

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

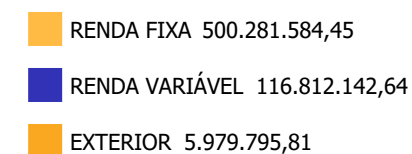
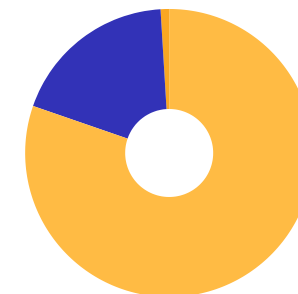
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			96.692.212,16	15,52%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	51.098.608,71	8,20%	917	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	47.565.975,45	7,63%	607	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	43.420.609,36	6,97%	426	2,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	70.351.769,20	11,29%	677	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	66.003.650,04	10,59%	1.017	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	68.910.725,66	11,06%	1.205	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	536.371,31	0,09%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.713.301,69	0,60%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.121.935,51	0,18%	18	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	47.317.740,48	7,59%	260	1,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.760.282,79	0,28%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.788.402,06	0,29%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	28.593.056,69	4,59%	39.215	0,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	27.848.930,28	4,47%	9.552	3,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	28.681.000,35	4,60%	1.293	8,85%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	23.299.847,73	3,74%	5.822	1,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	227.484,55	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	215.328,20	0,03%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	23,50	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.525.517,32	0,24%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	266.172,00	0,04%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se ...	Não se aplica	2.214.000,00	0,36%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.019.215,92	0,32%		1,37%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.921.566,10	0,31%		3,76%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	5.979.795,81	0,96%	62	3,34%	Artigo 9º - A, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			623.073.522,90				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			914.086,34				Artigo 6º
PL Total			623.987.609,24				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	96.692.212,16	15,52%	5,00%	10,00%	100,00%	526.381.310,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	347.351.338,42	55,75%	10,00%	52,50%	100,00%	275.722.184,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	52.689.348,99	8,46%	0,00%	10,00%	40,00%	196.540.060,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	3.548.684,88	0,57%	0,00%	0,50%	3,00%	15.143.520,81
Total Renda Fixa	100,00%	500.281.584,45	80,29%	15,00%	73,00%	243,00%	

