

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)

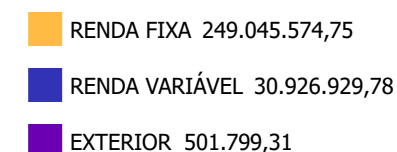
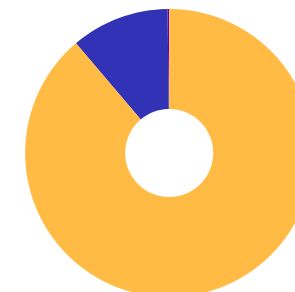
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	26.339.591,42	9,39%	992	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	7.143.658,78	2,55%	662	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	229.568,42	0,08%	124	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.214.431,18	2,22%	1.169	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	46.695.360,58	16,65%	974	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	40.784.324,73	14,54%	1.044	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.358.471,21	5,48%	1.007	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	934.309,00	0,33%	310	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	16.194.672,71	5,77%	883	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	7.819.973,28	2,79%	204	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	20.862.086,83	7,44%	1.309	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.193.669,35	0,43%	298	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	26.887.368,66	9,59%	572	0,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	6.726.030,44	2,40%	659	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.898.634,17	1,75%	138	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	20.763.423,99	7,40%	691	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	12.588.634,64	4,49%	2.840	1,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	293.974,72	0,10%	25.862	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	891.634,53	0,32%	56.940	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	296.472,47	0,11%	112	0,05%	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	Enquadramento
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	9.480.143,96	3,38%	133	1,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	307.979,75	0,11%	47.982	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.068.089,71	2,52%	16.692	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	306.821,75	0,11%	77	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	194.977,56	0,07%	427	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		42.561,76	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			280.474.303,84				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			42.561,76	Artigo 6º			
PL Total			280.516.865,60				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Junho / 2021)

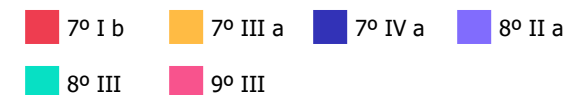
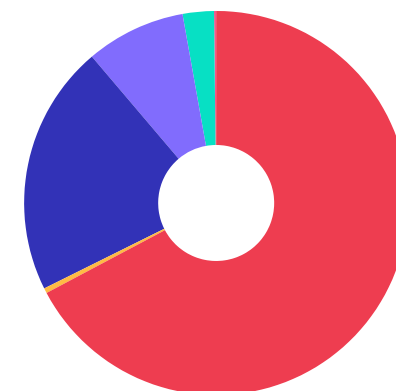
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	188.576.448,14	67,23%	11,00%	54,00%	90,00%	63.850.425,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.193.669,35	0,43%	0,00%	0,49%	1,00%	1.611.073,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	59.275.457,26	21,13%	4,00%	20,51%	40,00%	52.914.264,28
Total Renda Fixa	100,00%	249.045.574,75	88,79%	15,00%	75,00%	131,00%	



Enquadramento 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%	5,00%	10,00%	28.047.430,38
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	23.550.860,32	8,40%	4,00%	15,00%	20,00%	32.544.000,45
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.376.069,46	2,63%	2,00%	5,00%	10,00%	20.671.360,92
Total Renda Variável	30,00%	30.926.929,78	11,03%	6,00%	25,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.023.715,19
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	501.799,31	0,18%	0,00%	0,00%	5,00%	13.521.915,88
Total Exterior	10,00%	501.799,31	0,18%	0,00%	0,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	192.544.609,55	68,65	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	87.929.694,29	31,35	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 '	0,00	0,00	11,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	4,00	40,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	4,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	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
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%
IMA Geral (Benchmark)	0,35%	0,14%	1,48%	0,14%	3,55%	10,30%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,30%	-0,45%	1,25%	-0,45%	2,70%	8,96%	1,04%	0,03%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	-0,55%	1,18%	-0,55%	2,42%	8,56%	1,03%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,83%	-2,55%	2,69%	-2,55%	8,52%	10,66%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	-2,66%	2,63%	-2,66%	8,33%	10,03%	3,45%	0,13%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,21%	0,81%	0,68%	0,81%	2,04%	8,17%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,66%	0,60%	0,66%	1,65%	7,46%	0,16%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	0,70%	0,64%	0,70%	1,82%	7,71%	0,16%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
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%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,43%	-0,83%	2,13%	-0,83%	7,16%	12,05%	2,41%	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%
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,33%	1,32%	0,82%	1,32%	2,35%	6,51%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00%	0,72%	0,90%	0,72%	2,68%	12,77%	0,97%	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%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,11%	0,72%	0,83%	0,72%	2,29%	-	0,73%	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
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%

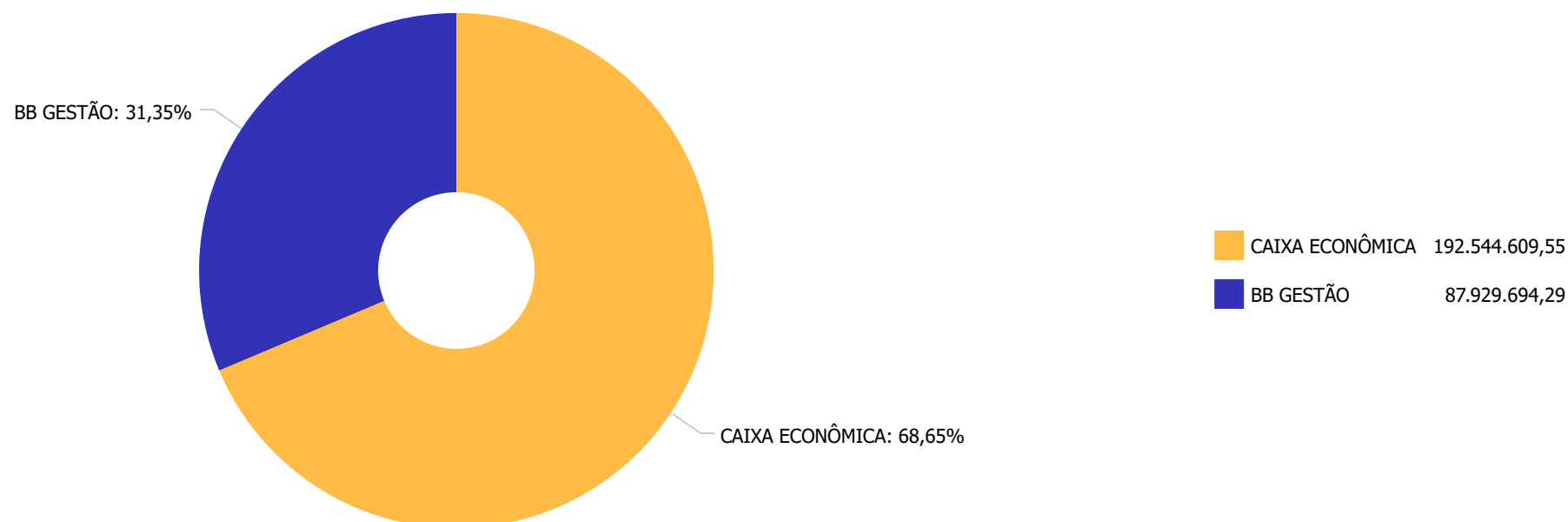
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-0,48%	5,60%	8,51%	5,60%	28,59%	35,83%	5,47%	0,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,80%	5,81%	7,62%	5,81%	39,67%	43,84%	5,55%	0,25%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-0,26%	12,99%	10,48%	12,99%	34,12%	41,19%	4,50%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,77%	4,52%	7,31%	4,52%	35,20%	28,53%	5,64%	0,25%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,87%	19,92%	15,78%	19,92%	42,88%	-	6,80%	0,19%

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%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,01%	1,19%	1,15%	1,19%	3,57%	8,86%	0,55%	0,03%

