

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2021

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 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	14.853.688,99	6,43%	1.007	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.894.284,03	5,58%	758	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+1	Não há	4.609.610,75	2,00%	661	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.507.156,78	1,09%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.400.323,16	0,61%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.564.878,00	0,68%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	32.431.525,23	14,04%	984	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA ZA TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.400.464,51	7,10%	1.050	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.511.625,80	7,15%	1.014	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.723.146,07	2,48%	1.303	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	21.908.878,16	9,48%	582	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.217.171,61	2,69%	797	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.993.247,48	2,16%	197	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	168.191,17	0,07%	491	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.614.753,42	2,86%	111	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.254.621,27	0,98%	66	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.812.739,35	1,65%	251	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.018.938,70	0,44%	138	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	556.946,64	0,24%	2.069	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.084.063,22	0,90%	74	0,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

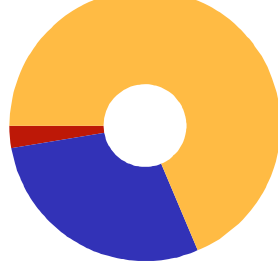
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	11.197.098,33	4,85%	2.778	0,94%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.482.375,50	1,51%	182	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.381.965,90	1,46%	6.005	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.903.113,56	1,69%	2.359	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	4.481.943,39	1,94%	175	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.178.420,32	0,94%	138	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.277.625,83	1,42%	5.535	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.785.024,97	1,21%	14.945	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.239.238,18	1,40%	36.608	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAU INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	3.093.524,26	1,34%	18	0,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.621.628,21	1,57%	111	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.680.514,90	1,16%	200	0,74%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.525.376,99	2,39%	17.008	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	6.297.633,14	2,73%	128	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	724.836,39	0,31%	17.306	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.387.277,04	1,03%	16.719	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	3.242.070,93	1,40%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	742.500,00	0,32%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	1.995.638,13	0,86%	98	0,09%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	2.018.237,00	0,87%	90	0,17%	Artigo 9º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	1.047.769,32	0,45%	1.106	0,56%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	597.547,97	0,26%	86	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	600.021,21	0,26%	454	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.789.088,53	0,77%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			231.027.635,81				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.789.088,53				Artigo 6º
PL Total			232.816.724,34				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2021)

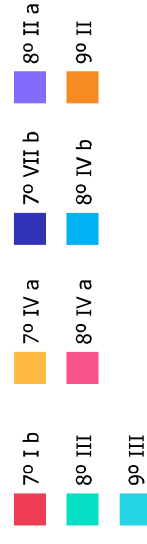
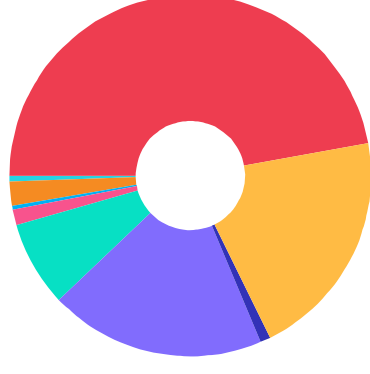
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	108.896.703,32	47,14%	10,97%	54,86%	68,57%	49.518.946,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	47.545.487,80	20,58%	3,96%	13,80%	40,00%	44.865.566,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	2.084.063,22	0,90%	0,00%	1,26%	1,26%	826.884,99
Total Renda Fixa	100,00%	158.526.254,34	68,62%	14,93%	69,92%	109,83%	



■ RENDA FIXA 158.526.254,34
■ RENDA VARIÁVEL 66.242.167,84
■ EXTERIOR 6.259.213,63

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	44.641.958,45	19,32%	3,58%	17,91%	20,00%	1.563.568,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	17.615.638,46	7,62%	3,14%	9,14%	10,00%	5.487.125,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	3.242.070,93	1,40%	0,00%	1,45%	1,45%	107.829,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	742.500,00	0,32%	0,00%	0,72%	0,72%	920.898,98
Total Renda Variável	30,00%	66.242.167,84	28,67%	6,72%	29,22%	32,17%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	5.061.644,45	2,19%	0,00%	0,43%	5,00%	6.489.737,34
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.197.569,18	0,52%	0,00%	0,43%	5,00%	10.353.812,61
Total Exterior	10,00%	6.259.213,63	2,71%	0,00%	0,86%	10,00%	