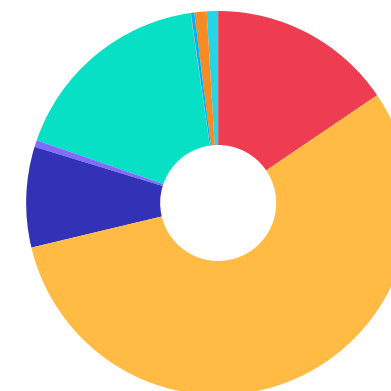


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

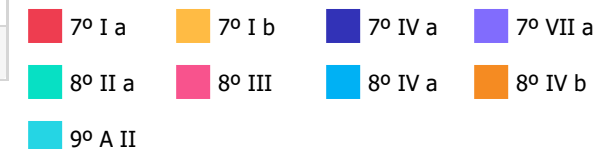


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	93.461.028,44
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	93.461.028,44
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	108.422.835,05	17,40%	5,00%	17,50%	20,00%	16.191.869,53
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	31.153.676,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	227.484,55	0,04%	0,00%	0,50%	5,00%	30.926.191,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	1.740.869,02	0,28%	0,00%	1,00%	5,00%	29.412.807,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	6.420.954,02	1,03%	0,00%	1,00%	5,00%	24.732.722,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	31.153.676,15
Total Renda Variável	35,00%	116.812.142,64	18,75%	5,00%	22,00%	75,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	5,00%	31.153.676,15
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	5.979.795,81	0,96%	0,00%	5,00%	10,00%	56.327.556,48
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	31.153.676,15
Total Exterior	10,00%	5.979.795,81	0,96%	0,00%	5,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	186.828.470,31	29,98	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	160.522.868,11	25,76	0,03
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	96.692.212,16	15,52	-
ITAÚ UNIBANCO	75.910.797,17	12,18	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	51.148.778,01	8,21	0,19
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	28.681.000,35	4,60	0,05
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.979.795,81	0,96	0,13
GRAPHEN INVESTIMENTOS	5.501.703,75	0,88	3,09
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.447.083,42	0,55	0,37
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.214.000,00	0,36	0,88
REDITUS INVESTIMENTOS	2.019.215,92	0,32	-
PETRA CAPITAL	1.760.282,79	0,28	0,03
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.121.935,51	0,18	0,04
INTERATIVA INVESTIMENTOS	536.371,31	0,09	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	266.172,00	0,04	0,00
ÚNICA ADMINISTRADORA	227.484,55	0,04	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	215.328,23	0,03	0,00
VALORA INVESTIMENTOS	23,50	0,00	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	96.692.212,16	15,52	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	347.351.338,42	55,75	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	52.689.348,99	8,46	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	108.422.835,05	17,40	10,00	20,00
Artigo 9º - A, Inciso II	5.979.795,81	0,96	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,38%	-1,64%	-1,64%	1,15%	4,18%	12,86%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,42%	-1,88%	-1,88%	1,24%	4,35%	13,27%	1,70%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,29%	-0,05%	-0,05%	3,00%	8,57%	18,47%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,37%	-0,03%	-0,03%	3,02%	8,45%	17,16%	1,73%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,56%	3,74%	3,74%	8,81%	13,47%	25,49%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,08%	-2,59%	-2,59%	-1,53%	-5,22%	-7,26%	0,35%	0,04%
120% do CDI (Benchmark)	0,24%	0,58%	0,58%	1,15%	2,67%	9,41%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,13%	0,13%	0,83%	2,51%	9,33%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02%	0,05%	0,05%	0,68%	2,12%	8,66%	0,21%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,34%	-0,15%	-0,15%	3,23%	8,50%	18,63%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,63%	0,42%	0,42%	-4,74%	-13,24%	-32,87%	2,78%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	-0,46%	-2,81%	-2,81%	4,17%	10,39%	20,48%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,48%	-2,85%	-2,85%	4,08%	10,09%	19,91%	3,15%	0,08%
BRA1 FI RENDA FIXA	-8,01%	-8,91%	-8,91%	-15,26%	-30,19%	-79,10%	12,50%	0,12%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,31%	-0,90%	-0,90%	0,43%	1,77%	4,68%	0,79%	0,03%

IRF-M (Benchmark)	-0,84%	-2,80%	-2,80%	-0,87%	2,25%	13,59%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,89%	-2,79%	-2,79%	-0,91%	2,08%	13,08%	1,91%	0,04%

IPCA (Benchmark)	0,93%	2,05%	2,05%	5,25%	6,10%	9,60%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,20%	-0,60%	-0,60%	-1,05%	-4,47%	-13,63%	0,02%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,15%	0,34%	0,34%	0,73%	2,06%	12,01%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,30%	-0,18%	-0,18%	1,86%	5,09%	19,24%	1,36%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,85%	4,55%	4,55%	10,55%	17,15%	33,83%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,44%	-1,23%	-1,23%	-4,46%	-	-97,04%	-	-
IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)	1,90%	4,66%	4,66%	10,79%	17,67%	35,04%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-56,43%	-77,81%	-77,81%	-93,87%	-	-99,67%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	6,00%	-2,00%	-2,00%	23,29%	59,73%	22,24%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1,92%	-3,15%	-3,15%	13,11%	51,47%	15,09%	11,04%	0,22%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4,46%	-3,47%	-3,47%	18,38%	52,70%	24,14%	10,76%	0,24%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,12%	1,10%	1,10%	21,26%	58,11%	30,49%	10,08%	0,19%
SMLL (Benchmark)	4,56%	-0,88%	-0,88%	21,46%	64,58%	44,87%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,73%	-0,40%	-0,40%	16,48%	54,84%	42,03%	12,75%	0,23%
CDI (Benchmark)	0,20%	0,49%	0,49%	0,96%	2,22%	7,78%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,47%	-1,23%	-1,23%	-2,39%	-4,54%	-0,10%	0,11%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-5,65%	-7,60%	-7,60%	-9,89%	-7,68%	-15,02%	4,52%	0,12%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,92%	-0,51%	-0,51%	-3,00%	7,47%	-6,51%	1,44%	0,53%

