

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



ItuPrev
Juntos Construindo o Futuro

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			58.835.452,78	11,09%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	15.713.318,97	2,96%	51	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	2.935.423,97	0,55%	165	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	8.912.549,09	1,68%	92	2,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	6.483.509,41	1,22%	45	3,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.134.483,36	0,97%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.214.521,64	1,36%	74	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2024	6.185.144,00	1,17%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	12.680.552,50	2,39%	25	5,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI...	D+3	Não há	10.508.792,95	1,98%	1.916	4,67%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	24.808.086,04	4,68%	572	0,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	450.791,79	0,08%	793	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.567.825,90	2,75%	265	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	38.736.540,43	7,30%	138	3,87%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	26.068,98	0,00%	302	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.520.386,37	3,68%	288	3,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	43.271,71	0,01%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	2.714,24	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se ...	Não se aplica	45.589,17	0,01%	82	2,67%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.482.298,13	0,28%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

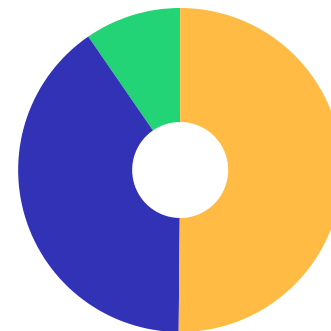
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.261.077,58	1,75%	74	1,47%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	D+21	Não há	21.769.981,13	4,10%	1.915	2,23%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	5º dia ...	Não há	779.511,02	0,15%	14	5,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	15.038.920,00	2,83%	9.329	2,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	29.732.919,83	5,60%	5.982	1,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	12.262.994,65	2,31%	34	0,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	30.054.904,32	5,66%	6.038	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	24.760.504,10	4,67%	6.384	1,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	19.355.255,37	3,65%	3.600	1,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	D+3	Não há	7.695.989,08	1,45%	6	14,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	10.058.213,46	1,90%	13	4,98%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	41.774.752,48	7,87%	44.828	2,15%	Artigo 8º, Inciso III
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUSTENTÁVEL...	Não se ...	Não se aplica	554.573,11	0,10%	94	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIELABRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.336.991,51	0,63%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	633.377,42	0,12%	39	0,13%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.279.007,94	0,43%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I M...	Não se ...	Não se aplica	9.406.917,70	1,77%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
NOVA RAPOSO MULTIELABRATÉGIA FIP - NVRP11	Não se ...	Não se aplica	3.153.299,93	0,59%	252	0,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	264.191,94	0,05%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se ...	Não se aplica	264.075,72	0,05%		0,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - O...	Não se ...	Não se aplica	2.951.517,97	0,56%		6,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	13.878.136,96	2,62%	8.246	2,33%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	12.185.703,94	2,30%	92	0,62%	Artigo 9º - A, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	12.401.483,96	2,34%	430	2,71%	Artigo 9º - A, Inciso II
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO ...	D+6 du	Não há	12.489.871,77	2,35%	154	33,05%	Artigo 9º - A, Inciso II
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		2.255,11	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			530.631.494,32				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.255,11	Artigo 6º			
PL Total			530.633.749,43				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	58.835.452,78	11,09%	0,00%	5,00%	100,00%	471.796.041,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	65.259.502,94	12,30%	0,00%	12,00%	100,00%	465.371.991,38
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	26.531.574,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	10.508.792,95	1,98%	0,00%	4,00%	70,00%	360.933.253,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	50,00%	98.109.699,51	18,49%	0,00%	20,00%	50,00%	167.206.047,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	50,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	50,00%	265.315.747,16
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	106.126.298,86
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	79.594.724,15
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	79.594.724,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	10,00%	1.573.873,25	0,30%	0,00%	0,00%	5,00%	24.957.701,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	15,00%	31.031.058,71	5,85%	0,00%	8,00%	15,00%	48.563.665,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	10,00%	779.511,02	0,15%	0,00%	1,00%	5,00%	25.752.063,70
Total Renda Fixa	100,00%	266.097.891,16	50,15%	0,00%	50,00%	450,00%	



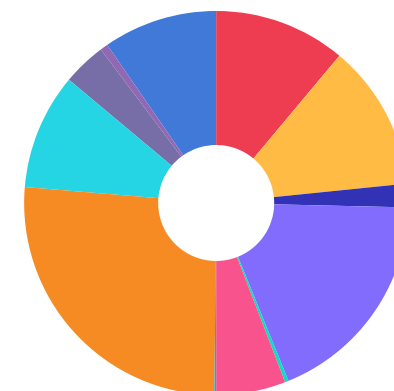
RENDA FIXA 266.097.891,16
RENDA VARIÁVEL 213.578.406,16
EXTERIOR 50.955.196,84

ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

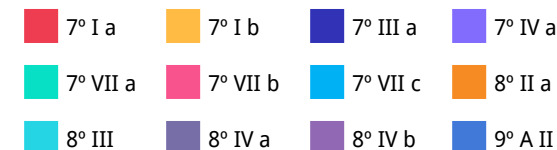


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	212.252.597,73
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	212.252.597,73
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	138.901.487,35	26,18%	0,00%	25,00%	30,00%	20.287.960,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	159.189.448,30
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	51.832.965,94	9,77%	0,00%	10,00%	10,00%	1.230.183,49
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	19.364.167,61	3,65%	0,00%	5,00%	5,00%	7.167.407,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	3.479.785,63	0,66%	0,00%	0,00%	10,00%	49.583.363,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	26.531.574,72
Total Renda Variável	40,00%	213.578.406,53	40,25%	0,00%	40,00%	170,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	53.063.149,43
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	50.955.196,63	9,60%	0,00%	10,00%	10,00%	2.107.952,80
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	53.063.149,43
Total Exterior	10,00%	50.955.196,63	9,60%	0,00%	10,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	95.318.286,69	17,96	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	64.842.827,55	12,22	0,01
WESTERN ASSET	61.295.138,85	11,55	0,12
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	58.835.452,78	11,09	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	57.034.834,48	10,75	0,21
ICATU VANGUARDA	46.530.485,23	8,77	0,11
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	42.482.467,51	8,01	0,01
XP ASSET MANAGEMENT	26.368.008,73	4,97	0,75
OCCAM BRASIL	19.355.255,37	3,65	0,06
BV ASSET	13.766.086,50	2,59	0,03
GENIAL INVESTIMENTOS	12.401.483,96	2,34	0,14
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	10.508.792,95	1,98	0,13
KINEA INVESTIMENTOS	9.670.993,42	1,82	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	7.695.989,08	1,45	0,16
PLANNER CORRETORA	2.951.517,97	0,56	0,03
PETRA CAPITAL	1.482.298,13	0,28	0,02
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIRO...	45.589,17	0,01	0,00
VILA RICA CAPITAL	43.271,71	0,01	0,36
PLURAL	2.714,24	0,00	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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
130% do CDI (Benchmark)	0,40%	1,66%	1,03%	1,66%	2,97%	9,17%	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	-0,96%	13,46%	3,07%	13,46%	11,86%	6,72%	0,77%	0,16%

CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,60%	2,99%	1,64%	2,99%	5,84%	14,60%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,10%	-12,00%	-9,82%	-12,00%	1.065,29%	603,93%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-29,46%	-2,79%	-17,91%	-2,79%	123,96%	653,17%	-	-

IMA Geral (Benchmark)	0,35%	0,14%	1,48%	0,14%	3,55%	10,30%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,22%	2,43%	2,28%	2,43%	8,85%	15,13%	1,64%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,42%	-0,72%	2,14%	-0,72%	7,42%	12,74%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	-0,83%	2,12%	-0,83%	7,12%	11,94%	2,44%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	2,19%	1,51%	2,19%	6,18%	12,84%	0,84%	0,01%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,33%	-2,28%	1,69%	-2,28%	-0,01%	4,76%	1,91%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,33%	-2,27%	1,69%	-2,27%	0,02%	5,15%	1,91%	0,06%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,72%	-5,19%	2,10%	-5,19%	0,67%	2,91%	2,92%	0,10%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,41%	-1,02%	2,10%	-1,02%	6,78%	12,11%	2,58%	0,08%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,27%	-3,31%	1,97%	-3,31%	5,04%	12,40%	2,91%	0,10%

CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	---	---

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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,76%	0,53%	0,76%	1,16%	4,70%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,11%	0,72%	0,83%	0,72%	2,29%	-	0,73%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	-0,39%	1,36%	-0,39%	3,22%	-	1,46%	0,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,07%	0,66%	1,44%	0,66%	5,83%	14,23%	1,64%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,25%	1,43%	1,62%	1,43%	5,94%	16,72%	1,46%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	1,24%	1,60%	1,24%	5,75%	14,64%	1,30%	0,02%
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,16%	-4,21%	-3,63%	-4,21%	-7,40%	-15,22%	0,01%	0,12%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	1,22%	-24,01%	-0,75%	-24,01%	-75,25%	-	0,17%	0,53%
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 TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	2,19%	1,51%	2,19%	7,05%	16,62%	0,84%	0,01%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,04%	-1,22%	1,74%	-1,22%	-29,16%	-27,00%	1,35%	0,32%

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 + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,71%	11,09%	5,24%	11,09%	24,53%	46,34%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-0,11%	-12,85%	-24,80%	-12,85%	-7,58%	16,99%	0,00%	0,31%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,18%	7,74%	3,62%	7,74%	16,98%	29,07%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,18%	8,19%	1,03%	8,19%	-	-	-	-
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,02%	6,76%	3,15%	6,76%	14,82%	24,33%	-	-
NOVA RAPOSO MULTIESTRATÉGIA FIP - NVRP11	-0,13%	-0,76%	-0,37%	-0,76%	-1,18%	9,33%	0,00%	0,00%
IBX (Benchmark)	0,63%	8,82%	9,61%	8,82%	36,33%	29,97%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1,61%	13,29%	13,74%	13,29%	37,58%	47,53%	4,22%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,48%	7,71%	11,21%	7,71%	25,92%	21,09%	4,00%	0,18%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,63%	3,27%	6,34%	3,27%	16,98%	9,63%	5,10%	0,20%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,42%	2,04%	2,34%	2,04%	9,82%	17,45%	1,49%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