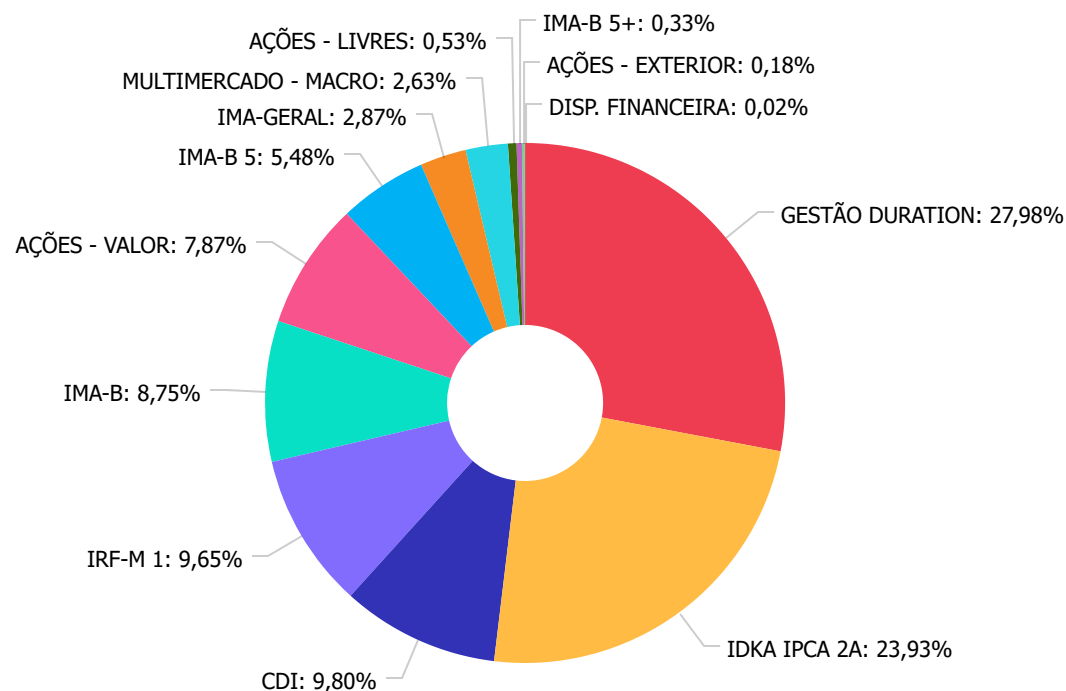
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
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)



GESTÃO DURATION	78.481.363,41
IDKA IPCA 2A	67.123.916,15
CDI	27.489.454,43
IRF-M 1	27.076.518,01
IMA-B	24.532.000,84
AÇÕES - VALOR	22.068.778,60
IMA-B 5	15.358.471,21
IMA-GERAL	8.049.541,70
MULTIMERCADO - MACRO	7.376.069,46
AÇÕES - LIVRES	1.482.081,72
IMA-B 5+	934.309,00
AÇÕES - EXTERIOR	501.799,31
DISP. FINANCEIRA	42.561,76