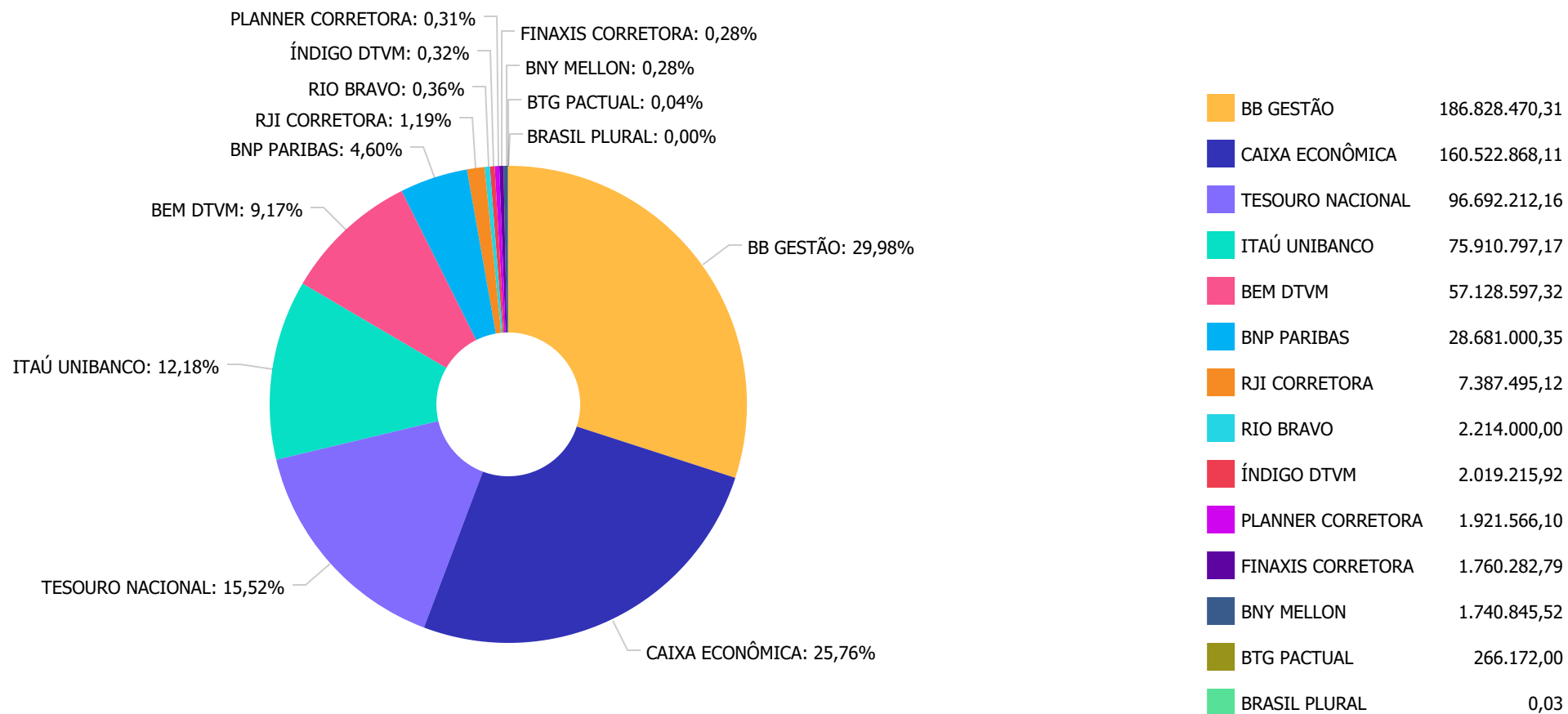
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	3,54%	8,36%	83,15%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,11%	-0,36%	-0,36%	-0,83%	-	-	-	-
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	-0,23%	-6,19%	-6,19%	-7,67%	-11,57%	-90,72%	5,72%	0,26%

