

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)

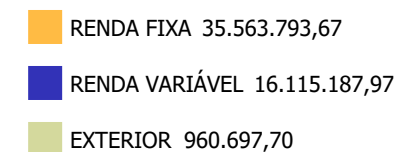
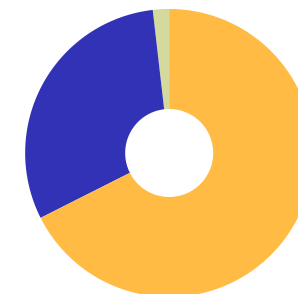
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.074.916,18	2,04%	595	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.822.330,99	9,16%	992	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.487.439,43	6,63%	745	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.929.823,98	5,57%	662	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.754.214,36	5,23%	1.169	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.834.319,00	16,78%	974	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.228.457,92	4,23%	1.044	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.262.118,14	8,10%	572	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	258.368,68	0,49%	793	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	849.795,31	1,61%	255	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.401.866,72	2,66%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	379.130,68	0,72%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	456.787,89	0,87%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.633.013,51	3,10%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	Não se ...	Não se aplica	72.578,72	0,14%	20	725.787.200,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	98.422,06	0,19%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não há	20.210,10	0,04%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	667.300,70	1,27%	2.840	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.875.849,79	3,56%	25.862	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.590.488,56	3,02%	112	0,26%	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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.357.261,04	4,48%	5.678	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.251.065,52	2,38%	41.032	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	534.361,79	1,02%	26.646	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	3.049.759,94	5,79%	259	0,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	744.807,35	1,41%	18	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.559.230,18	2,96%	47.982	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.291.350,15	2,45%	16.692	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	235.639,10	0,45%	15.736	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	518.213,54	0,98%	1.255	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	469.220,77	0,89%	90	0,04%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	491.476,93	0,93%	427	0,02%	Artigo 9º - A, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	439.860,31	0,84%		0,23%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			52.639.679,34				

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

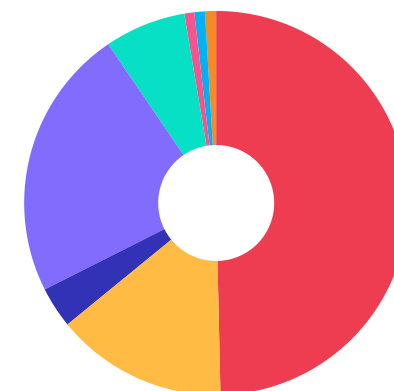
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	26.131.501,86	49,64%	11,52%	52,72%	80,00%	15.980.241,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	5.263.967,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	7.608.067,42	14,45%	3,68%	18,38%	40,00%	13.447.804,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.824.224,39	3,47%	0,00%	3,96%	5,00%	807.759,58
Total Renda Fixa	100,00%	35.563.793,67	67,56%	15,20%	75,06%	135,00%	



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%	0,00%	10,00%	5.263.967,93
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	12.070.894,69	22,93%	13,00%	18,34%	20,00%	-1.542.958,82
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.604.432,97	6,85%	3,09%	5,00%	10,00%	1.659.534,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	2,00%	1.052.793,59
Desenquadrado - RV	0,00%	439.860,31	0,84%	0,00%	0,00%	0,00%	-439.860,31
Total Renda Variável	30,00%	16.115.187,97	30,61%	16,09%	24,34%	42,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	469.220,77	0,89%	0,00%	0,30%	5,00%	2.162.763,20
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	491.476,93	0,93%	0,00%	0,30%	5,00%	2.140.507,04
Total Exterior	10,00%	960.697,70	1,83%	0,00%	0,60%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.160.813,20	45,90	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	14.671.731,66	27,87	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.153.436,16	5,99	0,00
META ASSET MANAGEMENT	3.049.759,94	5,79	0,88
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.357.261,04	4,48	0,12
AURORA CAPITAL	1.633.013,51	3,10	0,41
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.500.288,78	2,85	1,44
TRÍGONO CAPITAL	744.807,35	1,41	0,03
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	456.787,89	0,87	0,00
CADENCE GESTORA	439.860,31	0,84	-
RJI CORRETORA DE VALORES	379.130,68	0,72	0,00
PLURAL INVESTIMENTOS GESTÃO DE...	72.578,72	0,14	0,00
PETRA CAPITAL	20.210,10	0,04	0,00