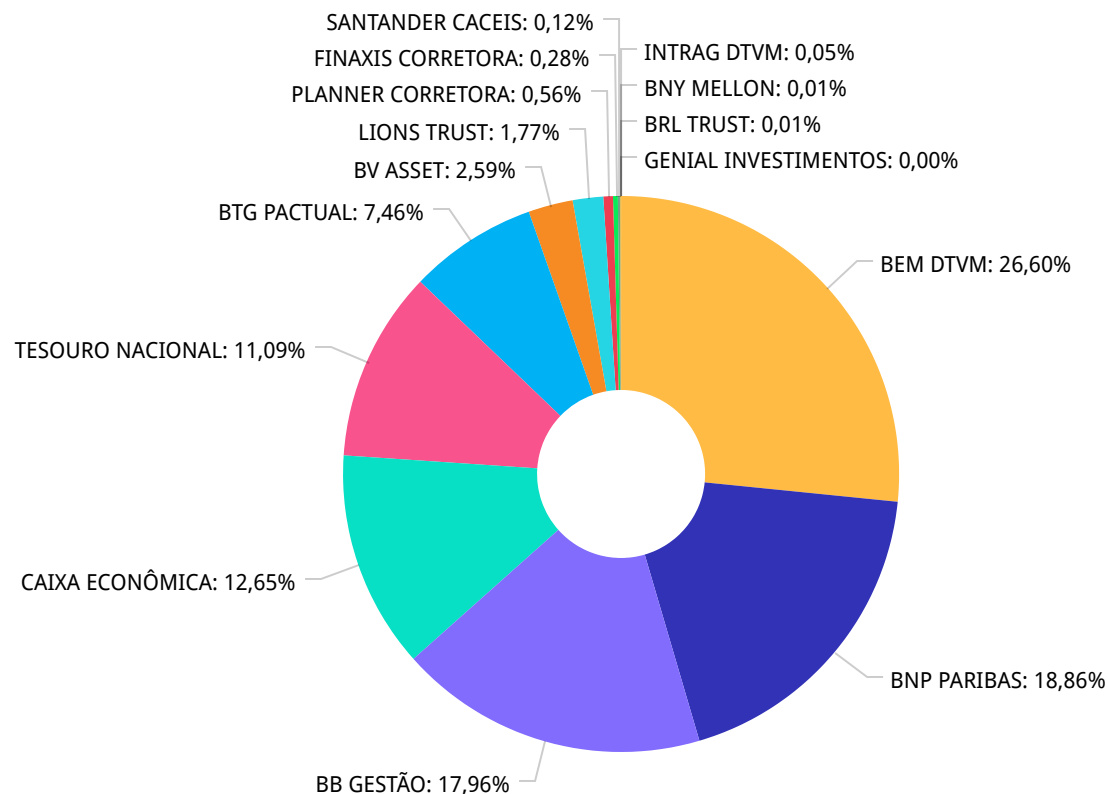
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUSTENTÁVEL II FIP - ESUD11	-0,16%	-27,24%	-0,49%	-27,24%	-23,55%	-22,98%	0,00%	0,25%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,53%	-	-1,55%	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,29%	4,47%	6,02%	4,47%	22,94%	33,78%	5,78%	0,14%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-2,29%	-8,72%	-1,22%	-8,72%	-12,35%	-16,07%	3,67%	0,12%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	-4,20%	-24,93%	-18,21%	-24,93%	-38,01%	-60,41%	21,12%	0,11%
OCCAM FIC AÇÕES	-0,48%	4,62%	7,52%	4,62%	30,15%	35,00%	5,48%	0,20%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	0,78%	4,94%	1,97%	4,94%	10,40%	-	2,63%	0,30%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FI...	-1,56%	29,31%	-1,50%	29,31%	0,25%	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,62%	13,30%	13,75%	13,30%	37,45%	-	4,22%	0,21%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	0,82%	4,32%	7,50%	4,32%	34,61%	41,56%	5,47%	0,20%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,69%	15,90%	8,70%	15,90%	38,91%	44,64%	4,66%	0,15%