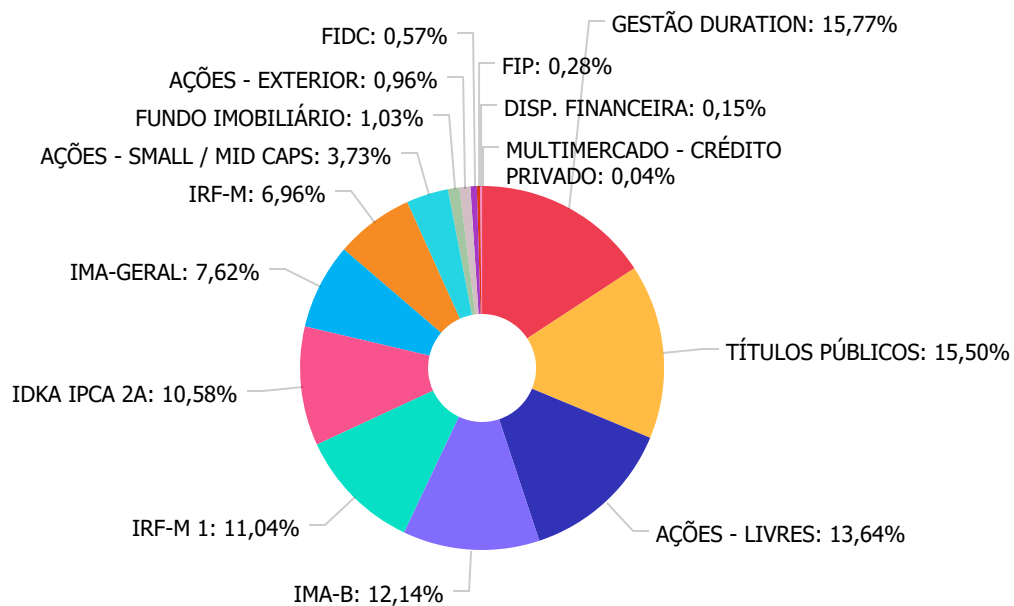
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	1,94%	14,11%	14,11%	22,96%	-	-	11,00%	-

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



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



GESTÃO DURATION	98.416.349,19
TÍTULOS PÚBLICOS	96.692.212,16
AÇÕES - LIVRES	85.122.987,32
IMA-B	75.723.377,71
IRF-M 1	68.910.725,66
IDKA IPCA 2A	66.003.650,04
IMA-GERAL	47.565.975,45
IRF-M	43.420.609,36
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	23.299.847,73
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.420.954,02
AÇÕES - EXTERIOR	5.979.795,81
FIDC	3.548.684,88
FIP	1.740.869,02
DISP. FINANCEIRA	914.086,34
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	227.484,55

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1.100	1.345,077073	3.858,590523	1.479.584,78	4.244.449,58	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.858,590523	1.098.188,08	3.395.559,66	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.858,590523	992.130,00	2.893.942,89	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.858,590523	998.799,60	2.932.528,80	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.858,590523	1.000.585,27	2.971.114,70	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.858,590523	1.124.114,15	3.279.801,94	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.858,590523	1.006.644,67	2.893.942,89	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.858,590523	999.750,00	2.893.942,89	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1.100	1.352,073136	3.858,590523	1.487.280,45	4.244.449,58	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.858,590523	859.423,87	2.430.912,03	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.858,590523	136.416,48	385.859,05	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.858,590523	997.614,60	2.816.771,08	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.415,792995	895.805,83	2.693.633,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1.010	1.468,534139	4.415,792995	1.483.219,48	4.459.950,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1.180	1.468,534144	4.415,792995	1.732.870,29	5.210.635,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.415,792995	1.249.170,73	4.044.866,38	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	5.663,452375	1.411.663,50	5.012.155,35	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	5.663,452375	1.171.463,51	4.202.281,66	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	5.663,452375	798.050,50	2.831.726,19	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	5.663,452375	1.046.269,96	3.749.205,47	Mercado