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 '	26.131.501,86	49,64	11,12	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	7.608.067,42	14,45	3,68	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.824.224,39	3,47	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	12.070.894,69	22,93	13,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	3.604.432,97	6,85	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 9º - A, Inciso II	469.220,77	0,89	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	491.476,93	0,93	0,00	5,00

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)

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 Geral ex-C (Benchmark)	0,32%	-0,34%	1,32%	-0,34%	2,74%	9,23%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,68%	1,22%	-0,68%	2,58%	9,05%	1,23%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,32%	1,87%	1,91%	1,87%	7,06%	16,45%	-	-
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%
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%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,12%	-2,10%	0,50%	-2,10%	-3,88%	-7,96%	-	0,04%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,03%	-0,34%	-0,42%	-0,34%	-9,20%	-26,03%	0,09%	0,06%
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%
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%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,15%	-23,56%	-16,90%	-23,56%	-66,87%	-75,85%	0,21%	0,54%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,45%	-0,75%	-0,10%	-0,75%	-23,82%	-36,67%	0,72%	0,22%
IMA-B (Benchmark)	0,42%	-0,72%	2,14%	-0,72%	7,42%	12,74%	-	-

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
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%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,19%	-0,15%	0,76%	-0,15%	0,81%	0,57%	0,57%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,76%	0,53%	0,76%	1,16%	4,70%	0,01%	0,00%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,29%	1,01%	0,67%	1,01%	1,59%	7,30%	0,01%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	-0,39%	1,36%	-0,39%	3,22%	-	1,46%	0,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-4,21%	-3,63%	-4,21%	-7,40%	-15,22%	0,01%	0,12%
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 VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	2,22%	14,41%	8,17%	14,41%	38,62%	46,09%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,68%	16,13%	8,75%	16,13%	39,42%	45,94%	4,67%	0,15%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,72%	16,15%	8,76%	16,15%	38,60%	43,45%	4,66%	0,15%
IBX (Benchmark)	0,63%	8,82%	9,61%	8,82%	36,33%	29,97%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-1,63%	-0,72%	4,25%	-0,72%	19,22%	27,17%	5,83%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1,80%	2,73%	10,18%	2,73%	26,66%	27,74%	3,97%	0,19%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,77%	4,52%	7,31%	4,52%	35,20%	28,53%	5,64%	0,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-0,26%	11,75%	9,57%	11,75%	28,69%	33,70%	5,76%	0,22%
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%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,01%	1,19%	1,15%	1,19%	3,57%	8,86%	0,55%	0,03%
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 BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,87%	19,92%	15,78%	19,92%	42,88%	-	6,80%	0,19%
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	3,48%	-0,27%	3,48%	2,62%	204.779.558,51%	-	-

