

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

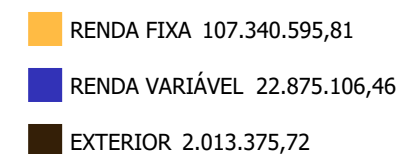
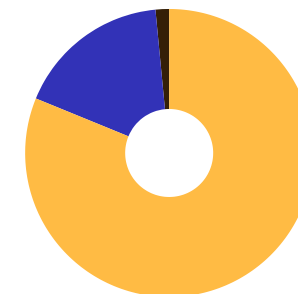
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.701.471,99	4,31%	595	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.474.697,80	1,87%	992	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	7.418.886,14	5,61%	745	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.777.150,67	4,37%	662	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	24.096.369,03	18,22%	974	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	19.949.240,70	15,09%	1.007	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.226.567,11	5,47%	883	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.745.213,95	4,34%	1.309	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.576.646,68	4,22%	196	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	7.512.691,99	5,68%	572	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.212.214,02	2,43%	138	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.598.829,03	4,23%	691	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.252.218,68	3,22%	255	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	2.798.398,02	2,12%	472	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	734.700,52	0,56%	39.677	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.728.594,91	3,58%	2.840	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.700.614,55	3,55%	25.862	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.293.443,64	2,49%	2.355	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	4.488.730,78	3,39%	112	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.089.923,03	1,58%	171	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 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	2.041.428,85	1,54%	37.076	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	253.940,63	0,19%	16.692	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	543.729,55	0,41%	126	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	698.554,34	0,53%	77	0,05%	Artigo 9º - A, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.314.821,38	0,99%	427	0,05%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			132.229.077,99				

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

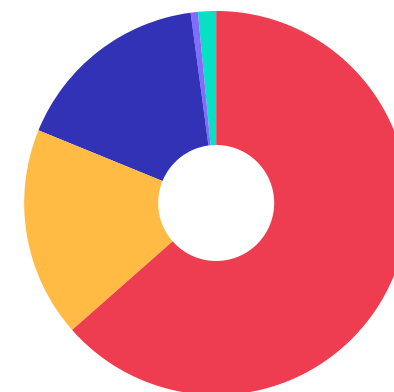
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	83.966.244,07	63,50%	11,53%	53,76%	90,00%	35.039.926,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	23.374.351,74	17,68%	4,09%	20,43%	40,00%	29.517.279,46
Total Renda Fixa	100,00%	107.340.595,81	81,18%	15,62%	74,19%	130,00%	



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%	2,00%	5,00%	6.611.453,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	22.077.436,28	16,70%	7,00%	17,91%	20,00%	4.368.379,32
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	797.670,18	0,60%	0,00%	5,04%	10,00%	12.425.237,62
Total Renda Variável	30,00%	22.875.106,46	17,30%	7,00%	24,95%	35,00%	

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%	0,43%	5,00%	6.611.453,90
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	2.013.375,72	1,52%	0,00%	0,43%	5,00%	4.598.078,18
Total Exterior	10,00%	2.013.375,72	1,52%	0,00%	0,86%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	75.723.099,82	57,27	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	39.747.362,91	30,06	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	8.375.044,70	6,33	0,00
ITAÚ UNIBANCO	6.293.647,53	4,76	0,00
VINCI PARTNERS	2.089.923,03	1,58	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 '	83.966.244,07	63,50	11,53	90,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	23.374.351,74	17,68	4,09	40,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	22.077.436,28	16,70	17,91	20,00
Artigo 8º, Inciso III	797.670,18	0,60	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	2.013.375,72	1,52	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
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,19%	1,17%	1,37%	1,17%	5,78%	14,87%	1,55%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,15%	1,15%	1,39%	1,15%	5,77%	14,78%	1,53%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,42%	-0,72%	2,14%	-0,72%	7,42%	12,74%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	-0,82%	2,09%	-0,82%	7,15%	12,23%	2,45%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40%	-0,84%	2,09%	-0,84%	7,19%	12,04%	2,43%	0,08%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	0,40%	-0,87%	2,07%	-0,87%	7,11%	11,83%	2,44%	0,08%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,31%	1,16%	0,82%	1,16%	2,20%	6,32%	0,04%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,33%	1,51%	0,96%	1,51%	2,71%	6,38%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	-0,39%	1,36%	-0,39%	3,22%	-	1,46%	0,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,11%	0,72%	0,83%	0,72%	2,29%	-	0,73%	0,02%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00%	0,72%	0,90%	0,72%	2,68%	12,77%	0,97%	0,02%