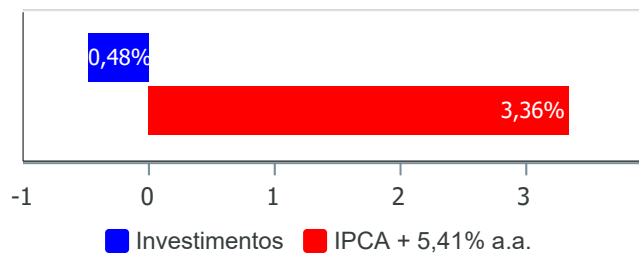
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	5.663,452375	960.617,17	3.398.071,43	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	5.663,452375	1.479.336,56	5.312.318,33	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	5.663,452375	798.050,50	2.831.726,19	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	5.663,452375	1.002.194,60	3.907.782,14	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	5.663,452375	258.043,50	1.019.421,43	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	5.663,452375	909.797,78	3.573.638,45	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	5.663,452375	429.654,20	1.699.035,71	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1.300	1.602,545169	5.663,452375	2.083.308,72	7.362.488,09	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

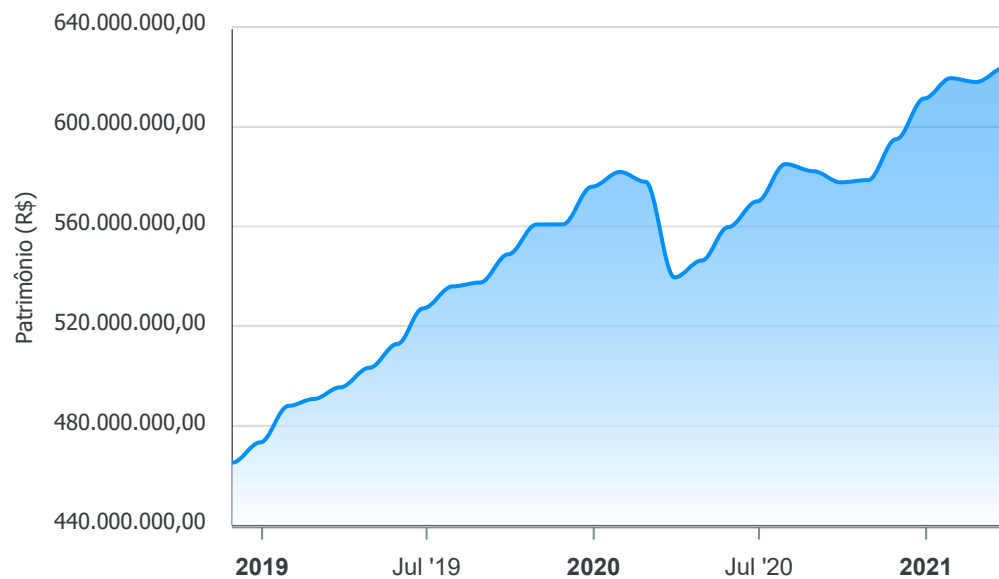
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	600.192.395,18	13.350.000,00	3.570.623,00	607.651.985,78	-2.319.786,40	-2.319.786,40	-0,38%	-0,38%	0,67%	0,67%	-56,76%	3,49%
Fevereiro	607.651.985,78	6.260.000,00	4.577.701,97	605.557.068,18	-3.777.215,63	-6.097.002,03	-0,62%	-1,00%	1,24%	1,92%	-52,01%	3,39%
Março	605.557.068,18	6.050.000,00	3.409.618,15	611.375.804,55	3.178.354,52	-2.918.647,51	0,52%	-0,48%	1,42%	3,36%	-14,29%	3,60%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