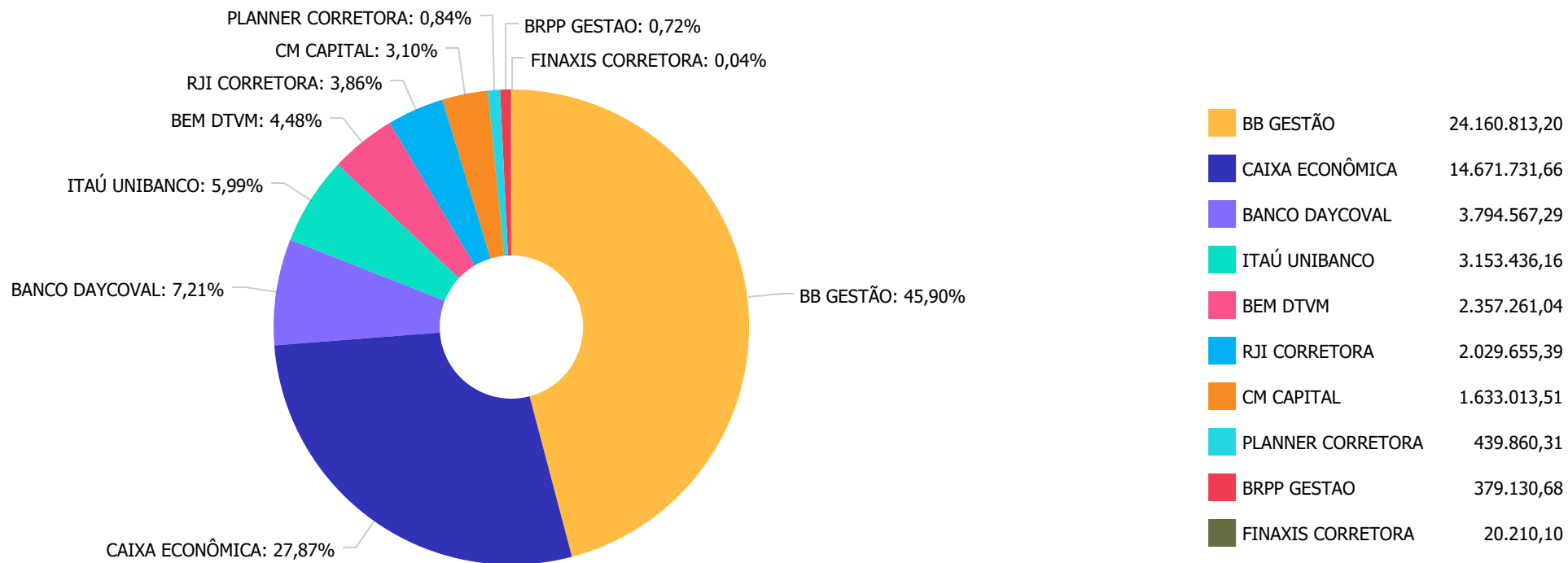
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	1,19%	14,45%	12,79%	14,45%	42,53%	49,44%	5,01%	0,20%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,80%	5,81%	7,62%	5,81%	39,67%	43,84%	5,55%	0,25%

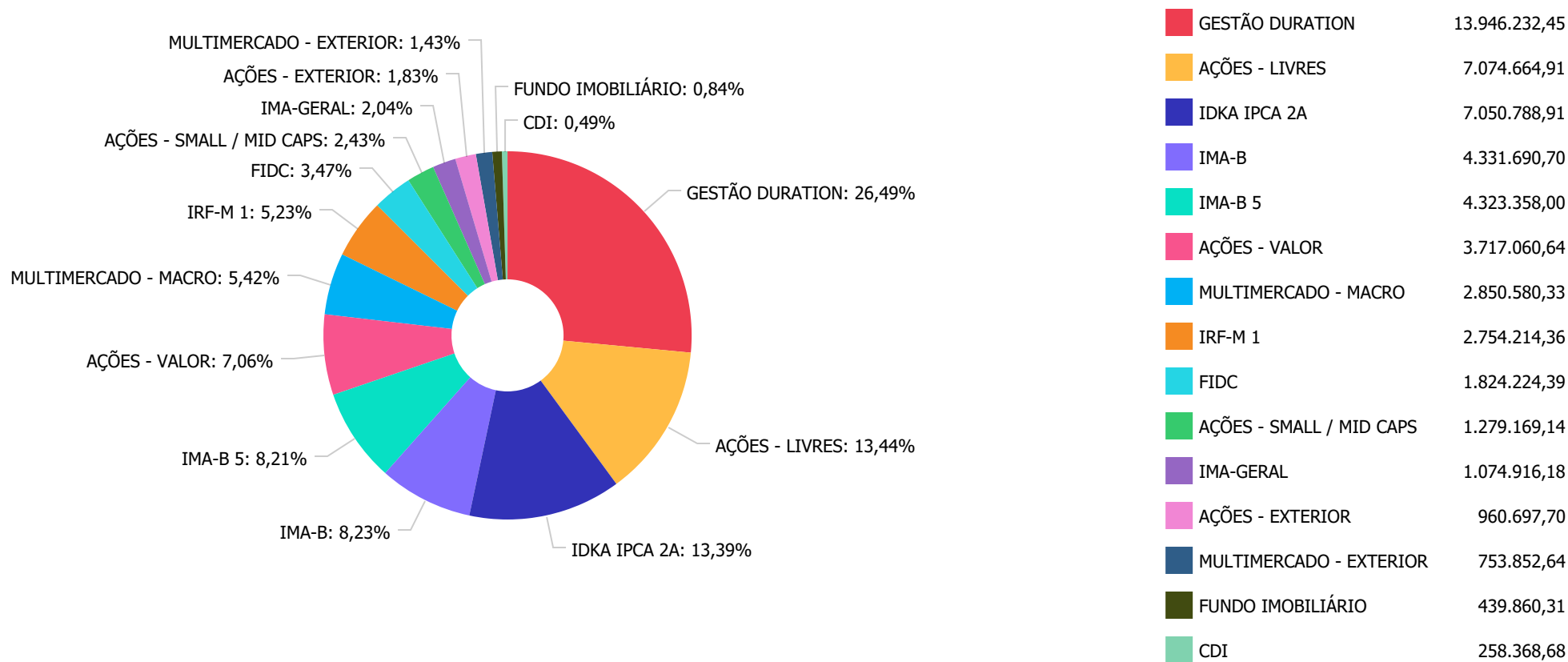
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
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 NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-3,94%	7,50%	-6,12%	7,50%	36,16%	105,20%	7,04%	0,14%