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

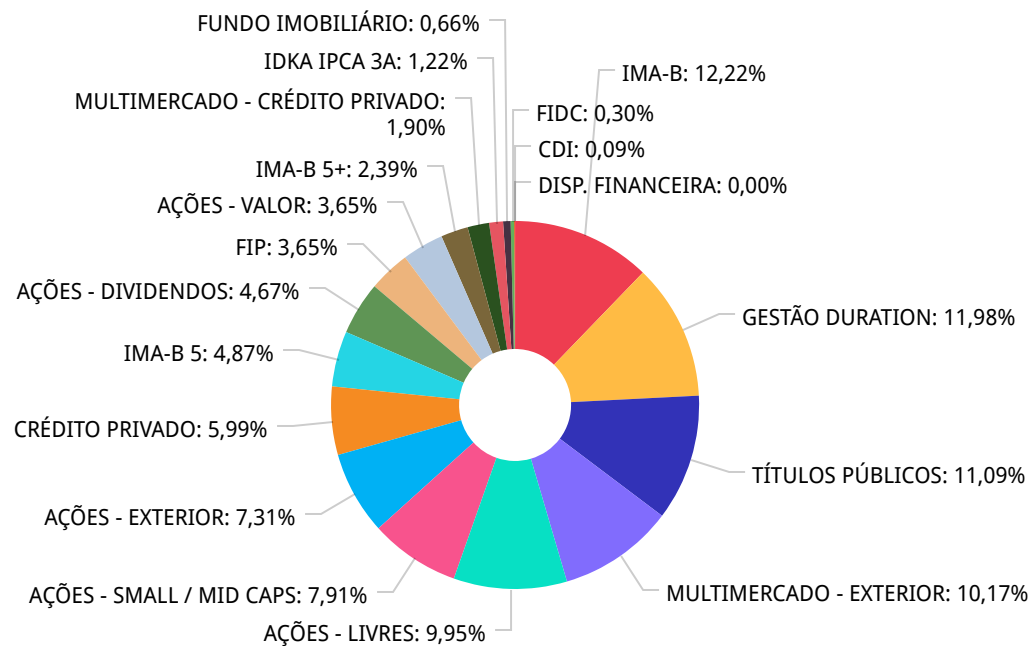
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	5,86%	12,14%	12,34%	12,14%	39,95%	-	4,75%	0,15%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	-4,05%	7,03%	-6,04%	7,03%	-	-	6,22%	-
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	8,38%	5,88%	1,67%	5,88%	-	-	9,56%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-4,62%	9,16%	-5,61%	9,16%	32,60%	90,93%	5,93%	0,17%

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



BEM DTVM	141.125.357,11
BNP PARIBAS	100.064.631,54
BB GESTÃO	95.318.286,69
CAIXA ECONÔMICA	67.121.835,49
TESOURO NACIONAL	58.835.452,78
BTG PACTUAL	39.570.082,15
BV ASSET	13.766.086,50
LIONS TRUST	9.406.917,70
PLANNER CORRETORA	2.951.517,97
FINAXIS CORRETORA	1.482.298,13
SANTANDER CACEIS	633.377,42
INTRAG DTVM	264.075,72
BNY MELLON	45.589,17
BRL TRUST	43.271,71
GENIAL INVESTIMENTOS	2.714,24

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



IMA-B	64.829.181,67
GESTÃO DURATION	63.544.626,47
TÍTULOS PÚBLICOS	58.835.452,78
MULTIMERCADO - EXTERIOR	53.960.456,42
AÇÕES - LIVRES	52.789.813,40
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	41.995.914,48
AÇÕES - EXTERIOR	38.769.492,69
CRÉDITO PRIVADO	31.810.569,73
IMA-B 5	25.863.264,58
AÇÕES - DIVIDENDOS	24.760.504,10
FIP	19.364.167,61
AÇÕES - VALOR	19.355.255,37
IMA-B 5+	12.680.552,50
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	10.058.213,46
IDKA IPCA 3A	6.483.509,41
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.479.785,63
FIDC	1.573.873,25
CDI	476.860,77
DISP. FINANCEIRA	2.255,11

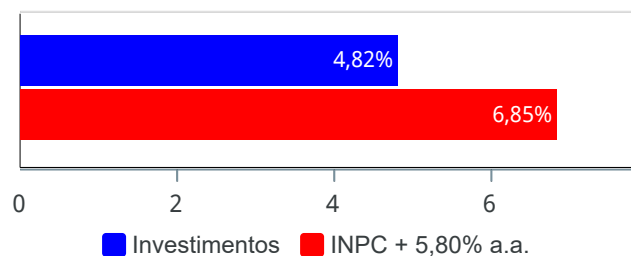
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2027	04/06/2018	8.169	981,57508630	1.003,970363	8.018.486,88	8.201.433,90	Curva
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	21/06/2018	37.673	944,42428211	964,738518	35.579.295,98	36.344.594,19	Curva
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	16/08/2018	14.670	922,885690	974,057581	13.538.733,07	14.289.424,71	Curva