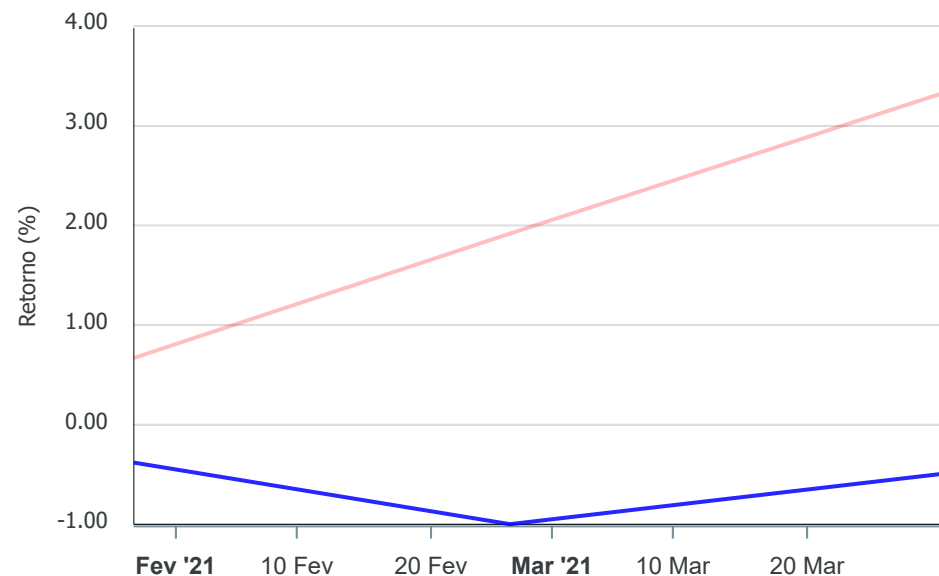
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Março/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TÍTULOS PÚBLICOS	95.688.390,91	0,00	0,00	96.692.212,16	1.003.821,25	1,05%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.114.969,72	0,00	0,00	1.121.935,51	6.965,79	0,62%	0,63%	2,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	65.760.656,96	0,00	0,00	66.003.650,04	242.993,08	0,37%	0,37%	1,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	50.945.238,42	0,00	0,00	51.098.608,71	153.370,29	0,30%	0,30%	1,36%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	47.249.444,60	0,00	0,00	47.317.740,48	68.295,88	0,14%	0,14%	0,02%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.786.998,51	0,00	0,00	1.788.402,06	1.403,55	0,08%	0,08%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	65.213.394,21	6.450.000,00	2.764.000,00	68.910.725,66	11.331,45	0,02%	0,02%	0,21%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNI...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNI...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNI...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BRA1 FI RENDA FIXA	583.044,16	0,00	45.878,81	536.371,31	-794,04	-0,14%	-8,01%	12,50%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.763.770,00	0,00	0,00	1.760.282,79	-3.487,21	-0,20%	-0,20%	0,02%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.724.674,36	0,00	0,00	3.713.301,69	-11.372,67	-0,31%	-0,31%	0,79%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.767.144,28	0,00	0,00	47.565.975,45	-201.168,83	-0,42%	-0,42%	1,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	70.690.259,50	0,00	0,00	70.351.769,20	-338.490,30	-0,48%	-0,48%	3,15%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	43.809.366,23	0,00	0,00	43.420.609,36	-388.756,87	-0,89%	-0,89%	1,91%
Total Renda Fixa	496.097.351,89	6.450.000,00	2.809.878,81	500.281.584,45	544.111,37	0,11%		1,48%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	27.457.816,79	0,00	0,00	28.681.000,35	1.223.183,56	4,45%	4,45%	10,76%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28.000.068,71	0,00	0,00	28.593.056,69	592.987,98	2,12%	2,12%	10,08%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	27.323.145,43	0,00	0,00	27.848.930,28	525.784,85	1,92%	1,92%	11,04%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.576.195,46	0,00	685.181,26	1.921.566,10	30.551,90	1,19%	0,00%	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	23.130.592,68	0,00	0,00	23.299.847,73	169.255,05	0,73%	0,73%	12,75%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.219.000,00	0,00	17.000,00	2.214.000,00	12.000,00	0,54%	-0,23%	5,72%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	1.527.132,31	0,00	0,00	1.525.517,32	-1.614,99	-0,11%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	216.288,65	0,00	0,00	215.328,20	-960,45	-0,44%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	228.564,66	0,00	0,00	227.484,55	-1.080,11	-0,47%	-0,47%	0,11%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.032.257,52	0,00	0,00	2.019.215,92	-13.041,60	-0,64%	0,92%	1,44%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	282.109,86	0,00	1.558,08	266.172,00	-14.379,78	-5,10%	-5,65%	4,52%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	53,94	0,00	0,00	23,50	-30,44	-56,43%	-	-
Total Renda Variável	114.993.226,01	0,00	703.739,34	116.812.142,64	2.522.655,97	2,19%		10,76%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	5.866.267,49	0,00	0,00	5.979.795,81	113.528,32	1,94%	1,94%	11,00%
Total Exterior	5.866.267,49	0,00	0,00	5.979.795,81	113.528,32	1,94%		11,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	95.287.356,19	0,00	935.950,31	96.692.212,16	2.340.806,28	2,46%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	47.158.043,34	0,00	0,00	47.317.740,48	159.697,14	0,34%	0,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	53.074.807,27	25.760.000,00	9.964.000,00	68.910.725,66	39.918,39	0,05%	0,05%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.117.214,29	0,00	0,00	1.121.935,51	4.721,22	0,42%	0,42%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
BRA1 FI RENDA FIXA	588.856,99	0,00	45.878,81	536.371,31	-6.606,87	-1,12%	-8,91%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.770.892,46	0,00	0,00	1.760.282,79	-10.609,67	-0,60%	-0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	65.075.853,74	950.000,00	0,00	66.003.650,04	-22.203,70	-0,03%	-0,02%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.747.135,36	0,00	0,00	3.713.301,69	-33.833,67	-0,90%	-0,90%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.835.861,87	0,00	0,00	1.788.402,06	-47.459,81	-2,59%	-2,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	51.192.179,13	0,00	0,00	51.098.608,71	-93.570,42	-0,18%	-0,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.475.489,13	0,00	0,00	47.565.975,45	-909.513,68	-1,88%	-1,88%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	44.664.843,77	0,00	0,00	43.420.609,36	-1.244.234,41	-2,79%	-2,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	72.416.199,36	0,00	0,00	70.351.769,20	-2.064.430,16	-2,85%	-2,85%
Total Renda Fixa					-1.887.319,36	-0,38%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28.282.216,50	0,00	0,00	28.593.056,69	310.840,19	1,10%	1,10%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.626.105,95	0,00	796.341,55	1.921.566,10	91.801,70	3,50%	0,00%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	105,92	0,00	0,00	23,50	-82,42	-77,81%	-77,81%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	218.012,05	0,00	0,00	215.328,20	-2.683,85	-1,23%	-1,23%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	230.305,58	0,00	0,00	227.484,55	-2.821,03	-1,22%	-1,22%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	1.531.051,33	0,00	0,00	1.525.517,32	-5.534,01	-0,36%	-0,36%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	288.050,04	0,00	4.772,45	266.172,00	-17.105,59	-5,94%	-7,60%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.040.285,96	0,00	0,00	2.019.215,92	-21.070,04	-1,03%	-0,51%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.360.000,00	0,00	55.000,00	2.214.000,00	-91.000,00	-3,86%	-6,19%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	23.392.520,88	0,00	0,00	23.299.847,73	-92.673,15	-0,40%	-0,40%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	28.753.732,43	0,00	0,00	27.848.930,28	-904.802,15	-3,15%	-3,15%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	29.710.745,46	0,00	0,00	28.681.000,35	-1.029.745,11	-3,47%	-3,47%
Total Renda Variável					-1.764.875,46	-1,48%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	5.240.339,18	0,00	0,00	5.979.795,81	739.456,63	14,11%	14,11%
				Total Exterior	739.456,63	14,11%	

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.