1,50%	1,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.272.001,87	0,00	0,00	12.446.004,76	174.002,89	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.110.002,27	0,00	7.000.000,00	6.182.561,02	72.558,75	0,55%	0,70%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	7.314.126,37	13.922.316,40	14.787.862,07	6.519.834,61	71.253,91	0,34%	0,85%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.226.521,69	0,00	0,00	5.287.034,49	60.512,80	1,16%	1,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.167.845,64	5.000.000,00	0,00	7.202.320,49	34.474,85	0,48%	0,72%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.635.854,81	0,00	1.000.000,00	643.985,48	8.130,67	0,50%	0,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.004.149,75	4.149,75	0,41%	1,32%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	180.454,40	0,00	0,00	179.100,89	-1.353,51	-0,75%	-0,75%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.206.415,37	0,00	44.722,03	1.157.537,54	-4.155,80	-0,34%	-0,34%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.068.347,14	0,00	0,00	1.061.070,70	-7.276,44	-0,68%	-0,68%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	732.086,88	0,00	0,00	716.696,38	-15.390,50	-2,10%	-2,10%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.155.957,42	0,00	0,00	2.138.738,38	-17.219,04	-0,80%	-0,80%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	282.308,68	0,00	0,00	215.786,07	-66.522,61	-23,56%	-23,56%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	1.650.545,30	0,00	0,00	940.746,12	-709.799,18	-43,00%	-100,00%
				Total Renda Fixa	-218.935,86	-0,27%	

Retorno dos Investimentos apóas as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.217.337,96	217.337,96	10,87%	53,12%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.213.646,27	213.646,27	10,68%	54,50%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	613.449,27	1.000.000,00	0,00	1.745.075,50	131.626,23	8,16%	19,92%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	361.290,30	0,00	0,00	418.064,49	56.774,19	15,71%	15,71%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.075.480,73	0,00	0,00	1.109.023,76	33.543,03	3,12%	3,12%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.132.138,80	0,00	0,00	1.161.351,99	29.213,19	2,58%	2,58%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	375.365,04	0,00	0,00	401.228,37	25.863,33	6,89%	6,89%
HAZ FII - ATCR11	1.068.481,06	0,00	0,00	1.079.849,34	11.368,28	1,06%	1,06%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.882,81	0,00	0,00	18.429,39	-453,42	-2,40%	-2,40%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.538.570,67	0,00	0,00	2.487.701,04	-50.869,63	-2,00%	2,59%
				Total Renda Variável	668.049,43	5,48%	

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.