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
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%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,29%	1,01%	0,67%	1,01%	1,59%	7,30%	0,01%	0,01%

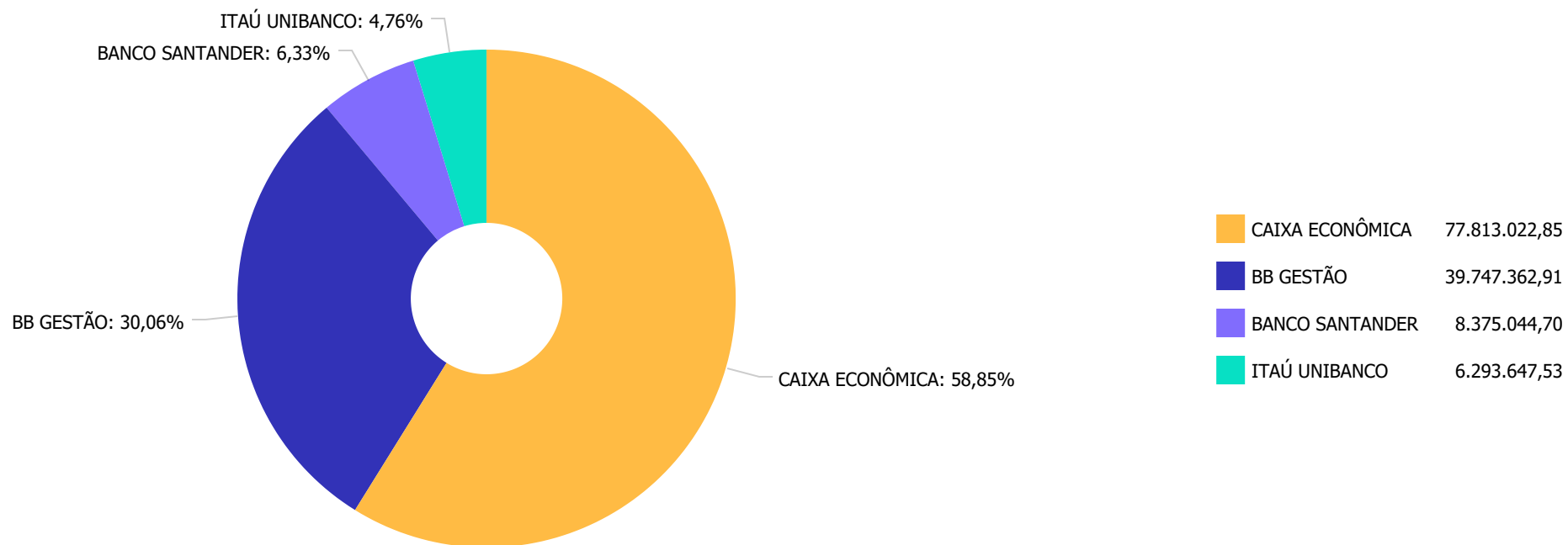
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,77%	4,52%	7,31%	4,52%	35,20%	28,53%	5,64%	0,25%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,21%	12,22%	11,00%	12,22%	37,29%	31,25%	4,87%	0,17%
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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1,66%	7,83%	10,35%	7,83%	27,85%	34,45%	4,45%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,87%	19,92%	15,78%	19,92%	42,88%	-	6,80%	0,19%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00%	3,36%	1,94%	3,36%	8,30%	-	0,80%	0,05%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-1,76%	3,78%	6,71%	3,78%	28,53%	25,52%	5,53%	0,22%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,80%	5,81%	7,62%	5,81%	39,67%	43,84%	5,55%	0,25%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	2,70%	15,32%	8,53%	15,32%	38,09%	-	4,56%	0,14%