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

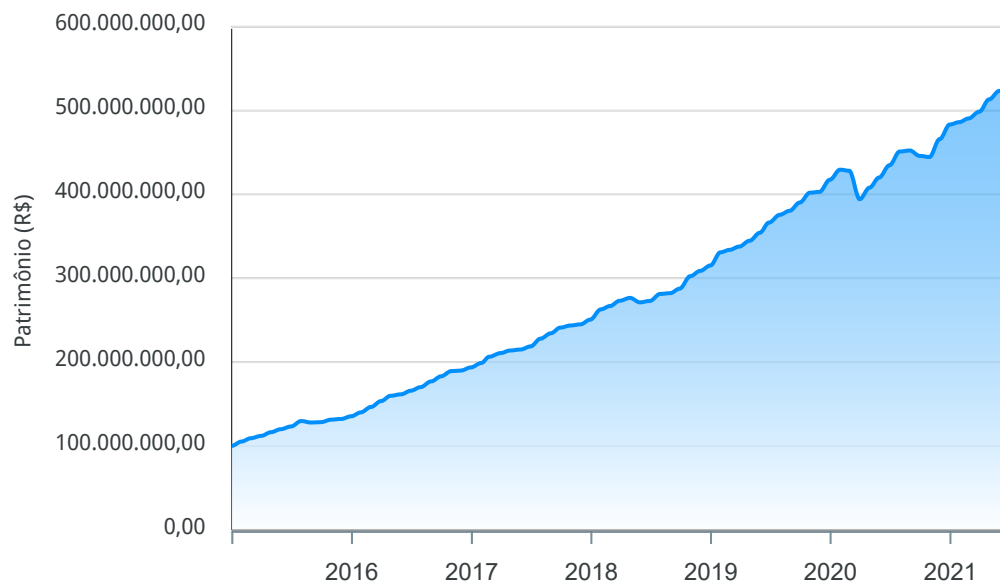
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	483.395.475,25	52.620.994,45	60.296.180,90	473.713.906,94	-2.006.381,86	-2.006.381,86	-0,42%	-0,42%	0,72%	0,72%	-57,67%	6,37%
Fevereiro	473.713.906,94	48.079.624,23	31.730.279,02	490.581.550,41	518.298,26	-1.488.083,60	0,11%	-0,31%	1,23%	1,96%	-15,84%	5,87%
Março	490.581.550,41	9.128.351,47	5.713.795,82	498.653.946,12	4.657.840,06	3.169.756,46	0,94%	0,63%	1,38%	3,36%	18,74%	7,39%
Abril	498.653.946,12	7.460.510,87	5.812.968,67	511.358.244,84	11.056.756,52	14.226.512,98	2,21%	2,85%	0,83%	4,22%	67,62%	4,08%
Mai	511.358.244,84	24.652.733,88	18.964.827,71	523.423.192,37	6.377.041,36	20.603.554,34	1,23%	4,12%	1,44%	5,72%	72,12%	5,00%
Junho	523.423.192,37	12.522.670,86	8.837.173,99	530.631.494,32	3.522.805,08	24.126.359,42	0,67%	4,82%	1,07%	6,85%	70,32%	3,48%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



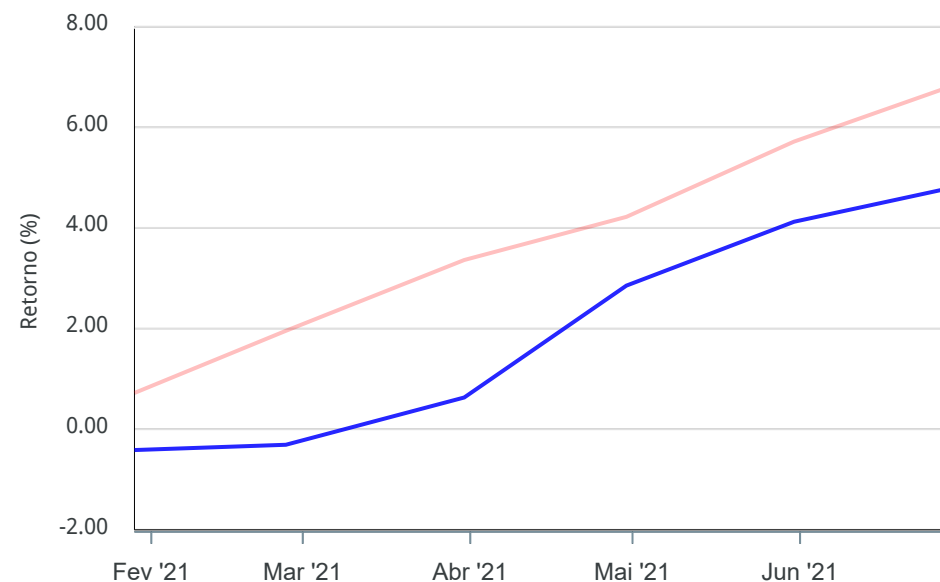
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.847,81	0,00	2.968,01	2.714,24	1.834,44	47,67%	-	-
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	770.114,04	0,00	0,00	779.511,02	9.396,98	1,22%	1,22%	0,17%
TÍTULOS PÚBLICOS	58.296.836,77	0,00	0,00	58.835.452,78	538.616,01	0,92%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	12.589.530,80	0,00	0,00	12.680.552,50	91.021,70	0,72%	0,72%	2,92%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	10.465.895,17	0,00	0,00	10.508.792,95	42.897,78	0,41%	0,41%	2,58%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.510.004,14	0,00	0,00	14.567.825,90	57.821,76	0,40%	0,40%	2,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	2.925.187,04	0,00	0,00	2.935.423,97	10.236,93	0,35%	0,35%	0,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	6.461.010,02	0,00	0,00	6.483.509,41	22.499,39	0,35%	0,35%	0,84%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	17.010.552,95	4.700.000,00	0,00	21.769.981,13	59.428,18	0,27%	0,22%	1,64%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	19.467.704,64	0,00	0,00	19.520.386,37	52.681,73	0,27%	0,27%	2,91%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	38.695.754,35	0,00	0,00	38.736.540,43	40.786,08	0,11%	0,11%	0,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	656.345,57	7.060.052,27	7.272.200,20	450.791,79	6.594,15	0,09%	0,22%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	24.606.038,62	190.000,00	0,00	24.808.086,04	12.047,42	0,05%	0,05%	1,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.909.205,71	0,00	0,00	8.912.549,09	3.343,38	0,04%	0,04%	1,30%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	21.353,70	65.208,59	60.512,62	26.068,98	19,31	0,02%	0,24%	0,01%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.136.516,91	0,00	0,00	5.134.483,36	-2.033,55	-0,04%	-0,04%	1,35%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.267.529,39	0,00	0,00	9.261.077,58	-6.451,81	-0,07%	-0,07%	1,64%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	43.315,93	0,00	0,00	43.271,71	-44,22	-0,10%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.484.687,00	0,00	0,00	1.482.298,13	-2.388,87	-0,16%	-0,16%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	15.752.638,70	0,00	0,00	15.713.318,97	-39.319,73	-0,25%	-0,25%	1,46%

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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.238.026,07	0,00	0,00	7.214.521,64	-23.504,43	-0,32%	-0,32%	1,91%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.205.392,00	0,00	0,00	6.185.144,00	-20.248,00	-0,33%	-0,33%	1,91%
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	46.028,61	0,00	0,00	45.589,17	-439,44	-0,95%	-0,95%	0,77%
Total Renda Fixa	260.563.515,94	12.015.260,86	7.335.680,83	266.097.891,16	854.795,19	0,32%		1,67%

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	40.681.400,94	0,00	0,00	41.774.752,48	1.093.351,54	2,69%	2,69%	4,66%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.067.757,94	0,00	0,00	12.262.994,65	195.236,71	1,62%	1,62%	4,22%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	29.262.171,20	0,00	0,00	29.732.919,83	470.748,63	1,61%	1,61%	4,22%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	29.672.764,50	0,00	0,00	30.054.904,32	382.139,82	1,29%	1,29%	5,78%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	7.633.775,66	0,00	0,00	7.695.989,08	62.213,42	0,81%	0,81%	5,47%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.967.096,42	0,00	0,00	15.038.920,00	71.823,58	0,48%	0,48%	4,00%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	11.511.454,08	0,00	1.500.000,00	10.058.213,46	46.759,38	0,41%	0,42%	1,49%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	8.867.264,28	507.410,00	0,00	9.406.917,70	32.243,42	0,34%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	634.063,19	0,00	0,00	633.377,42	-685,77	-0,11%	-0,11%	0,00%
NOVA RAPOSO MULTIESTRATÉGIA FIP - NVRP11	3.157.286,63	0,00	0,00	3.153.299,93	-3.986,70	-0,13%	-0,13%	0,00%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORP...	2.955.942,63	0,00	0,00	2.951.517,97	-4.424,66	-0,15%	0,78%	2,63%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUSTENTÁVEL I...	555.453,79	0,00	0,00	554.573,11	-880,68	-0,16%	-0,16%	0,00%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.283.018,06	0,00	0,00	2.279.007,94	-4.010,12	-0,18%	-	-
OCCAM FIC AÇÕES	19.448.626,45	0,00	0,00	19.355.255,37	-93.371,08	-0,48%	-0,48%	5,48%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	3.354.637,15	0,00	0,00	3.336.991,51	-17.645,64	-0,53%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	24.917.030,54	0,00	0,00	24.760.504,10	-156.526,44	-0,63%	-0,63%	5,10%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	269.385,54	0,00	1.493,16	264.191,94	-3.700,44	-1,37%	-2,29%	3,67%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	275.641,08	0,00	0,00	264.075,72	-11.565,36	-4,20%	-4,20%	21,12%
Total Renda Variável	212.514.770,08	507.410,00	1.501.493,16	213.578.406,53	2.057.719,61	0,97%		4,58%

