

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2021



Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

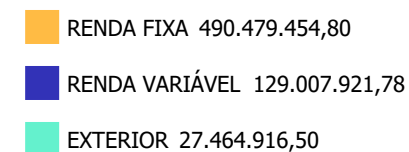
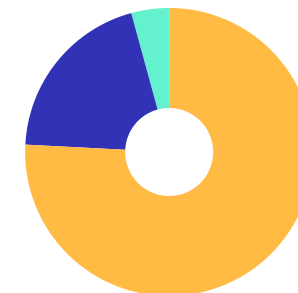
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|--|------------|---------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 52.506.656,25 | 8,12% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+3 | Não há | 48.145.325,92 | 7,44% | 595 | 0,52% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1 | Não há | 71.823.772,10 | 11,10% | 662 | 0,97% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0 | Não há | 88.732.206,49 | 13,72% | 1.169 | 1,17% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não possui | 61.605.124,86 | 9,52% | 974 | 0,38% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 97.553.336,35 | 15,08% | 1.044 | 0,83% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 13.681.840,91 | 2,11% | 393 | 0,83% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BRA1 FI RENDA FIXA | D+1445 | Não há | 488.465,98 | 0,08% | 16 | 4,17% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1 | Não há | 47.632.894,02 | 7,36% | 255 | 1,38% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | D+1009 | Não há | 3.741.647,02 | 0,58% | 28 | 5,28% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1800 | Não há | 1.074.568,15 | 0,17% | 18 | 0,66% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | D+1260 | 90 dias | 1.797.266,94 | 0,28% | 70 | 2,53% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | Não se ... | Não há | 1.696.349,78 | 0,26% | 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 ' |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 30.971.783,32 | 4,79% | 9.329 | 4,52% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 26.500.950,12 | 4,10% | 5.982 | 1,10% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 31.342.177,14 | 4,84% | 1.204 | 9,16% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 31.738.932,19 | 4,91% | 37.076 | 0,70% | 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 | RESOLUÇÃO - 3.922 |
|---|------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|------------------------------------|
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+1 | Não há | 224.775,43 | 0,03% | 12 | 14,12% | Artigo 8º, Inciso III |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | Não se ... | Não se aplica | 1.520.964,53 | 0,24% | 17 | 5,42% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP | Não se ... | Não se aplica | 0,01 | 0,00% | 15 | 100,00% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP | Não se ... | Não se aplica | 539.219,80 | 0,08% | 33 | 2,72% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | Não se ... | Não se aplica | 2.003.605,00 | 0,31% | | 5,30% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11 | S/Info | Não se aplica | 262.926,00 | 0,04% | | 0,01% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11 | Não se ... | Não se aplica | 2.257.000,00 | 0,35% | | 0,17% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | S/Info | Não se aplica | 1.645.588,24 | 0,25% | | 3,49% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO... | D+5 | Não há | 13.461.606,26 | 2,08% | 17.822 | 0,84% | Artigo 9º - A, Inciso II |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM... | D+4 du | Não há | 14.003.310,24 | 2,16% | 132 | 6,19% | Artigo 9º - A, Inciso II |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | D+0 | | 227.627,33 | 0,04% | | 0,00% | DF - Artigo 6º |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 646.952.293,08 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 227.627,33 | | | | Artigo 6º |
| PL Total | | | 647.179.920,41 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 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% | 52.506.656,25 | 8,12% | 5,00% | 10,00% | 100,00% | 594.445.636,83 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 381.541.606,63 | 58,98% | 10,00% | 52,50% | 100,00% | 265.410.686,45 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 45,00% | 52.937.575,17 | 8,18% | 0,00% | 10,00% | 40,00% | 205.843.342,06 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00% | 3.493.616,75 | 0,54% | 0,00% | 0,50% | 3,00% | 15.914.952,04 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 490.479.454,80 | 75,81% | 15,00% | 73,00% | 243,00% | |