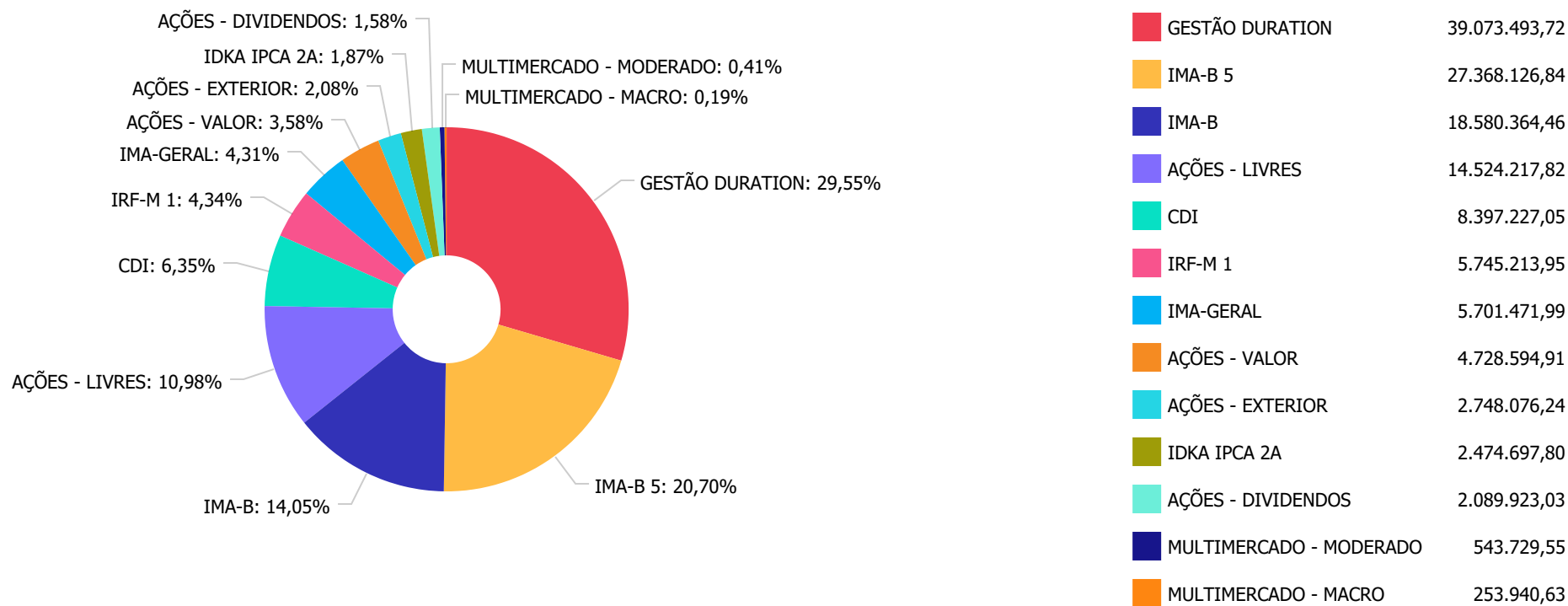
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,25%	8,51%	-4,45%	8,51%	24,31%	87,03%	4,97%	0,17%

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



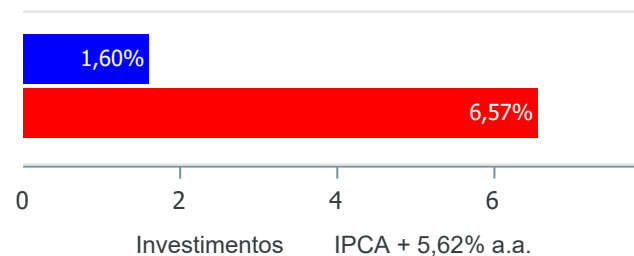
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

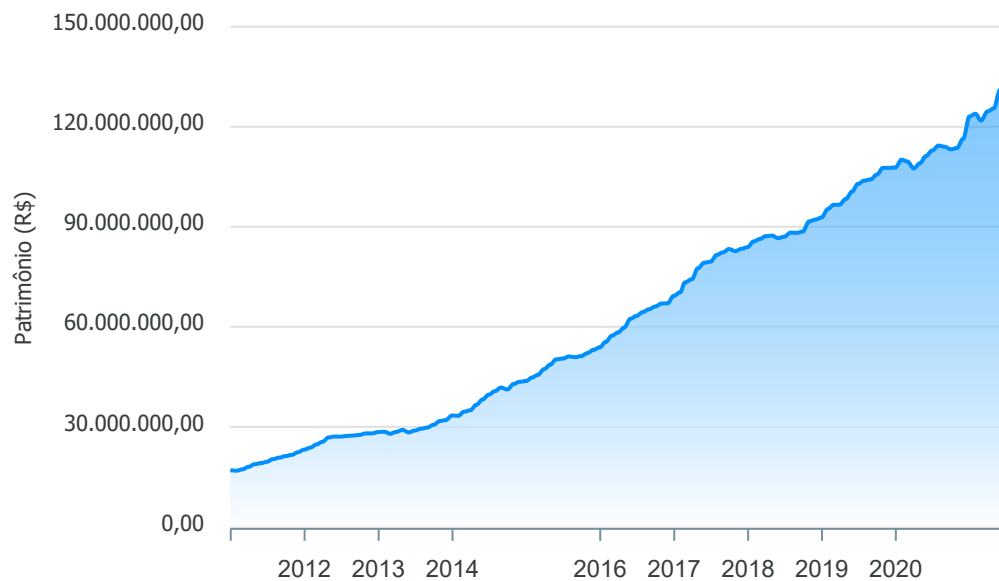
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	123.100.728,79	2.437.341,94	780.000,00	123.873.852,01	-884.218,72	-884.218,72	-0,71%	-0,71%	0,69%	0,69%	-103,32%	2,50%
Fevereiro	123.873.852,01	598.730,98	1.339.077,65	121.886.252,43	-1.247.252,91	-2.131.471,63	-1,01%	-1,71%	1,25%	1,95%	-87,65%	2,58%
Março	121.886.252,43	2.876.640,59	1.220.935,75	124.618.499,77	1.076.542,50	-1.054.929,13	0,87%	-0,85%	1,43%	3,41%	-24,97%	3,02%
Abril	124.618.499,77	6.916.978,71	7.454.006,01	125.521.644,96	1.440.172,49	385.243,36	1,16%	0,29%	0,75%	4,18%	7,02%	1,96%
Mai	125.521.644,96	4.777.837,79	977.452,37	131.040.341,31	1.718.310,93	2.103.554,29	1,33%	1,63%	1,29%	5,53%	29,42%	2,22%
Junho	131.040.341,31	1.570.000,00	350.000,00	132.229.077,99	-31.263,32	2.072.290,97	-0,02%	1,60%	0,99%	6,57%	24,38%	2,04%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

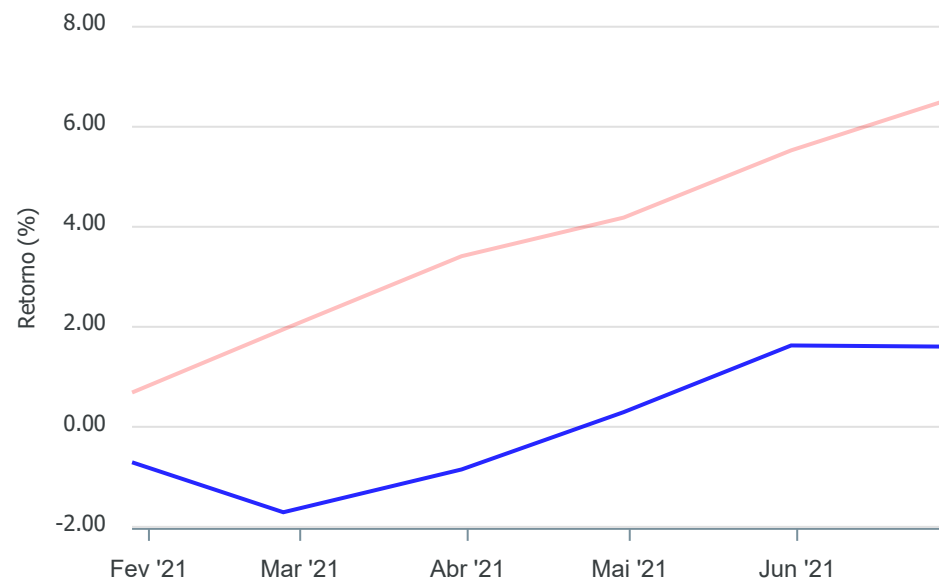


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.197.678,16	0,00	0,00	7.226.567,11	28.888,95	0,40%	0,40%	2,43%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.554.530,11	0,00	0,00	5.576.646,68	22.116,57	0,40%	0,40%	2,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.755.529,70	0,00	0,00	5.777.150,67	21.620,97	0,38%	0,38%	2,45%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.581.760,26	0,00	0,00	5.598.829,03	17.068,77	0,31%	0,31%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.240.075,72	0,00	0,00	4.252.218,68	12.142,96	0,29%	0,29%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.734.396,88	0,00	0,00	5.745.213,95	10.817,07	0,19%	0,19%	0,16%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	1.573.918,41	1.570.000,00	350.000,00	2.798.398,02	4.479,61	0,14%	0,33%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.695.122,14	0,00	0,00	5.701.471,99	6.349,85	0,11%	0,11%	1,23%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.208.831,85	0,00	0,00	3.212.214,02	3.382,17	0,11%	0,11%	0,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	7.509.175,64	0,00	0,00	7.512.691,99	3.516,35	0,05%	0,05%	1,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	24.097.095,77	0,00	0,00	24.096.369,03	-726,74	0,00%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.477.014,02	0,00	0,00	2.474.697,80	-2.316,22	-0,09%	-0,09%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.979.151,32	0,00	0,00	19.949.240,70	-29.910,62	-0,15%	-0,15%	1,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.432.699,13	0,00	0,00	7.418.886,14	-13.812,99	-0,19%	-0,19%	1,55%
Total Renda Fixa	106.036.979,11	1.570.000,00	350.000,00	107.340.595,81	83.616,70	0,08%		1,26%

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
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	715.410,24	0,00	0,00	734.700,52	19.290,28	2,70%	2,70%	4,56%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.239.726,07	0,00	0,00	3.293.443,64	53.717,57	1,66%	1,66%	4,45%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	543.706,25	0,00	0,00	543.729,55	23,30	0,00%	0,00%	0,80%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	254.369,81	0,00	0,00	253.940,63	-429,18	-0,17%	-0,15%	1,32%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.045.745,96	0,00	0,00	2.041.428,85	-4.317,11	-0,21%	-0,21%	4,87%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.765.486,99	0,00	0,00	4.728.594,91	-36.892,08	-0,77%	-0,77%	5,64%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.738.433,05	0,00	0,00	4.700.614,55	-37.818,50	-0,80%	-0,80%	5,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.527.945,68	0,00	0,00	4.488.730,78	-39.214,90	-0,87%	-0,87%	6,80%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.127.299,30	0,00	0,00	2.089.923,03	-37.376,27	-1,76%	-1,76%	5,53%
Total Renda Variável	22.958.123,35	0,00	0,00	22.875.106,46	-83.016,89	-0,36%		5,40%

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	1.330.635,59	0,00	0,00	1.314.821,38	-15.814,21	-1,19%	-1,19%	5,33%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	714.603,26	0,00	0,00	698.554,34	-16.048,92	-2,25%	-2,25%	4,97%
Total Exterior	2.045.238,85	0,00	0,00	2.013.375,72	-31.863,13	-1,56%		5,20%

Retorno dos Investimentos após 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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.676.758,80	0,00	0,00	19.949.240,70	272.481,90	1,38%	1,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	22.383.542,66	1.500.000,00	0,00	24.096.369,03	212.826,37	0,89%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.078.794,34	0,00	0,00	7.226.567,11	147.772,77	2,09%	2,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.658.750,00	0,00	0,00	5.777.150,67	118.400,67	2,09%	2,09%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.463.704,01	0,00	0,00	5.576.646,68	112.942,67	2,07%	2,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.318.628,52	0,00	0,00	7.418.886,14	100.257,62	1,37%	1,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.764.698,82	3.650.000,00	0,00	7.512.691,99	97.993,17	1,32%	1,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.636.528,25	0,00	3.000.000,00	5.701.471,99	64.943,74	0,75%	1,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.553.550,58	0,00	0,00	5.598.829,03	45.278,45	0,82%	0,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.657.493,86	0,00	1.956.075,64	5.745.213,95	43.795,73	0,57%	0,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.440.012,86	0,00	0,00	2.474.697,80	34.684,94	1,42%	1,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.224.084,72	0,00	0,00	4.252.218,68	28.133,96	0,67%	0,67%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	875.321,20	2.310.382,74	0,00	3.212.214,02	26.510,08	0,83%	0,83%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	483.911,02	2.720.000,00	415.000,00	2.798.398,02	9.487,00	0,30%	0,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	133.665,23	0,00	132.816,84	0,00	-848,39	-0,63%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.290.949,32	0,00	3.277.565,90	0,00	-13.383,42	-0,41%	1,13%
				Total Renda Fixa	1.301.277,26	1,23%	

Retorno dos Investimentos após 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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.640.175,52	276.230,74	0,00	4.488.730,78	572.324,52	14,61%	15,78%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.367.666,59	0,00	0,00	4.700.614,55	332.947,96	7,62%	7,62%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.406.557,00	0,00	0,00	4.728.594,91	322.037,91	7,31%	7,31%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.984.688,56	0,00	0,00	3.293.443,64	308.755,08	10,34%	10,34%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.839.088,04	0,00	0,00	2.041.428,85	202.340,81	11,00%	11,00%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.958.537,84	0,00	0,00	2.089.923,03	131.385,19	6,71%	6,71%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	712.636,14	0,00	734.700,52	22.064,38	3,10%	8,53%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	533.394,61	0,00	0,00	543.729,55	10.334,94	1,94%	1,94%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	247.997,42	0,00	0,00	253.940,63	5.943,21	2,40%	2,40%
				Total Renda Variável	1.908.134,00	9,10%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	723.020,13	0,00	698.554,34	-24.465,79	-3,38%	-4,45%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	1.372.546,75	0,00	1.314.821,38	-57.725,37	-4,21%	-4,36%
				Total Exterior	-82.191,16	-3,92%	

Retorno dos Investimentos após 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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.721.566,73	0,00	0,00	19.949.240,70	227.673,97	1,15%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	22.424.530,84	1.500.000,00	0,00	24.096.369,03	171.838,19	0,72%	0,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.333.204,94	0,00	0,00	7.418.886,14	85.681,20	1,17%	1,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.534.798,90	0,00	0,00	5.598.829,03	64.030,13	1,16%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.606.916,61	0,00	3.910.089,04	5.745.213,95	48.386,38	0,50%	0,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.209.828,45	0,00	0,00	4.252.218,68	42.390,23	1,01%	1,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.593.585,35	4.879.235,88	0,00	7.512.691,99	39.870,76	0,53%	-0,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.440.099,99	0,00	0,00	2.474.697,80	34.597,81	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	3.188.497,09	0,00	3.212.214,02	23.716,93	0,74%	0,72%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	1.286.188,89	3.300.000,00	1.801.000,00	2.798.398,02	13.209,13	0,29%	1,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	140.386,98	0,00	132.816,84	0,00	-7.570,14	-5,39%	-3,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.824.802,60	0,00	0,00	5.777.150,67	-47.651,93	-0,82%	-0,82%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	5.625.298,04	0,00	0,00	5.576.646,68	-48.651,36	-0,86%	-0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.287.432,36	0,00	0,00	7.226.567,11	-60.865,25	-0,84%	-0,84%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.801.668,15	0,00	3.000.000,00	5.701.471,99	-100.196,16	-1,14%	-0,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.385.252,75	0,00	3.277.565,90	0,00	-107.686,85	-3,18%	-1,69%
				Total Renda Fixa	378.773,04	0,35%	

Retorno dos Investimentos após 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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.692.704,99	1.113.782,11	0,00	4.488.730,78	682.243,68	17,92%	19,92%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.474.965,18	944.965,81	0,00	4.700.614,55	280.683,56	6,35%	5,81%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.702.441,15	350.000,00	0,00	3.293.443,64	241.002,49	7,90%	7,83%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.819.094,99	0,00	0,00	2.041.428,85	222.333,86	12,22%	12,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.158.101,24	350.000,00	0,00	4.728.594,91	220.493,67	4,89%	4,52%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.265.567,09	742.846,10	0,00	2.089.923,03	81.509,84	4,06%	3,78%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	712.636,14	0,00	734.700,52	22.064,38	3,10%	15,32%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	526.032,51	0,00	0,00	543.729,55	17.697,04	3,36%	3,36%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	246.260,06	0,00	0,00	253.940,63	7.680,57	3,12%	3,12%
Total Renda Variável					1.775.709,09	8,42%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	723.020,13	0,00	698.554,34	-24.465,79	-3,38%	8,51%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	1.372.546,75	0,00	1.314.821,38	-57.725,37	-4,21%	8,36%
				Total Exterior	-82.191,16	-3,92%	

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.