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



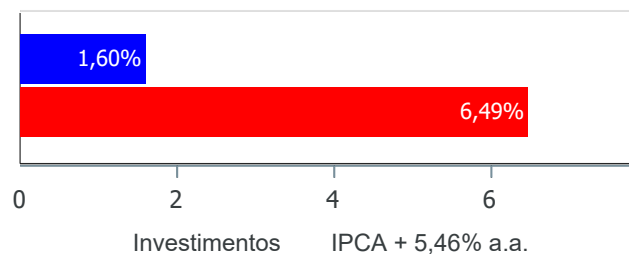
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

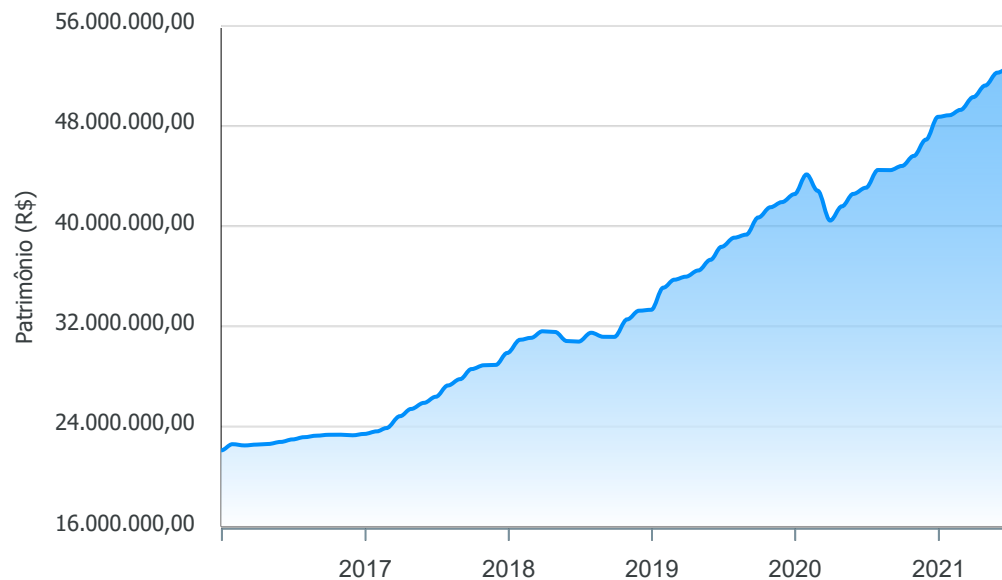
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	48.741.928,30	1.186.459,81	588.707,27	48.870.735,09	-468.945,75	-468.945,75	-0,95%	-0,95%	0,67%	0,67%	-141,04%	3,15%
Fevereiro	48.870.735,09	3.809.245,09	2.814.335,17	49.297.313,37	-568.331,64	-1.037.277,39	-1,14%	-2,08%	1,24%	1,93%	-107,96%	2,93%
Março	49.297.313,37	918.826,01	547.323,61	50.320.629,93	651.814,16	-385.463,23	1,31%	-0,79%	1,42%	3,37%	-23,54%	3,27%
Abril	50.320.629,93	931.894,35	1.092.099,82	50.741.550,17	581.125,71	195.662,48	1,15%	0,35%	0,73%	4,13%	8,50%	2,12%
Mai	50.741.550,17	3.068.794,87	2.220.595,05	52.270.714,59	680.964,60	876.627,08	1,32%	1,68%	1,28%	5,46%	30,68%	3,00%
Junho	52.270.714,59	1.533.529,62	1.125.948,13	52.639.679,34	-38.616,74	838.010,34	-0,07%	1,60%	0,98%	6,49%	24,66%	2,36%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



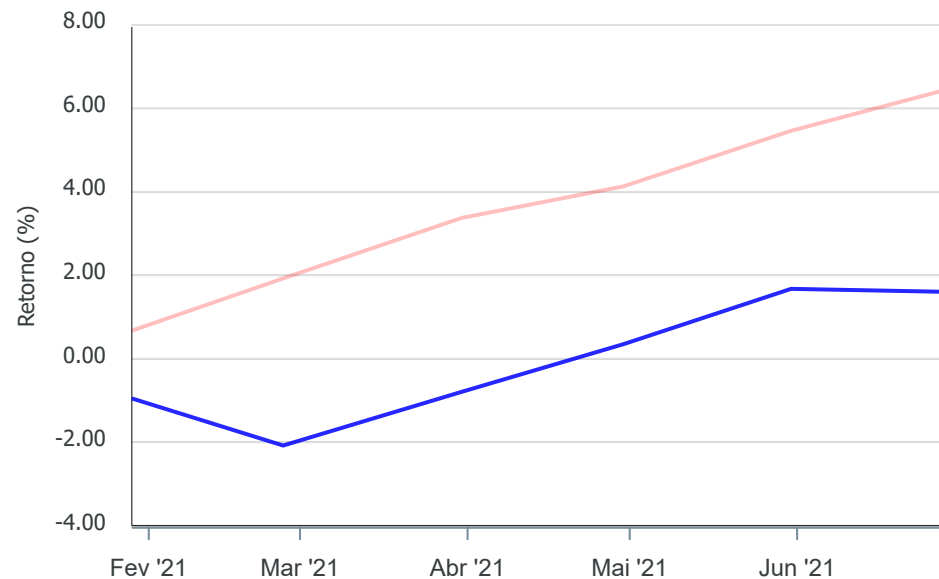
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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
- 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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.918.859,12	0,00	0,00	2.929.823,98	10.964,86	0,38%	0,38%	2,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	847.368,57	0,00	0,00	849.795,31	2.426,74	0,29%	0,29%	0,01%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.399.234,10	0,00	0,00	1.401.866,72	2.632,62	0,19%	0,19%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.749.264,37	0,00	0,00	2.754.214,36	4.949,99	0,18%	0,18%	0,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	194.221,32	688.618,31	625.948,13	258.368,68	1.477,18	0,17%	0,22%	0,01%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	98.306,62	0,00	0,00	98.422,06	115,44	0,12%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.073.719,03	0,00	0,00	1.074.916,18	1.197,15	0,11%	0,11%	1,23%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.219.014,61	41.164,14	0,00	4.262.118,14	1.939,39	0,05%	0,05%	1,46%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.632.548,00	0,00	0,00	1.633.013,51	465,51	0,03%	0,03%	0,09%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	0,00	72.578,72	0,00	72.578,72	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.334.881,99	0,00	500.000,00	8.834.319,00	-562,99	-0,01%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.826.844,50	0,00	0,00	4.822.330,99	-4.513,51	-0,09%	-0,09%	1,36%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	457.492,00	0,00	0,00	456.787,89	-704,11	-0,15%	-0,15%	0,21%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	20.242,67	0,00	0,00	20.210,10	-32,57	-0,16%	-0,16%	0,01%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.493.932,59	0,00	0,00	3.487.439,43	-6.493,16	-0,19%	-0,19%	1,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.234.654,59	0,00	0,00	2.228.457,92	-6.196,67	-0,28%	-0,28%	1,53%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	380.839,85	0,00	0,00	379.130,68	-1.709,17	-0,45%	-0,45%	0,72%
Total Renda Fixa	35.881.423,93	802.361,17	1.125.948,13	35.563.793,67	5.956,70	0,02%		1,14%

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 FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	704.429,73	0,00	0,00	744.807,35	40.377,62	5,73%	5,73%	8,75%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	504.694,97	0,00	0,00	518.213,54	13.518,57	2,68%	2,68%	4,67%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	231.168,45	0,00	235.639,10	4.470,65	1,93%	2,71%	4,66%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.228.963,09	0,00	0,00	1.251.065,52	22.102,43	1,80%	1,80%	3,97%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	528.095,67	0,00	0,00	534.361,79	6.266,12	1,19%	1,19%	5,01%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.559.450,52	0,00	0,00	1.559.230,18	-220,34	-0,01%	-0,01%	0,55%
OSASCO PROPERTIES FII	440.462,41	0,00	0,00	439.860,31	-602,10	-0,14%	0,00%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.293.532,60	0,00	0,00	1.291.350,15	-2.182,45	-0,17%	-0,15%	1,32%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.363.456,95	0,00	0,00	2.357.261,04	-6.195,91	-0,26%	-0,26%	5,76%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	672.506,92	0,00	0,00	667.300,70	-5.206,22	-0,77%	-0,77%	5,64%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.890.941,82	0,00	0,00	1.875.849,79	-15.092,03	-0,80%	-0,80%	5,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.116.523,73	500.000,00	0,00	1.590.488,56	-26.035,17	-1,61%	-0,87%	6,80%
META VALOR FI AÇÕES	3.100.370,54	0,00	0,00	3.049.759,94	-50.610,60	-1,63%	-1,63%	5,83%
Total Renda Variável	15.403.428,95	731.168,45	0,00	16.115.187,97	-19.409,43	-0,12%		4,89%

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	497.388,25	0,00	0,00	491.476,93	-5.911,32	-1,19%	-1,19%	5,33%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	488.473,46	0,00	0,00	469.220,77	-19.252,69	-3,94%	-3,94%	7,04%
Total Exterior	985.861,71	0,00	0,00	960.697,70	-25.164,01	-2,55%		6,16%

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.030.200,68	228.270,80	507.533,34	8.834.319,00	83.380,86	0,90%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.754.742,02	0,00	0,00	4.822.330,99	67.588,97	1,42%	1,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.869.778,27	0,00	0,00	2.929.823,98	60.045,71	2,09%	2,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.164.330,63	41.164,14	0,00	4.262.118,14	56.623,37	1,35%	1,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.440.310,74	0,00	0,00	3.487.439,43	47.128,69	1,37%	1,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.193.612,86	0,00	0,00	2.228.457,92	34.845,06	1,59%	1,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.236.520,49	0,00	500.000,00	2.754.214,36	17.693,87	0,55%	0,60%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.061.981,32	0,00	0,00	1.074.916,18	12.934,86	1,22%	1,22%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.391.246,70	0,00	0,00	1.401.866,72	10.620,02	0,76%	0,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.843.046,27	0,00	1.000.000,00	849.795,31	6.749,04	0,37%	0,67%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	869.565,79	1.815.850,47	2.431.109,66	258.368,68	4.062,08	0,15%	0,53%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	97.936,59	0,00	0,00	98.422,06	485,47	0,50%	0,50%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	0,00	72.578,72	0,00	72.578,72	0,00	0,00%	0,00%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	379.514,38	0,00	0,00	379.130,68	-383,70	-0,10%	-0,10%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	20.971,79	0,00	0,00	20.210,10	-761,69	-3,63%	-3,63%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.639.937,36	0,00	0,00	1.633.013,51	-6.923,85	-0,42%	-0,42%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	549.709,53	0,00	0,00	456.787,89	-92.921,64	-16,90%	-16,90%
				Total Renda Fixa	301.167,12	0,76%	