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

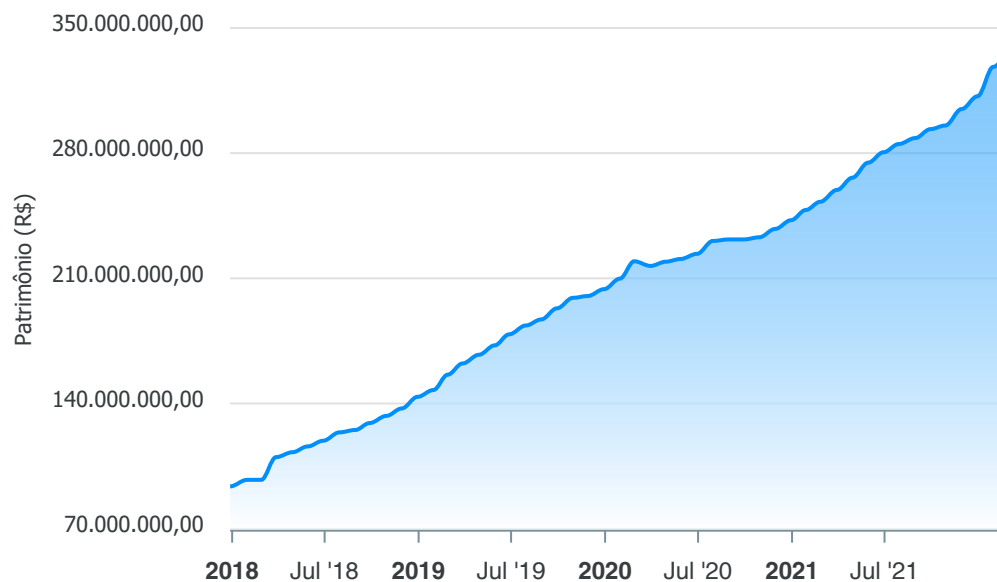
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	239.225.945,48	8.223.206,00	1.805.524,64	244.832.827,86	-810.798,98	-810.798,98	-0,33%	-0,33%	0,67%	0,67%	-49,26%	1,73%
Fevereiro	244.832.827,86	7.668.269,91	1.827.181,92	248.569.408,07	-2.104.507,78	-2.915.306,76	-0,84%	-1,17%	1,24%	1,92%	-60,81%	1,77%
Março	248.569.408,07	7.383.776,47	1.742.429,47	255.739.170,99	1.528.415,92	-1.386.890,84	0,60%	-0,57%	1,42%	3,36%	-17,03%	2,15%
Abril	255.739.170,99	6.438.699,63	1.770.574,18	262.465.588,06	2.058.291,62	671.400,78	0,79%	0,21%	0,73%	4,12%	5,18%	1,48%
Mai	262.465.588,06	7.556.616,13	1.684.331,11	270.906.930,44	2.569.057,36	3.240.458,14	0,96%	1,17%	1,27%	5,44%	21,54%	1,48%
Junho	270.906.930,44	7.479.782,33	1.621.365,87	276.724.649,17	-40.697,73	3.199.760,41	-0,01%	1,16%	0,97%	6,47%	17,90%	1,53%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