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
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	11.442.769,74	0,00	0,00	12.401.483,96	958.714,22	8,38%	8,38%	9,56%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	13.110.275,94	0,00	0,00	13.878.136,96	767.861,02	5,86%	5,86%	4,75%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO...	13.016.640,26	0,00	0,00	12.489.871,77	-526.768,49	-4,05%	-4,05%	6,22%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	12.775.220,41	0,00	0,00	12.185.703,94	-589.516,47	-4,61%	-4,61%	5,93%
Total Exterior	50.344.906,35	0,00	0,00	50.955.196,63	610.290,28	1,21%		6,56%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	57.259.427,46	0,00	0,00	58.835.452,78	1.576.025,32	2,75%	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	19.143.810,36	0,00	0,00	19.520.386,37	376.576,01	1,97%	1,97%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	14.006.995,69	7.400.000,00	0,00	21.769.981,13	362.985,44	1,70%	2,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	24.088.555,01	390.000,00	0,00	24.808.086,04	329.531,03	1,35%	1,36%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	38.418.044,45	0,00	0,00	38.736.540,43	318.495,98	0,83%	0,83%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.265.296,23	0,00	0,00	14.567.825,90	302.529,67	2,12%	2,12%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	12.419.684,20	0,00	0,00	12.680.552,50	260.868,30	2,10%	2,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	15.870.408,83	0,00	412.481,32	15.713.318,97	255.391,46	1,61%	1,62%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	10.292.873,93	0,00	0,00	10.508.792,95	215.919,02	2,10%	2,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.772.593,44	0,00	0,00	8.912.549,09	139.955,65	1,60%	1,60%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.129.769,47	0,00	0,00	9.261.077,58	131.308,11	1,44%	1,44%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.094.333,72	0,00	0,00	7.214.521,64	120.187,92	1,69%	1,69%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.082.472,00	0,00	0,00	6.185.144,00	102.672,00	1,69%	1,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	6.387.146,99	0,00	0,00	6.483.509,41	96.362,42	1,51%	1,51%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.046.691,53	0,00	0,00	5.134.483,36	87.791,83	1,74%	1,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.891.789,45	0,00	0,00	2.935.423,97	43.634,52	1,51%	1,51%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.306,39	0,00	27.540,02	2.714,24	26.947,87	815,02%	-17,91%
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	785.370,46	0,00	29.999,97	779.511,02	24.140,53	3,07%	-0,75%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	184.110,72	18.510.968,10	18.255.841,83	450.791,79	11.554,80	0,06%	0,53%
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	44.232,07	0,00	0,00	45.589,17	1.357,10	3,07%	3,07%

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 DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	24.193,73	127.537,51	125.700,96	26.068,98	38,70	0,03%	0,57%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	47.981,98	0,00	0,00	43.271,71	-4.710,27	-9,82%	-9,82%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.538.163,82	0,00	0,00	1.482.298,13	-55.865,69	-3,63%	-3,63%
Total Renda Fixa					4.723.697,72	1,81%	

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	26.141.421,40	0,00	0,00	29.732.919,83	3.591.498,43	13,74%	13,74%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	36.796.669,31	1.700.000,00	0,00	41.774.752,48	3.278.083,17	8,52%	8,70%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	28.349.675,34	0,00	0,00	30.054.904,32	1.705.228,98	6,01%	6,01%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.522.561,17	0,00	0,00	15.038.920,00	1.516.358,83	11,21%	11,21%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.780.777,15	0,00	0,00	12.262.994,65	1.482.217,50	13,75%	13,75%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	21.327.304,65	2.000.000,00	0,00	24.760.504,10	1.433.199,45	6,14%	6,34%
OCCAM FIC AÇÕES	18.001.053,39	0,00	0,00	19.355.255,37	1.354.201,98	7,52%	7,52%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	6.200.159,43	1.000.000,00	0,00	7.695.989,08	495.829,65	6,89%	7,50%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	11.294.508,64	0,00	1.500.000,00	10.058.213,46	263.704,82	2,33%	2,34%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	8.861.117,17	507.410,00	0,00	9.406.917,70	38.390,53	0,41%	-1,49%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORP...	2.921.439,13	0,00	0,00	2.951.517,97	30.078,84	1,03%	1,97%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.255.878,77	0,00	0,00	2.279.007,94	23.129,17	1,03%	1,03%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	265.879,86	0,00	4.479,48	264.191,94	2.791,56	1,05%	-1,22%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	23,50	0,00	27,16	0,00	3,66	15,57%	-100,00%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	842.278,64	0,00	206.935,89	633.377,42	-1.965,33	-0,23%	-24,80%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUSTENTÁVEL I...	557.298,77	0,00	0,00	554.573,11	-2.725,66	-0,49%	-0,49%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	326.721,42	0,00	51.963,74	264.075,72	-10.681,96	-3,27%	-18,21%
NOVA RAPOSO MULTISTRATÉGIA FIP - NVRP11	3.165.090,77	0,00	0,00	3.153.299,93	-11.790,84	-0,37%	-0,37%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	3.389.576,54	0,00	0,00	3.336.991,51	-52.585,03	-1,55%	-1,55%

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
				Total Renda Variável	15.134.967,75	7,63%	