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.151.298,79	0,00	0,00	2.357.261,04	205.962,25	9,57%	9,57%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	955.986,02	500.000,00	0,00	1.590.488,56	134.502,54	9,24%	15,78%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.742.981,98	0,00	0,00	1.875.849,79	132.867,81	7,62%	7,62%
META VALOR FI AÇÕES	2.925.307,32	0,00	0,00	3.049.759,94	124.452,62	4,25%	4,25%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.135.508,37	0,00	0,00	1.251.065,52	115.557,15	10,18%	10,18%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	650.000,00	0,00	744.807,35	94.807,35	14,59%	30,58%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	621.854,62	0,00	0,00	667.300,70	45.446,08	7,31%	7,31%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	534.361,79	34.361,79	6,87%	12,79%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.261.127,46	0,00	0,00	1.291.350,15	30.222,69	2,40%	2,40%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	500.000,00	0,00	518.213,54	18.213,54	3,64%	8,75%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.541.523,12	0,00	0,00	1.559.230,18	17.707,06	1,15%	1,15%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	231.168,45	0,00	235.639,10	4.470,65	1,93%	8,76%
OSASCO PROPERTIES FII	441.636,83	0,00	0,00	439.860,31	-1.776,52	-0,40%	-0,27%
Total Renda Variável					956.795,01	6,31%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	495.186,26	0,00	491.476,93	-3.709,33	-0,75%	-4,36%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	0,00	500.000,00	0,00	469.220,77	-30.779,23	-6,16%	-6,12%
				Total Exterior	-34.488,56	-3,47%	

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.722.000,45	553.674,88	507.533,34	8.834.319,00	66.177,01	0,71%	0,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.073.988,81	683.000,00	0,00	4.822.330,99	65.342,18	1,37%	1,42%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.449.295,05	1.000.000,00	0,00	3.487.439,43	38.144,38	1,11%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.194.158,39	0,00	0,00	2.228.457,92	34.299,53	1,56%	1,56%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.234.823,74	0,00	500.000,00	2.754.214,36	19.390,62	0,60%	0,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.836.825,98	0,00	1.000.000,00	849.795,31	12.969,33	0,71%	1,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	889.541,06	5.146.361,57	5.784.608,10	258.368,68	7.074,15	0,12%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	482.611,48	0,00	483.791,59	0,00	1.180,11	0,24%	1,32%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	0,00	72.578,72	0,00	72.578,72	0,00	0,00%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	21.098,19	0,00	0,00	20.210,10	-888,09	-4,21%	-4,21%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.403.923,02	0,00	0,00	1.401.866,72	-2.056,30	-0,15%	-0,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	100.535,59	0,00	0,00	98.422,06	-2.113,53	-2,10%	-2,10%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	381.995,87	0,00	0,00	379.130,68	-2.865,19	-0,75%	-0,75%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.701.968,64	0,00	63.092,26	1.633.013,51	-5.862,87	-0,34%	-0,34%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.082.287,57	0,00	0,00	1.074.916,18	-7.371,39	-0,68%	-0,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.237.650,01	41.164,14	0,00	4.262.118,14	-16.696,01	-0,39%	-0,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.953.990,18	0,00	0,00	2.929.823,98	-24.166,20	-0,82%	-0,82%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	597.606,63	0,00	49.983,76	456.787,89	-90.834,98	-15,20%	-23,56%
				Total Renda Fixa	91.722,75	0,21%	

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.109.419,60	0,00	0,00	2.357.261,04	247.841,44	11,75%	11,75%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	348.220,28	1.075.615,73	0,00	1.590.488,56	166.652,55	11,70%	19,92%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.772.819,42	0,00	0,00	1.875.849,79	103.030,37	5,81%	5,81%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	650.000,00	0,00	744.807,35	94.807,35	14,59%	54,50%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.252.292,56	0,00	0,00	1.291.350,15	39.057,59	3,12%	3,12%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	534.361,79	34.361,79	6,87%	14,45%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.217.841,09	0,00	0,00	1.251.065,52	33.224,43	2,73%	2,73%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	638.419,62	0,00	0,00	667.300,70	28.881,08	4,52%	4,52%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.540.963,84	0,00	0,00	1.559.230,18	18.266,34	1,19%	1,19%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	500.000,00	0,00	518.213,54	18.213,54	3,64%	16,13%
OSASCO PROPERTIES FII	425.656,71	0,00	0,00	439.860,31	14.203,60	3,34%	3,48%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	231.168,45	0,00	235.639,10	4.470,65	1,93%	16,15%
META VALOR FI AÇÕES	3.071.994,52	0,00	0,00	3.049.759,94	-22.234,58	-0,72%	-0,72%
Total Renda Variável					780.776,15	5,09%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	495.186,26	0,00	491.476,93	-3.709,33	-0,75%	8,36%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	0,00	500.000,00	0,00	469.220,77	-30.779,23	-6,16%	7,50%
				Total Exterior	-34.488,56	-3,47%	

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.