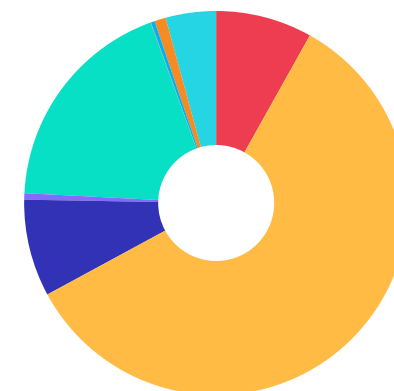


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

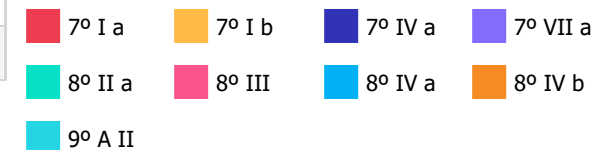


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2021)

| 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% | 97.042.843,96 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 35,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 15,00% | 97.042.843,96 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 25,00% | 120.553.842,77 | 18,63% | 5,00% | 17,50% | 20,00% | 8.836.615,85 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 25,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 32.347.614,65 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 224.775,43 | 0,03% | 0,00% | 0,50% | 5,00% | 32.122.839,22 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00% | 2.060.184,34 | 0,32% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 30.287.430,31 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00% | 6.169.119,24 | 0,95% | 0,00% | 1,00% | 5,00% | 26.178.495,41 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c ' | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 32.347.614,65 |
| Total Renda Variável | 35,00% | 129.007.921,78 | 19,94% | 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% | 32.347.614,65 |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 10,00% | 27.464.916,50 | 4,25% | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 37.230.312,81 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 32.347.614,65 |
| Total Exterior | 10,00% | 27.464.916,50 | 4,25% | 0,00% | 5,00% | 20,00% | |



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

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 208.701.304,51 | 32,26 | 0,01 |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 172.840.302,12 | 26,72 | 0,03 |
| ITAU UNIBANCO | 79.371.826,21 | 12,27 | 0,00 |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS | 57.472.733,44 | 8,88 | 0,21 |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL... | 52.506.656,25 | 8,12 | - |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT | 31.342.177,14 | 4,84 | 0,05 |
| SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT... | 14.003.310,24 | 2,16 | 0,29 |
| XP VISTA ASSET MANAGEMENT | 13.461.606,26 | 2,08 | 0,00 |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS | 5.538.913,96 | 0,86 | 5,33 |
| QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS | 3.166.552,77 | 0,49 | 0,34 |
| RIO BRAVO INVESTIMENTOS | 2.257.000,00 | 0,35 | 0,55 |
| REDITUS INVESTIMENTOS | 2.003.605,00 | 0,31 | - |
| PETRA CAPITAL | 1.696.349,78 | 0,26 | 0,03 |
| VERITAS CAPITAL MANAGEMENT | 1.074.568,15 | 0,17 | 0,04 |
| BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT... | 539.219,83 | 0,08 | 0,01 |
| INTERATIVA INVESTIMENTOS | 488.465,98 | 0,08 | - |
| BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO... | 262.926,00 | 0,04 | 0,00 |
| ÚNICA ADMINISTRADORA | 224.775,43 | 0,03 | - |
| VALORA INVESTIMENTOS | 0,01 | 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 ' | 52.506.656,25 | 8,12 | 0,00 | 50,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 381.541.606,63 | 58,98 | 20,00 | 50,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 52.937.575,17 | 8,18 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 120.553.842,77 | 18,63 | 10,00 | 20,00 |
| Artigo 9º - A, Inciso II | 27.464.916,50 | 4,25 | 0,00 | 10,00 |

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 |
|---|--------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| IMA Geral ex-C (Benchmark) | 0,32% | -0,34% | 1,32% | -0,34% | 2,74% | 9,23% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,11% | -0,68% | 1,22% | -0,68% | 2,58% | 9,05% | 1,23% | 0,04% |
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | -0,32% | 1,87% | 1,91% | 1,87% | 7,06% | 16,45% | - | - |
| 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% |
| IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark) | 1,10% | 7,25% | 3,39% | 7,25% | 15,90% | 26,69% | - | - |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 0,12% | -2,10% | 0,50% | -2,10% | -3,88% | -7,96% | - | 0,04% |
| 120% do CDI (Benchmark) | 0,37% | 1,54% | 0,95% | 1,54% | 2,74% | 8,44% | - | - |
| 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) | 0,21% | 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% |
| 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% |
| BRA1 FI RENDA FIXA | -9,12% | -17,05% | -8,93% | -17,05% | -28,58% | -80,15% | 14,18% | 0,13% |

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 |
|--|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 0,19% | -0,15% | 0,76% | -0,15% | 0,81% | 0,57% | 0,57% | 0,02% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | -1,32% | -3,82% | -4,22% | -3,82% | -16,22% | -20,79% | 2,31% | 0,06% |
| IRF-M (Benchmark) | 0,21% | -1,58% | 1,26% | -1,58% | 0,14% | 9,97% | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,18% | -1,69% | 1,13% | -1,69% | -0,09% | 9,44% | 1,14% | 0,03% |
| IPCA (Benchmark) | 0,53% | 3,77% | 1,68% | 3,77% | 8,35% | 10,66% | - | - |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | -0,16% | -4,21% | -3,63% | -4,21% | -7,40% | -15,22% | 0,01% | 0,12% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,29% | 1,01% | 0,67% | 1,01% | 1,59% | 7,30% | 0,01% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,00% | 0,72% | 0,90% | 0,72% | 2,68% | 12,77% | 0,97% | 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 |
|---|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark) | 1,37% | 8,95% | 4,21% | 8,95% | 19,68% | 35,11% | - | - |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP | -3,29% | 147,34% | 150,42% | 147,34% | 136,01% | -92,57% | 5,00% | 0,03% |

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark) | 1,41% | 9,19% | 4,32% | 9,19% | 20,22% | 36,34% | - | - |
| BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP | 0,00% | - | - | - | - | - | 0,00% | 1,16% |

| | | | | | | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|
| Ibovespa (Benchmark) | 0,46% | 6,54% | 8,72% | 6,54% | 33,40% | 25,59% | - | - |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 0,48% | 7,71% | 11,21% | 7,71% | 25,92% | 21,09% | 4,00% | 0,18% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 1,67% | 5,49% | 9,28% | 5,49% | 28,54% | 24,17% | 4,62% | 0,21% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | -0,21% | 12,22% | 11,00% | 12,22% | 37,29% | 31,25% | 4,87% | 0,17% |

| | | | | | | | | |
|-----------------------------------|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|
| SMLL (Benchmark) | 1,29% | 11,42% | 12,41% | 11,42% | 39,64% | 46,83% | - | - |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 1,61% | 13,29% | 13,74% | 13,29% | 37,58% | 47,53% | 4,22% | 0,21% |

| | | | | | | | | |
|---------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|
| CDI (Benchmark) | 0,31% | 1,28% | 0,79% | 1,28% | 2,28% | 6,98% | - | - |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | -0,40% | -2,40% | -1,19% | -2,40% | -4,73% | -3,80% | 0,00% | 0,00% |

| | | | | | | | | |
|---|--------|--------|--------|--------|---------|---------|-------|-------|
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11 | -2,29% | -8,72% | -1,22% | -8,72% | -12,35% | -16,07% | 3,67% | 0,12% |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 0,00% | -1,27% | -0,77% | -1,27% | -22,99% | -19,79% | 0,60% | 0,36% |

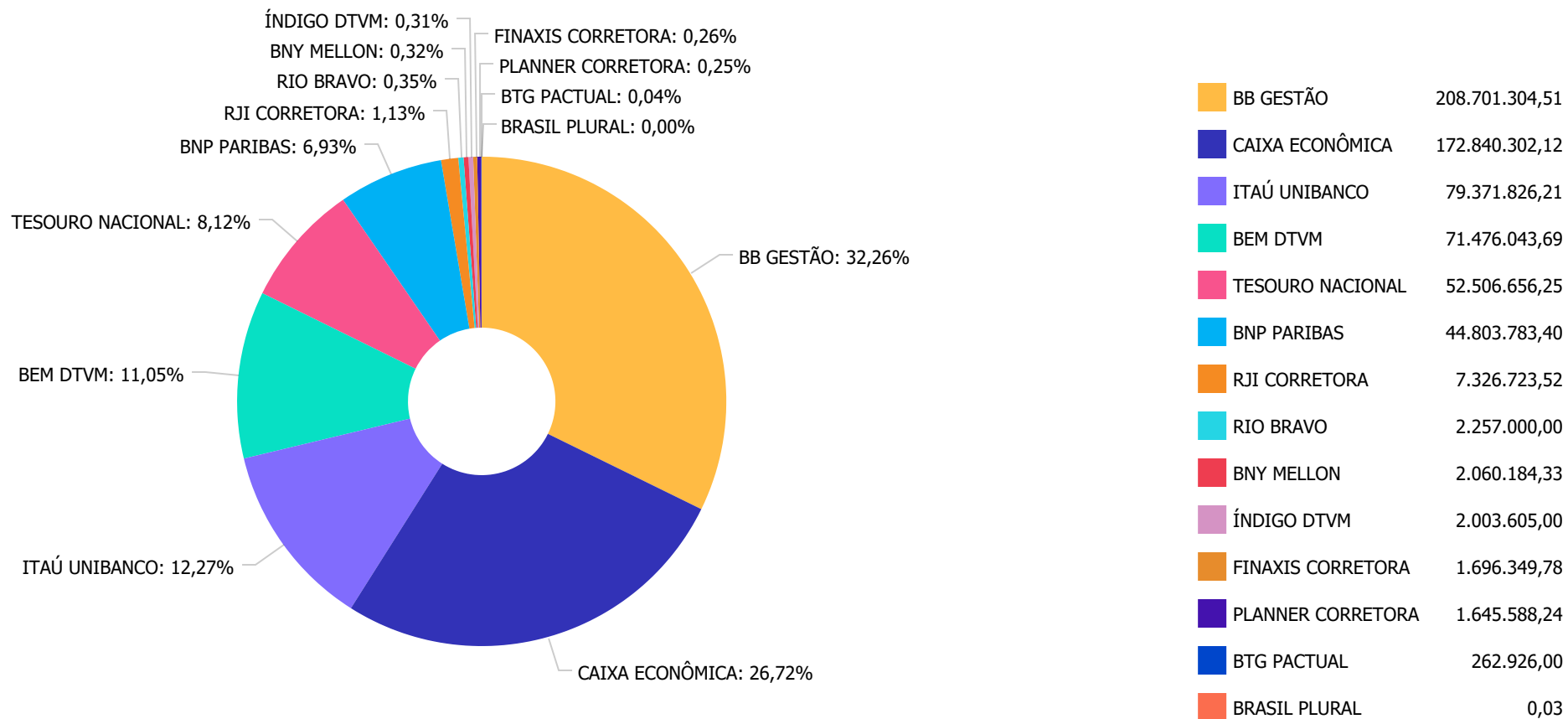
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | 0,00% | -7,96% | 0,33% | -7,96% | -2,82% | 68,58% | - | - |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | -0,10% | -0,66% | -0,30% | -0,66% | -1,67% | - | - | 0,00% |
| RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11 | 1,92% | -4,36% | 1,94% | -4,36% | -24,26% | -15,71% | 4,09% | 0,17% |

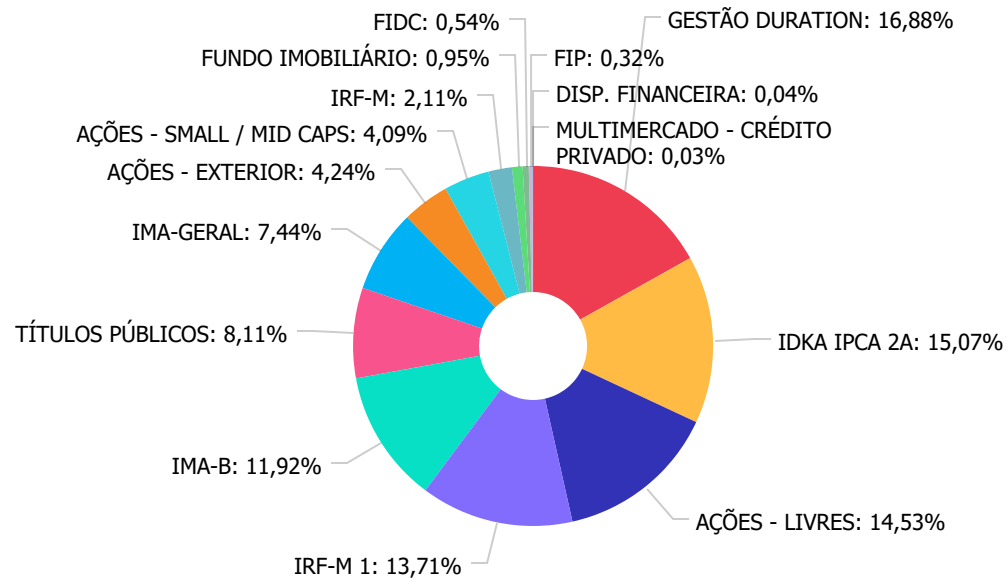
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|-------|--------|-------|--------|-----|---------|------------------|
| Não Informado (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ... | -1,15% | 2,21% | -4,10% | 2,21% | 28,74% | - | 7,83% | 0,18% |
| