

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio 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 (Maio / 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	14.855.193,36	6,37%	977	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.915.374,80	5,54%	735	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.610.040,67	1,98%	662	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.513.718,96	1,08%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.386.302,53	0,59%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.526.418,00	0,65%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	32.686.022,92	14,02%	966	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.456.755,91	7,06%	1.034	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.534.084,00	7,09%	1.000	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.702.877,27	2,45%	1.316	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	20.323.465,92	8,72%	560	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.890.837,96	2,10%	791	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.986.759,65	2,14%	197	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	167.036,70	0,07%	476	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.600.419,03	2,83%	111	0,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.230.621,17	0,96%	71	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.795.934,31	1,63%	257	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.009.407,01	0,43%	147	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	559.793,64	0,24%	2.014	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.086.986,46	0,90%	74	0,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

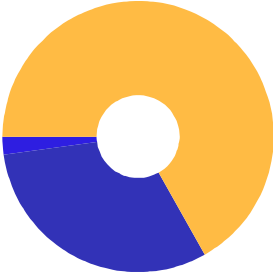
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	11.552.325,23	4,95%	2.410	0,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.585.743,07	1,54%	187	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.498.980,55	1,50%	6.121	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	4.033.464,19	1,73%	2.320	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÃO...	D+33	Não há	4.711.409,36	2,02%	169	0,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.286.518,89	0,98%	128	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.427.805,34	1,47%	5.809	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.886.236,69	1,24%	15.042	0,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.349.119,94	1,44%	37.572	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÃO...	D+24	Não há	3.228.168,34	1,38%	18	0,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.593.288,24	1,54%	113	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	6.166.617,08	2,64%	199	1,65%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.250.301,05	3,11%	16.955	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	6.326.751,84	2,71%	122	0,51%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.397.839,62	1,03%	16.583	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	3.217.302,14	1,38%	18	4,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	916.000,00	0,39%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	1.959.857,49	0,84%	93	0,10%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	1.947.694,22	0,84%	87	0,19%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	1.004.912,92	0,43%	1.078	0,60%	Artigo 9º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			233.178.386,47				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			82.768,22				Artigo 6º
PL Total			233.261.154,69				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b '	100,00%	109.186.788,42	46,83%	10,97%	54,86%	68,57%	50.703.631,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a '	40,00%	44.564.275,39	19,11%	3,96%	13,80%	40,00%	48.707.079,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b '	5,00%	2.086.986,46	0,90%	0,00%	1,26%	1,26%	851.061,21
Total Renda Fixa	100,00%	155.838.050,27	66,83%	14,93%	69,92%	109,83%	



RENDA FIXA 155.838.050,27

RENDA VARIÁVEL 72.427.871,57

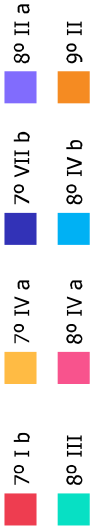
EXTERIOR 4.912.464,63

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'a '	20,00%	46.153.059,84	19,79%	3,58%	17,91%	20,00%	482.617,45
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	22.141.509,59	9,50%	3,14%	9,14%	10,00%	1.176.329,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a '	5,00%	3.217.302,14	1,38%	0,00%	1,45%	1,45%	163.784,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'b '	5,00%	916.000,00	0,39%	0,00%	0,72%	0,72%	762.884,38
Total Renda Variável	30,00%	72.427.871,57	31,06%	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%	4.912.464,63	2,11%	0,00%	0,43%	5,00%	6.746.454,69
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,43%	5,00%	11.658.919,32
Total Exterior	10,00%	4.912.464,63	2,11%	0,00%	0,86%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	102.000.392,67	43,74	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	85.208.414,68	36,54	0,00
ITAÚ UNIBANCO	21.138.583,34	9,07	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.572.502,72	3,68	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.498.980,55	1,50	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.427.805,34	1,47	0,17
ITAÚ DTVM	3.228.168,34	1,38	0,00
AGBI REAL ASSETS	3.217.302,14	1,38	-
GENIAL INVESTIMENTOS	2.886.236,69	1,24	0,03

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	10,97	68,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	0,00	0,00	3,96	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b '	0,00	0,00	0,00	1,26
Artigo 8º, Inciso II, Alínea '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, Alínea '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