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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	24.749.825,84	0,00	13.000.000,00	13.878.136,96	2.128.311,12	8,60%	12,34%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	12.197.246,60	0,00	0,00	12.401.483,96	204.237,36	1,67%	1,67%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO...	0,00	13.000.000,00	0,00	12.489.871,77	-510.128,23	-3,92%	-6,04%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	12.910.186,70	0,00	0,00	12.185.703,94	-724.482,76	-5,61%	-5,61%
			Total Exterior		1.097.937,49	1,75%	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	58.702.269,79	0,00	2.953.521,12	58.835.452,78	3.086.704,11	5,26%	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	13.986.034,88	7.400.000,00	0,00	21.769.981,13	383.946,25	1,80%	2,43%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	62.887.951,15	0,00	24.388.483,06	38.736.540,43	237.072,34	0,38%	0,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	15.900.103,81	0,00	412.481,32	15.713.318,97	225.696,48	1,42%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	6.509.266,37	0,00	165.533,39	6.483.509,41	139.776,43	2,15%	2,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.032.918,42	0,00	230.345,57	8.912.549,09	109.976,24	1,22%	1,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.950.483,35	0,00	78.390,26	2.935.423,97	63.330,88	2,15%	2,19%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.200.816,92	0,00	0,00	9.261.077,58	60.260,66	0,65%	0,65%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.198.033,18	0,00	122.659,30	5.134.483,36	59.109,48	1,14%	-1,22%
BTG PACTUAL INFRA-B FI INFRA RENDA FIXA	1.025.815,44	0,00	301.999,97	779.511,02	55.695,55	5,43%	-24,01%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.792,24	0,00	31.615,92	2.714,24	31.537,92	1.129,48%	-2,79%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	897.293,00	62.940.821,29	63.408.136,42	450.791,79	20.813,92	0,03%	0,76%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.382.563,66	0,00	178.833,06	7.214.521,64	10.791,04	0,15%	-2,28%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.329.052,00	0,00	152.448,19	6.185.144,00	8.540,19	0,13%	-2,27%
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	40.180,01	0,00	0,00	45.589,17	5.409,16	13,46%	13,46%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	37.466,71	10.826.654,47	10.839.530,48	26.068,98	1.478,28	0,01%	0,85%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	49.170,52	0,00	971,36	43.271,71	-4.927,45	-10,02%	-12,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.547.434,70	0,00	0,00	1.482.298,13	-65.136,57	-4,21%	-4,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	24.890.000,00	0,00	24.808.086,04	-81.913,96	-0,33%	-0,39%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	10.617.050,58	0,00	0,00	10.508.792,95	-108.257,63	-1,02%	-1,02%

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
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.689.820,30	0,00	0,00	14.567.825,90	-121.994,40	-0,83%	-0,83%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	13.374.399,50	0,00	295.085,24	12.680.552,50	-398.761,76	-2,98%	-5,19%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	20.187.667,83	0,00	0,00	19.520.386,37	-667.281,46	-3,31%	-3,31%
				Total Renda Fixa	3.051.865,70	1,16%	

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	31.633.286,43	4.700.000,00	0,00	41.774.752,48	5.441.466,05	14,98%	15,90%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	26.245.396,64	0,00	0,00	29.732.919,83	3.487.523,19	13,29%	13,29%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	6.750.456,59	507.410,00	0,00	9.406.917,70	2.149.051,11	29,61%	29,30%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.823.749,11	0,00	0,00	12.262.994,65	1.439.245,54	13,30%	13,30%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	28.768.642,68	0,00	0,00	30.054.904,32	1.286.261,64	4,47%	4,47%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.961.904,51	0,00	0,00	15.038.920,00	1.077.015,49	7,71%	7,71%
OCCAM FIC AÇÕES	9.786.914,20	8.700.000,00	0,00	19.355.255,37	868.341,17	4,70%	4,62%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	21.962.375,76	2.000.000,00	0,00	24.760.504,10	798.128,34	3,33%	3,27%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	0,00	7.000.000,00	0,00	7.695.989,08	695.989,08	9,94%	4,32%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	2.784.731,93	0,00	0,00	3.336.991,51	552.259,58	19,83%	-
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	11.327.978,04	0,00	1.500.000,00	10.058.213,46	230.235,42	2,03%	2,04%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.106.402,64	0,00	0,00	2.279.007,94	172.605,30	8,19%	8,19%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	726.724,24	0,00	206.935,89	633.377,42	113.589,07	15,63%	-12,84%
OURO VERDE DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORP...	2.838.805,32	0,00	0,00	2.951.517,97	112.712,65	3,97%	4,94%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	105,92	0,00	27,16	0,00	-78,76	-74,36%	-100,00%
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	346.960,80	0,00	78.976,47	264.075,72	-3.908,61	-1,13%	-24,93%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	288.114,96	0,00	9.251,93	264.191,94	-14.671,09	-5,09%	-8,72%
NOVA RAPOSO MULTIESTRATÉGIA FIP - NVRP11	3.177.578,38	0,00	0,00	3.153.299,93	-24.278,45	-0,76%	-0,76%
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUSTENTÁVEL I...	718.206,93	0,00	0,00	554.573,11	-163.633,82	-22,78%	-27,24%

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
				Total Renda Variável	18.217.852,90	9,33%	

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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	37.434.975,96	0,00	26.000.000,00	13.878.136,96	2.443.161,00	6,53%	12,14%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	11.163.579,85	0,00	0,00	12.185.703,94	1.022.124,09	9,16%	9,16%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	0,00	12.500.000,00	0,00	12.401.483,96	-98.516,04	-0,79%	5,87%
NORDEA GLOBAL STARS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO...	0,00	13.000.000,00	0,00	12.489.871,77	-510.128,23	-3,92%	7,02%
			Total Exterior		2.856.640,82	3,86%	

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.