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	100.688.722,14	43,58	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	84.964.213,03	36,78	0,00
ITAÚ UNIBANCO	21.118.865,77	9,14	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.475.622,98	3,67	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.381.965,90	1,46	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.277.625,83	1,42	0,18
AGBI REAL ASSETS	3.242.070,93	1,40	-
ITAÚ DTVM	3.093.524,26	1,34	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	2.785.024,97	1,21	0,03

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'	0,00	0,00	10,97	68,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'	0,00	0,00	3,96	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b'	0,00	0,00	0,00	1,26
Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'a'	0,00	0,00	17,91	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a'	0,00	0,00	0,00	1,45
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	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 Julho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,18%	1,68%	0,38%	1,54%	5,88%	15,07%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,50%	0,66%	1,32%	5,61%	14,05%	0,88%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA ZA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	1,50%	0,50%	1,36%	5,46%	14,00%	0,95%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,47%	8,33%	3,86%	7,56%	15,48%	25,26%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,23%	5,60%	3,58%	4,21%	8,93%	11,76%	0,12%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,19%	1,00%	0,60%	0,96%	1,99%	7,60%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,86%	0,53%	0,84%	1,75%	7,14%	0,23%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,03%	1,31%	0,59%	1,21%	5,06%	14,34%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	1,19%	0,52%	1,09%	4,79%	13,79%	1,02%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	1,42%	0,63%	1,39%	4,75%	15,46%	0,85%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,01%	1,17%	0,53%	1,08%	4,77%	13,71%	1,00%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,37%	-1,09%	1,10%	-0,24%	2,53%	10,89%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-1,20%	1,05%	-0,34%	2,27%	10,39%	2,07%	0,06%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,24%	-1,10%	1,54%	-0,05%	2,18%	12,24%	2,09%	0,07%
CDI (Benchmark)	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,25%	1,01%	0,66%	0,93%	1,30%	4,47%	0,01%	0,00%
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,38%	1,55%	0,99%	1,38%	2,17%	6,32%	0,01%	0,00%
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,69%	1,73%	1,54%	1,85%	2,55%	-	0,33%	0,01%
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,73%	2,00%	1,52%	2,29%	3,16%	13,19%	0,50%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	1,54%	0,88%	1,34%	1,98%	6,32%	0,02%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	2,87%	1,77%	2,57%	6,86%	15,53%	0,42%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,11%	-0,50%	0,54%	-0,04%	1,16%	-	1,10%	0,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,07%	0,58%	0,39%	0,49%	4,73%	13,21%	1,11%	0,03%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,16%	1,16%	0,72%	1,03%	1,19%	6,46%	0,42%	0,01%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,20%	-1,00%	0,56%	-0,42%	0,10%	7,17%	1,03%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,78%	-0,06%	-0,54%	-0,09%	0,90%	10,67%	1,68%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	14,23%	0,22%	7,98%	30,62%	103,08%	7,99%	0,17%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,64%	9,51%	4,36%	8,57%	17,64%	30,02%	-	-
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	0,86%	3,55%	0,68%	0,42%	3,02%	29,53%	-	-
MSCI WORLD (Benchmark)	4,15%	12,45%	-1,01%	7,85%	31,07%	90,86%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	6,75%	16,53%	-0,22%	11,09%	38,64%	103,45%	8,15%	0,17%
IDIV (Benchmark)	-1,72%	0,31%	1,58%	5,67%	14,21%	18,21%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,17%	0,50%	0,79%	4,42%	14,90%	20,30%	8,11%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	-3,94%	2,34%	2,44%	5,85%	18,35%	19,63%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,32%	2,10%	2,44%	8,14%	24,15%	24,17%	8,21%	0,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-4,67%	0,89%	0,90%	2,56%	12,59%	27,40%	8,49%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-0,66%	9,23%	8,87%	12,50%	13,76%	-0,37%	9,47%	0,22%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-3,08%	8,77%	4,14%	10,39%	23,74%	22,61%	6,67%	0,17%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	-4,13%	7,13%	-0,21%	11,54%	13,75%	21,91%	7,29%	0,22%
GERAÇÃO FIC AÇÕES	-3,63%	-0,71%	1,29%	2,86%	13,11%	13,63%	8,43%	0,19%
BRADERCO SELECTION FIC AÇÕES	-4,87%	0,58%	2,94%	3,14%	16,66%	9,20%	8,64%	0,15%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,27%	1,09%	1,33%	4,37%	13,07%	26,07%	8,94%	0,21%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,57%	-0,31%	0,17%	0,31%	8,25%	22,05%	9,02%	0,13%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-4,81%	2,65%	1,63%	5,36%	11,43%	21,62%	7,73%	0,19%

CDI (Benchmark)								
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,36%	1,64%	0,94%	1,49%	2,44%	6,76%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,07%	1,33%	0,71%	1,45%	2,04%	7,76%	0,73%	0,02%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,36%	2,74%	0,90%	2,83%	5,97%	12,71%	1,59%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,47%	2,88%	0,91%	2,64%	5,14%	-	1,46%	0,05%
	-0,83%	1,44%	1,46%	2,03%	4,78%	10,52%	2,54%	0,06%

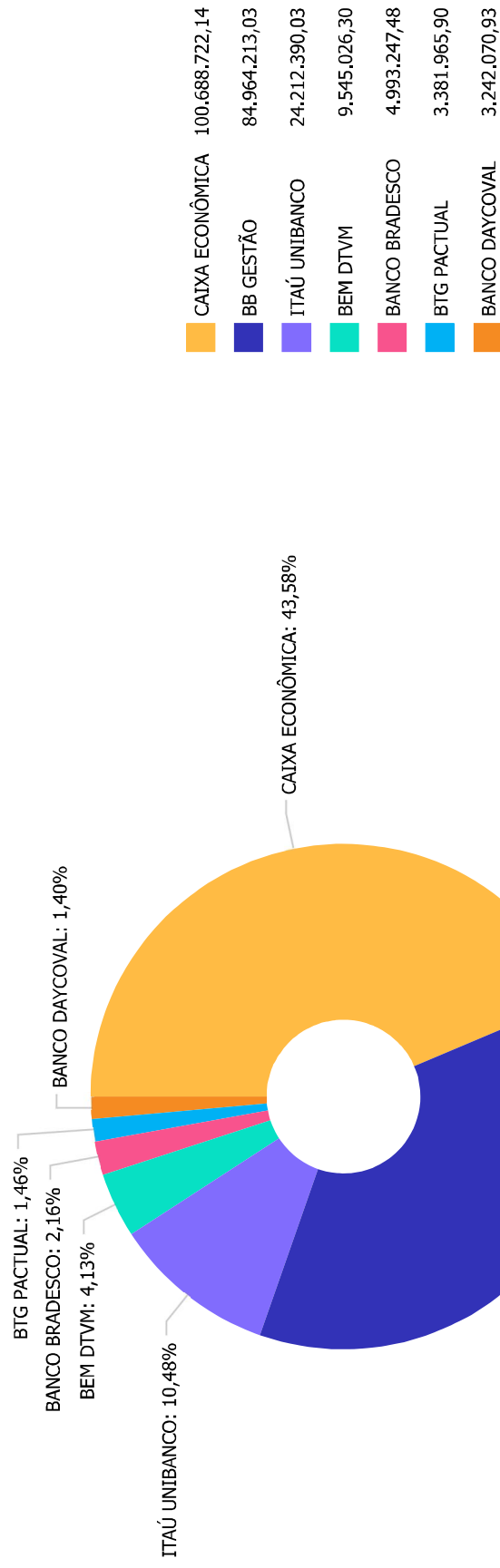
MSCI ACWI (Benchmark)								
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2,99%	10,44%	-2,20%	5,36%	29,16%	87,89%	-	-
	2,63%	19,20%	5,92%	19,27%	34,66%	45,15%	5,66%	0,14%

IFIX (Benchmark)								
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,51%	-1,60%	-1,29%	-1,92%	3,33%	6,19%	-	-
	-11,36%	-45,74%	-21,84%	-34,93%	-57,08%	-31,06%	9,70%	0,35%

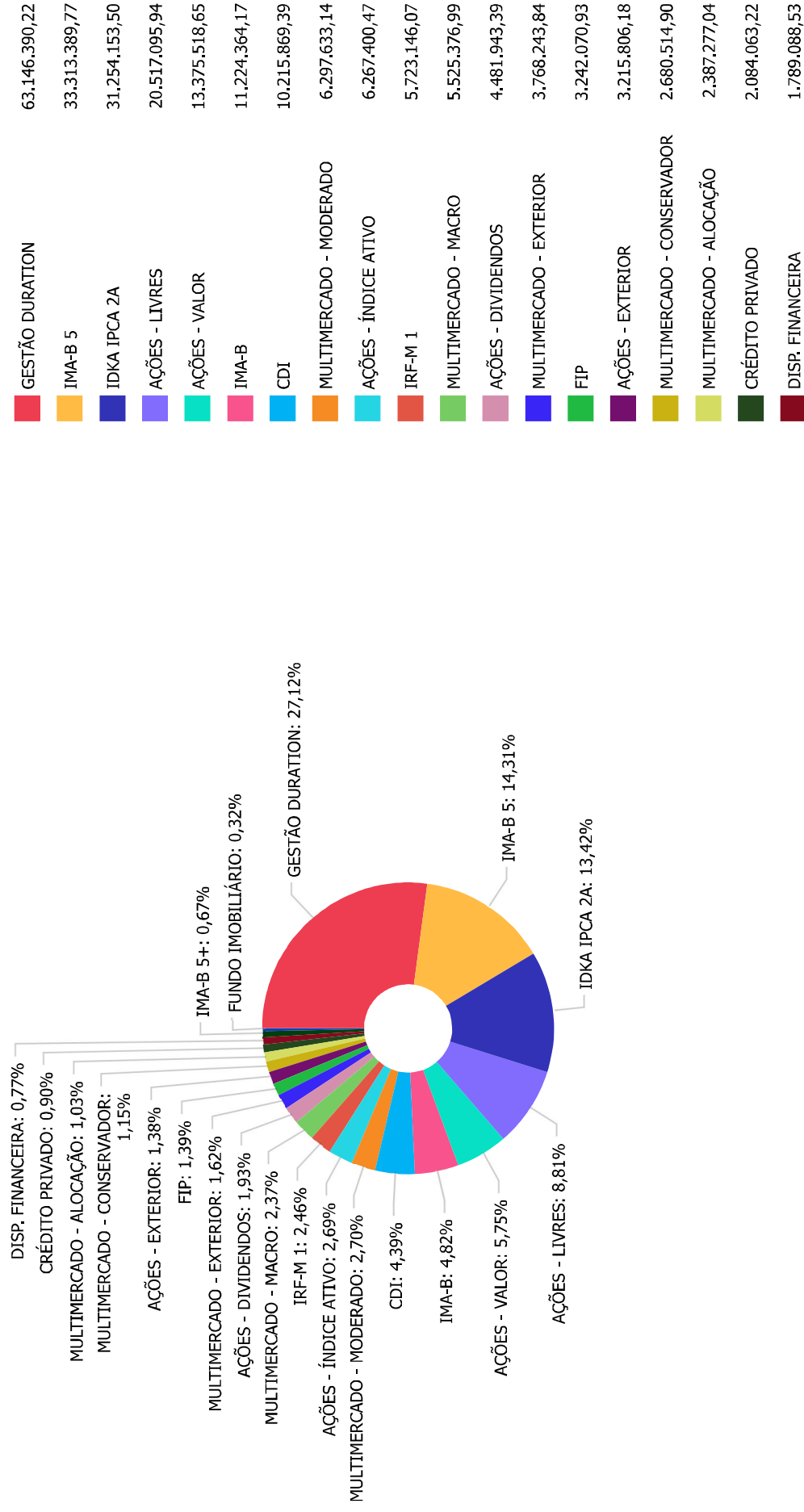
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,91%	16,57%	1,55%	9,86%	33,20%	107,01%	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,34%	14,30%	0,26%	8,77%	29,48%	94,85%	7,26%	0,17%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5,42%	14,23%	0,22%	7,98%	30,62%	103,08%	7,99%	0,17%
MSCI WORLD (Benchmark)	4,15%	12,45%	-1,01%	7,85%	31,07%	90,86%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	6,75%	16,53%	-0,22%	11,09%	38,64%	103,45%	8,15%	0,17%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	7,87%	15,96%	0,91%	9,34%	41,19%	121,71%	8,36%	0,15%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	4,05%	7,20%	-0,75%	3,06%	-	-	7,13%	-

Distribuição dos ativos por Administradores – base (Julho / 2021)

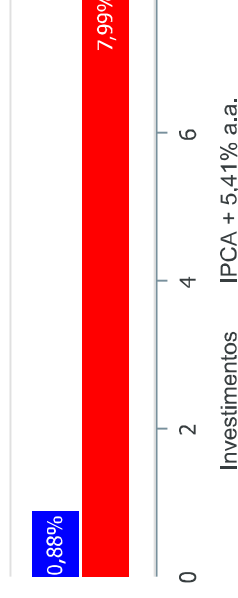


Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Julho / 2021)



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	226.901.548,33	205.063,27	1.394.306,30	223.875.628,40	-1.836.676,90	-1.836.676,90	-0,81%	-0,81%	0,67%	0,67%	-120,80%	3,22%
Fevereiro	223.875.628,40	2.124.289,00	4.822.101,58	218.469.134,25	-2.708.681,57	-4.545.358,47	-1,21%	-2,01%	1,24%	1,92%	-104,74%	3,18%
Março	218.469.134,25	8.109.492,88	4.484.621,64	224.436.478,04	2.342.472,55	-2.202.885,92	1,05%	-0,98%	1,42%	3,36%	-29,03%	3,39%
Abril	224.436.478,04	7.141.885,48	7.112.710,49	226.956.805,29	2.493.152,26	290.266,34	1,11%	0,12%	0,73%	4,12%	3,01%	2,22%
Mai	226.956.805,29	12.562.129,02	12.428.721,17	230.540.820,42	3.448.607,28	3.738.873,62	1,52%	1,64%	1,27%	5,44%	30,21%	2,53%
Junho	230.540.820,42	1.843.375,41	1.204.654,47	231.030.304,28	-149.237,08	3.589.636,54	-0,06%	1,58%	0,97%	6,47%	24,40%	2,14%
Julho	231.030.304,28	5.867.640,35	6.856.491,49	228.449.153,85	-1.592.299,29	1.997.337,25	-0,69%	0,88%	1,43%	7,99%	11,00%	2,77%

Investimentos x Meta de Rentabilidade


Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.545.802,00	0,00	0,00	1.564.878,00	19.076,00	1,23%	1,23%	0,12%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.238.215,72	0,00	0,00	2.254.621,27	16.405,55	0,73%	0,73%	0,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.011.912,85	0,00	0,00	1.018.938,70	7.025,85	0,69%	0,69%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.391.172,08	0,00	0,00	1.400.323,16	9.151,08	0,66%	0,66%	0,42%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	556.775,92	0,00	1.959,84	556.946,64	2.130,56	0,38%	0,38%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	167.555,12	0,00	0,00	168.191,17	636,05	0,38%	0,38%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.504.773,21	2.432.042,16	1.734.973,46	6.217.171,61	15.329,70	0,19%	0,25%	0,01%
CAIXA BRASIL IIRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.713.634,89	0,00	0,00	5.723.146,07	9.511,18	0,17%	0,17%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.806.805,30	0,00	0,00	3.812.739,35	5.934,05	0,16%	0,16%	0,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.841.302,49	0,00	0,00	14.853.688,99	12.386,50	0,08%	0,08%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.891.372,75	0,00	0,00	12.894.284,03	2.911,28	0,02%	0,02%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.509.330,95	0,00	0,00	16.511.625,80	2.294,85	0,01%	0,01%	1,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.507.444,53	0,00	0,00	2.507.156,78	-287,75	-0,01%	-0,01%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.411.121,52	0,00	0,00	16.400.464,51	-10.657,01	-0,06%	-0,06%	0,95%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.085.533,55	0,00	0,00	2.084.063,22	-1.470,33	-0,07%	-0,07%	1,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	20.332.982,85	1.600.000,00	0,00	21.908.878,16	-24.104,69	-0,11%	-0,11%	1,10%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.003.262,94	0,00	0,00	4.993.247,48	-10.015,46	-0,20%	-0,20%	1,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.630.783,02	0,00	0,00	6.614.753,42	-16.029,60	-0,24%	-0,24%	2,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.627.358,55	0,00	0,00	4.609.610,75	-17.747,80	-0,38%	-0,38%	2,07%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.685.037,17	0,00	0,00	32.431.525,23	-253.511,94	-0,78%	-0,78%	1,68%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	156.462.177,41	4.032.042,16	1.736.933,30	158.526.254,34	-231.031,93	-0,15%		1,10%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Julho/2021
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instít	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	700.000,00	0,00	724.836,39	24.836,39	3,55%	2,63%	5,66%
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	3.214.490,69	0,00	0,00	3.242.070,93	27.580,24	0,86%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	6.178.960,77	0,00	3.500.000,00	2.680.514,90	1.554,13	0,03%	0,07%	0,73%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.238.068,34	0,00	1.700.000,00	5.525.376,99	-12.691,35	-0,18%	-0,36%	1,59%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.327.023,00	0,00	0,00	6.297.633,14	-29.389,86	-0,46%	-0,46%	1,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.645.791,70	0,00	0,00	3.621.628,21	-24.163,49	-0,66%	-0,66%	9,47%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.407.302,38	0,00	0,00	2.387.277,04	-20.025,34	-0,83%	-0,83%	2,54%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	11.462.892,76	0,00	0,00	11.197.098,33	-265.794,43	-2,32%	-2,32%	8,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.342.052,32	0,00	0,00	3.239.238,18	-102.814,14	-3,08%	-3,08%	6,67%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.628.630,74	0,00	0,00	4.481.943,39	-146.687,35	-3,17%	-3,17%	8,11%
GERAÇÃO FIAÇÕES	2.890.038,71	0,00	0,00	2.785.024,97	-105.013,74	-3,63%	-3,63%	8,43%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.418.819,18	0,00	0,00	3.277.625,83	-141.193,35	-4,13%	-4,13%	7,29%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.275.632,13	0,00	0,00	2.178.420,32	-97.211,81	-4,27%	-4,27%	8,94%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.544.042,06	0,00	0,00	3.381.965,90	-162.076,16	-4,57%	-4,57%	9,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	3.245.157,63	0,00	0,00	3.093.524,26	-151.633,37	-4,67%	-4,67%	8,49%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.100.342,64	0,00	0,00	3.903.113,56	-197.229,08	-4,81%	-4,81%	7,73%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	3.660.737,33	0,00	0,00	3.482.375,50	-178.361,83	-4,87%	-4,87%	8,64%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	837.700,00	0,00	0,00	742.500,00	-95.200,00	-11,36%	-11,36%	9,70%
Total Renda Variável	72.417.682,38	700.000,00	5.200.000,00	66.242.167,84	-1.675.514,54	-2,29%		6,43%

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.870.927,78	0,00	0,00	2.018.237,00	147.309,22	7,87%	7,87%	8,36%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.869.419,27	0,00	0,00	1.995.638,13	126.218,86	6,75%	6,75%	8,15%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	1.007.003,04	0,00	0,00	1.047.769,32	40.766,28	4,05%	4,05%	7,13%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	600.000,00	0,00	600.021,21	21,21	0,00%	5,42%	7,99%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	600.000,00	0,00	597.547,97	-2.452,03	-0,41%	5,33%	7,26%
Total Exterior	4.747.350,09	1.200.000,00	0,00	6.259.213,63	311.863,54	5,24%		7,94%

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.