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 – RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,88%	2,19%	2,53%	3,96%	8,47%	18,26%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	1,51%	1,89%	3,06%	7,77%	16,46%	0,98%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	1,85%	2,25%	3,53%	7,95%	16,84%	1,07%	0,02%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,32%	5,68%	3,61%	7,65%	14,51%	23,63%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	3,01%	3,78%	4,75%	7,69%	10,25%	0,08%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,20%	0,60%	0,52%	0,91%	2,11%	8,57%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,51%	0,46%	0,79%	1,89%	8,12%	0,14%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,69%	1,42%	1,92%	3,27%	7,39%	17,55%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,69%	1,36%	1,89%	3,19%	7,12%	17,04%	1,01%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	1,68%	2,25%	3,68%	7,42%	19,79%	1,04%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,67%	1,31%	1,85%	3,15%	7,10%	16,90%	1,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	1,06%	-1,14%	1,25%	3,66%	9,17%	16,46%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	-1,19%	1,22%	3,59%	8,90%	15,96%	2,40%	0,08%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,32%	-1,32%	1,39%	3,56%	8,60%	18,47%	2,56%	0,08%
CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 – RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,19%	0,53%	0,41%	0,64%	1,06%	4,87%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,29%	0,85%	0,57%	1,10%	1,69%	6,69%	0,03%	0,00%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,29%	0,85%	0,59%	1,08%	1,86%	6,65%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,59%	0,78%	1,05%	1,07%	2,33%	-	0,32%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,44%	0,92%	1,33%	1,02%	2,51%	14,89%	0,23%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,83%	3,22%	2,08%	4,61%	8,06%	10,08%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	1,84%	1,56%	3,07%	7,74%	17,39%	0,77%	0,01%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,53%	0,73%	1,72%	2,62%	6,94%	15,80%	1,19%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	-0,44%	0,96%	2,25%	4,15%	-	1,19%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,72%	1,21%	2,05%	3,45%	15,85%	1,14%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,27%	0,72%	0,52%	0,92%	1,75%	9,72%	0,03%	0,01%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,42%	-1,13%	0,41%	1,33%	2,64%	10,28%	1,27%	0,04%

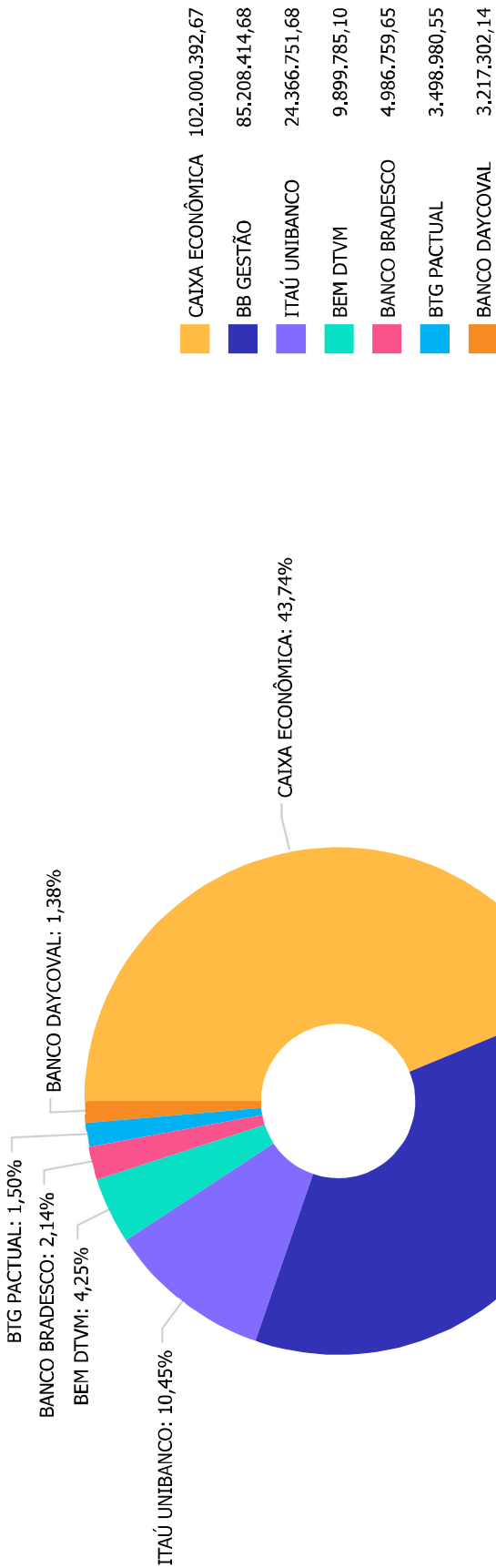
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 – RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,48%	6,48%	4,10%	8,65%	16,66%	28,32%	-	-
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	-0,09%	2,76%	-0,27%	2,61%	2,48%	21,16%	0,05%	0,03%
IDIV (Benchmark)								
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,64%	4,32%	15,93%	13,64%	37,85%	30,26%	-	-
	5,95%	5,64%	14,72%	15,54%	36,82%	35,21%	6,27%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)								
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6,16%	6,05%	14,70%	15,91%	44,41%	30,08%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	5,02%	6,07%	12,00%	14,18%	38,19%	-	7,55%	0,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	6,36%	6,11%	14,58%	15,74%	41,26%	45,18%	7,52%	0,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,30%	5,28%	10,52%	13,02%	41,21%	-	8,04%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8,02%	8,38%	16,64%	17,02%	33,87%	8,80%	9,68%	0,25%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,67%	12,46%	13,59%	19,54%	50,35%	41,02%	7,60%	0,18%
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	3,64%	3,14%	6,47%	8,54%	33,85%	38,48%	9,23%	0,16%
GERAÇÃO FI AÇÕES	5,99%	3,57%	9,76%	11,75%	44,03%	18,60%	7,79%	0,17%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4,98%	2,90%	9,88%	11,59%	39,05%	21,81%	6,90%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,36%	12,04%	19,72%	19,08%	38,06%	40,95%	6,61%	0,22%
	5,69%	5,34%	17,48%	16,63%	46,39%	33,27%	6,74%	0,25%
CDI (Benchmark)								
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
	0,43%	1,06%	1,46%	2,17%	2,62%	8,65%	0,56%	0,02%

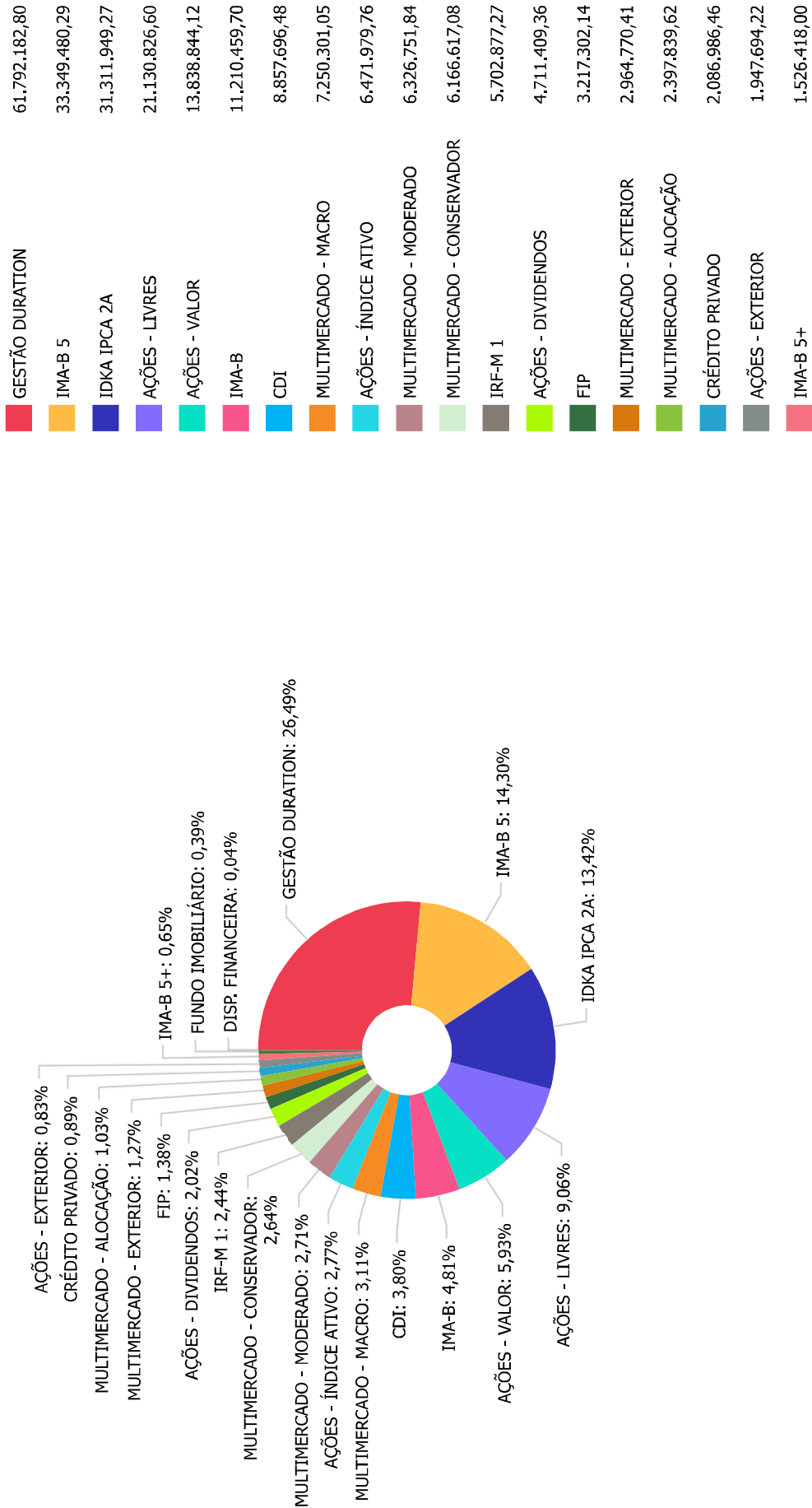
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 – RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,44%	3,29%	3,98%	5,05%	9,39%	17,48%	1,56%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,91%	1,89%	3,66%	4,50%	10,61%	13,36%	2,01%	0,07%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,37%	3,36%	3,55%	4,69%	10,72%	-	1,31%	0,05%
IFIX (Benchmark)	-1,56%	-1,87%	-2,43%	0,28%	5,97%	10,33%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,58%	-33,07%	-6,53%	-36,39%	-29,54%	-10,19%	16,86%	0,46%

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



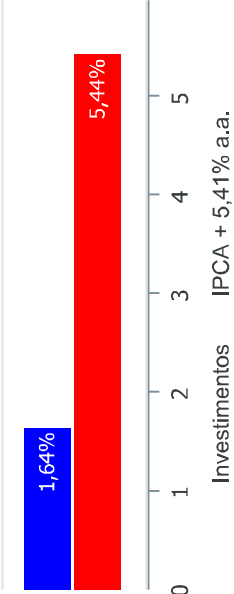
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

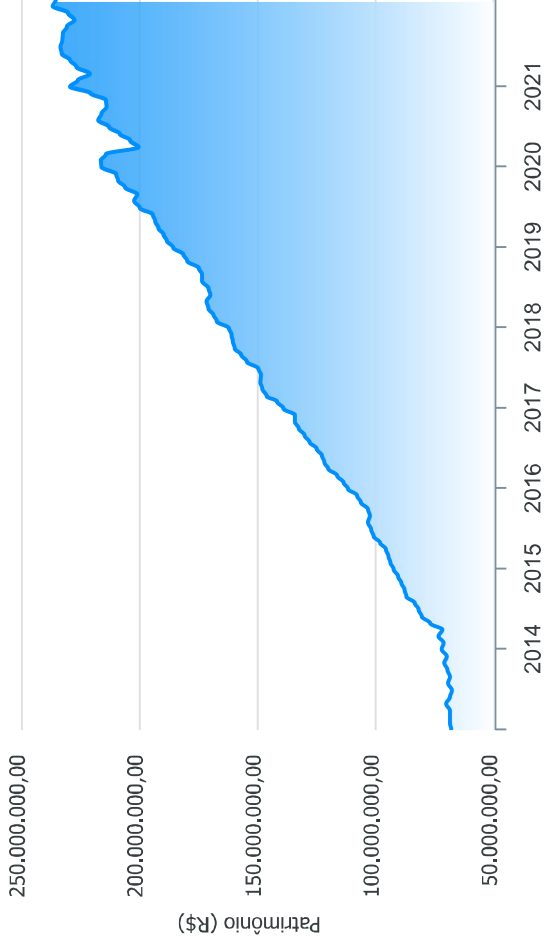
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	226.901.548,33	205.063,27	1.394.306,30	223.875.628,40	-1.836.676,90	-1.836.676,90	-0,81%	-0,81%	0,67%	0,67%	-120,80%	3,22%
Fevereiro	223.875.628,40	2.124.289,00	4.822.101,58	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	226.958.805,29	2.493.152,26	290.266,34	1,11%	0,12%	0,73%	4,12%	3,01%	2,22%
Mai	226.958.805,29	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%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

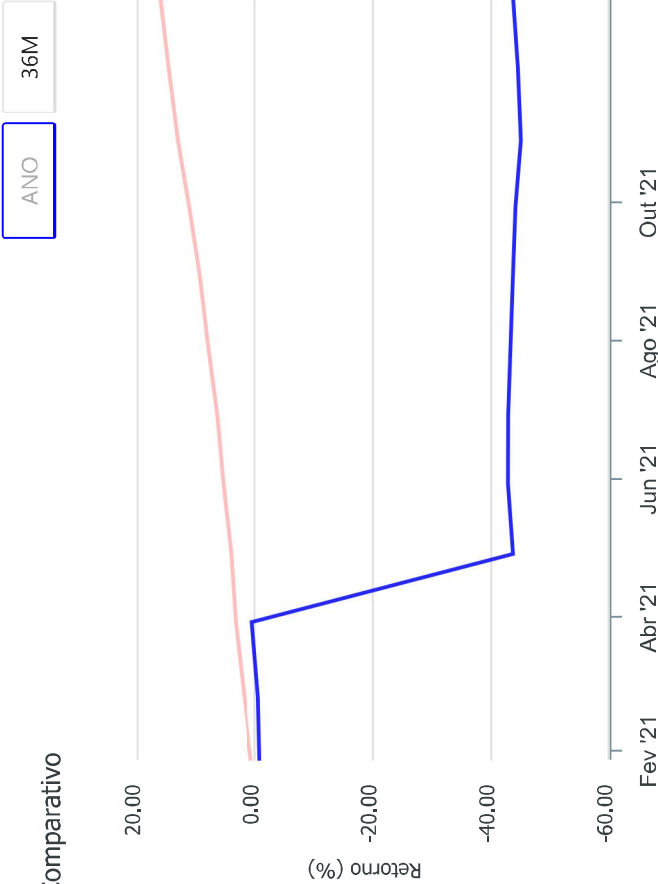


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- ☐ Investimentos
- ☐ IMA-B 5
- ☐ IRF-M 1+
- ☐ Investimentos IMA-B 5
- ☐ IMA-B 5+
- ☐ Ibovespa
- ☐ IMA-B 5+
- ☐ Ibovespa

☐ Meta de Rentabilidade☐ IMA Geral☐ IMA 5+☐ Meta de Rentabilidade☐ IMA Geral☐ IMA 5+☐ CDI☐ IRF-M☐ IRF-M 1☐ CDI☐ IRF-M 1☐ IRF-M 1+☐ IMA-B☐ IRF-M 1☐ IDIV☐ IMA-B☐ CDI☐ IMA-B☐ IRF-M 1☐ IRF-M 1+☐ Ibovespa☐ IBX☐ SMLL☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

	Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA		6.514.324,92	0,00	0,00	6.600.419,03	86.094,11	1,32%	1,32%	2,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...		4.561.924,35	0,00	0,00	4.610.040,67	48.116,32	1,05%	1,05%	2,40%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		1.510.846,00	0,00	0,00	1.526.418,00	15.572,00	1,03%	1,03%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...		2.557.093,73	0,00	65.821,49	2.513.718,96	22.446,72	0,88%	0,89%	1,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...		16.319.070,83	0,00	0,00	16.456.755,91	137.685,08	0,84%	0,84%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...		1.375.986,02	0,00	0,00	1.386.302,53	10.316,51	0,75%	0,75%	0,77%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP		12.827.483,03	0,00	0,00	12.915.374,80	87.891,77	0,69%	0,69%	1,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...		14.756.191,48	0,00	0,00	14.855.193,36	99.001,88	0,67%	0,67%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...		16.424.143,42	0,00	0,00	16.534.084,00	109.940,58	0,67%	0,67%	1,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...		13.669.511,01	6.533.714,14	0,00	20.323.465,92	120.240,77	0,60%	0,60%	1,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...		1.003.488,19	0,00	0,00	1.009.407,01	5.938,82	0,59%	0,59%	0,32%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...		2.075.989,69	0,00	0,00	2.086.986,46	10.996,77	0,53%	0,53%	1,19%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP		2.220.766,33	0,00	0,00	2.230.621,17	9.854,84	0,44%	0,44%	0,23%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA		4.965.703,77	0,00	0,00	4.986.759,65	21.055,88	0,42%	0,42%	1,27%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES		560.131,09	0,00	1.959,84	559.793,64	1.622,39	0,29%	0,29%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP		166.559,21	0,00	0,00	167.036,70	477,49	0,29%	0,29%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...		3.785.681,13	0,00	0,00	3.795.934,31	10.253,18	0,27%	0,27%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA		32.608.190,70	0,00	0,00	32.686.022,92	77.832,22	0,24%	0,24%	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...		5.693.185,85	0,00	0,00	5.702.877,27	9.691,42	0,17%	0,17%	0,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO		4.713.692,86	8.961.636,47	8.801.124,01	4.890.837,96	16.632,64	0,12%	0,19%	0,01%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.541.113,44	0,00	6.533.578,07	0,00	-7.535,37	-0,12%	0,48%	1,07%
Total Renda Fixa	154.851.057,05	15.495.350,61	15.402.483,41	155.838.050,27	894.126,02	0,58%		1,06%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.326.448,54	0,00	0,00	3.593.288,24	266.839,70	8,02%	8,02%	9,68%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.110.533,62	0,00	0,00	3.349.119,94	238.586,32	7,67%	7,67%	7,60%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.149.820,23	0,00	0,00	2.286.518,89	136.698,66	6,36%	6,36%	7,52%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	3.383.027,12	0,00	0,00	3.585.743,07	202.715,95	5,99%	5,99%	7,79%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.446.995,17	0,00	0,00	4.711.409,36	264.414,19	5,95%	5,95%	6,27%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.930.452,90	0,00	0,00	11.552.325,23	621.872,33	5,69%	5,69%	6,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	3.065.812,57	0,00	0,00	3.228.168,34	162.355,77	5,30%	5,30%	8,04%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.840.505,11	0,00	0,00	4.033.464,19	192.959,08	5,02%	5,02%	7,55%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.749.437,34	0,00	0,00	2.886.236,69	136.799,35	4,98%	4,98%	6,90%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.284.507,85	0,00	0,00	3.427.805,34	143.297,49	4,36%	4,36%	6,61%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.376.205,32	0,00	0,00	3.498.980,55	122.775,23	3,64%	3,64%	9,23%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.352.889,08	0,00	0,00	2.397.839,62	44.950,54	1,91%	1,91%	2,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.147.632,95	0,00	0,00	7.250.301,05	102.668,10	1,44%	1,44%	1,56%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.241.138,48	0,00	0,00	6.326.751,84	85.613,36	1,37%	1,37%	1,31%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	6.140.190,49	0,00	0,00	6.166.617,08	26.426,59	0,43%	0,43%	0,56%
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	3.220.138,30	0,00	0,00	3.217.302,14	-2.836,16	-0,09%	-0,09%	0,05%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	950.000,00	0,00	0,00	916.000,00	-34.000,00	-3,58%	-3,58%	16,86%
Total Renda Variável	69.715.735,07	0,00	0,00	72.427.871,57	2.712.136,50	3,89%		5,35%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.000.000,00	0,00	0,00	1.959.857,49	-40.142,51	-2,01%	-2,01%	7,02%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	2.000.000,00	0,00	0,00	1.947.694,22	-52.305,78	-2,62%	-2,62%	7,10%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	1.055.706,88	0,00	0,00	1.004.912,92	-50.793,96	-4,81%	-4,81%	8,80%
Total Exterior	5.055.706,88	0,00	0,00	4.912.464,63	-143.242,25	-2,83%		7,42%

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 aliquotas 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.