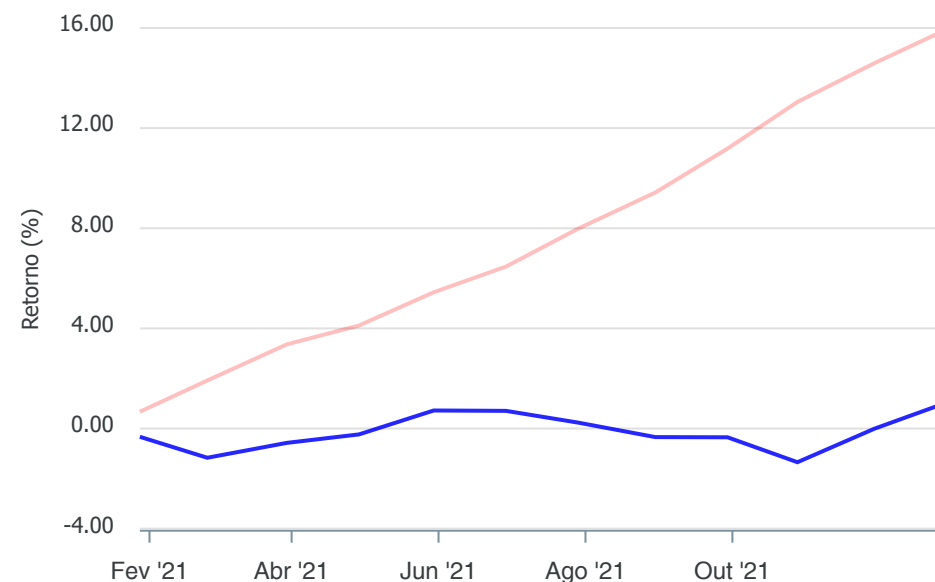
Evolução do Patrimônio



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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	927.150,00	0,00	0,00	934.309,00	7.159,00	0,77%	0,77%	3,45%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.188.552,03	0,00	0,00	1.193.669,35	5.117,32	0,43%	0,43%	2,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	16.129.932,81	0,00	0,00	16.194.672,71	64.739,90	0,40%	0,40%	2,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.116.923,65	0,00	0,00	7.143.658,78	26.735,13	0,38%	0,38%	2,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.703.981,20	0,00	0,00	6.726.030,44	22.049,24	0,33%	0,33%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	7.796.988,21	0,00	0,00	7.819.973,28	22.985,07	0,29%	0,29%	1,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	22.043.100,74	0,00	1.343.383,18	20.763.423,99	63.706,43	0,29%	0,31%	0,04%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	228.961,24	0,00	0,00	229.568,42	607,18	0,27%	0,27%	1,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.117.445,34	0,00	294.734,20	20.862.086,83	39.375,69	0,19%	0,19%	0,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.213.856,97	0,00	10.611,40	6.214.431,18	11.185,61	0,18%	0,18%	0,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	22.456.234,81	4.400.000,00	0,00	26.887.368,66	31.133,85	0,12%	0,05%	1,46%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.893.476,34	0,00	0,00	4.898.634,17	5.157,83	0,11%	0,11%	0,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	46.696.768,88	0,00	0,00	46.695.360,58	-1.408,30	0,00%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	26.364.244,23	0,00	0,00	26.339.591,42	-24.652,81	-0,09%	-0,09%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.381.498,75	0,00	0,00	15.358.471,21	-23.027,54	-0,15%	-0,15%	1,53%
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	40.897.733,62	0,00	0,00	40.784.324,73	-113.408,89	-0,28%	-0,28%	1,53%
Total Renda Fixa	246.156.848,82	4.400.000,00	1.648.728,78	249.045.574,75	137.454,71	0,06%		1,15%

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 MACRO FIC MULTIMERCADO LP	308.023,28	0,00	0,00	307.979,75	-43,53	-0,01%	-0,01%	0,55%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.080.035,13	0,00	0,00	7.068.089,71	-11.945,42	-0,17%	-0,15%	1,32%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	894.717,69	0,00	891.634,53	-3.083,16	-0,34%	-0,26%	4,50%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	9.525.497,56	0,00	0,00	9.480.143,96	-45.353,60	-0,48%	-0,48%	5,47%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	11.606.541,73	1.095.386,08	0,00	12.588.634,64	-113.293,17	-0,89%	-0,77%	5,64%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	296.472,47	-3.527,53	-1,18%	-0,87%	6,80%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	293.974,72	-6.025,28	-2,01%	-0,80%	5,55%
Total Renda Variável	28.520.097,70	2.590.103,77	0,00	30.926.929,78	-183.271,69	-0,59%		4,53%

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	0,00	189.678,56	0,00	194.977,56	5.299,00	2,79%	-1,19%	5,33%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	300.000,00	0,00	306.821,75	6.821,75	2,27%	-2,25%	4,97%
Total Exterior	0,00	489.678,56	0,00	501.799,31	12.120,75	2,48%		5,11%

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	40.146.604,76	0,00	0,00	40.784.324,73	637.719,97	1,59%	1,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	46.278.043,54	0,00	0,00	46.695.360,58	417.317,04	0,90%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	25.367.573,97	608.306,22	0,00	26.339.591,42	363.711,23	1,40%	1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	15.863.515,23	0,00	0,00	16.194.672,71	331.157,48	2,09%	2,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.680.541,55	11.956.616,13	0,00	26.887.368,66	250.210,98	0,94%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.148.693,53	0,00	0,00	15.358.471,21	209.777,68	1,38%	1,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.022.554,79	911.000,00	1.343.383,18	20.763.423,99	173.252,38	0,79%	0,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.997.252,00	0,00	0,00	7.143.658,78	146.406,78	2,09%	2,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.580.473,56	0,00	854.031,33	20.862.086,83	135.644,60	0,63%	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	7.723.622,61	0,00	0,00	7.819.973,28	96.350,67	1,25%	1,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.864.284,12	4.813.924,12	0,00	6.726.030,44	47.822,20	0,72%	0,81%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.858.357,08	0,00	0,00	4.898.634,17	40.277,09	0,83%	0,83%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.008.878,88	110.000,00	2.944.333,98	6.214.431,18	39.886,28	0,44%	0,60%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.168.738,37	0,00	0,00	1.193.669,35	24.930,98	2,13%	2,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	910.330,99	0,00	0,00	934.309,00	23.978,01	2,63%	2,63%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	226.889,61	0,00	0,00	229.568,42	2.678,81	1,18%	1,18%
			Total Renda Fixa		2.941.122,18	1,20%	

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.630.809,86	1.200.855,37	0,00	12.588.634,64	756.969,41	6,40%	7,31%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.736.412,96	0,00	0,00	9.480.143,96	743.731,00	8,51%	8,51%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.902.668,55	0,00	0,00	7.068.089,71	165.421,16	2,40%	2,40%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	189.678,56	0,00	194.977,56	5.299,00	2,79%	-4,36%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	304.482,25	0,00	0,00	307.979,75	3.497,50	1,15%	1,15%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	894.717,69	0,00	891.634,53	-3.083,16	-0,34%	10,48%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	296.472,47	-3.527,53	-1,18%	15,78%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	293.974,72	-6.025,28	-2,01%	7,62%
Total Renda Variável					1.662.282,10	5,64%	

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	300.000,00	0,00	306.821,75	6.821,75	2,27%	-4,45%
Total Exterior					6.821,75	2,27%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	39.542.547,97	613.035,94	0,00	40.784.324,73	628.740,82	1,57%	1,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	24.464.251,12	1.512.133,69	0,00	26.339.591,42	363.206,61	1,40%	1,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	44.357.225,70	2.000.000,00	0,00	46.695.360,58	338.134,88	0,73%	0,72%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.199.420,33	911.000,00	1.591.762,98	20.763.423,99	244.766,64	1,11%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.568.713,61	4.603.388,77	0,00	15.358.471,21	186.368,83	1,23%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.991.200,84	125.000,00	4.401.249,39	20.862.086,83	147.135,38	0,59%	0,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.233.730,22	5.436.837,93	0,00	6.726.030,44	55.462,29	0,83%	1,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	5.645.568,27	21.191.606,51	0,00	26.887.368,66	50.193,88	0,19%	-0,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	10.287.297,80	453.847,34	4.571.845,93	6.214.431,18	45.131,97	0,42%	0,65%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	4.863.680,08	0,00	0,00	4.898.634,17	34.954,09	0,72%	0,72%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	230.835,06	0,00	0,00	229.568,42	-1.266,64	-0,55%	-0,55%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.203.618,22	0,00	0,00	1.193.669,35	-9.948,87	-0,83%	-0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	959.791,30	0,00	0,00	934.309,00	-25.482,30	-2,65%	-2,65%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	7.854.995,30	0,00	0,00	7.819.973,28	-35.022,02	-0,45%	-0,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.202.582,14	0,00	0,00	7.143.658,78	-58.923,36	-0,82%	-0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	16.331.071,16	0,00	0,00	16.194.672,71	-136.398,45	-0,84%	-0,84%
Total Renda Fixa					1.827.053,75	0,74%	

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6.804.249,84	5.164.678,00	0,00	12.588.634,64	619.706,80	5,18%	4,52%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	7.585.433,27	1.333.273,38	0,00	9.480.143,96	561.437,31	6,30%	5,60%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.854.311,47	0,00	0,00	7.068.089,71	213.778,24	3,12%	3,12%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	189.678,56	0,00	194.977,56	5.299,00	2,79%	8,36%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	304.371,78	0,00	0,00	307.979,75	3.607,97	1,19%	1,19%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	894.717,69	0,00	891.634,53	-3.083,16	-0,34%	12,99%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	296.472,47	-3.527,53	-1,18%	19,92%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	293.974,72	-6.025,28	-2,01%	5,81%
Total Renda Variável					1.391.193,35	4,68%	

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	300.000,00	0,00	306.821,75	6.821,75	2,27%	8,51%
Total Exterior					6.821,75	2,27%	

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 4.963/2021, 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 4.963 de 25 de novembro de 2021 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.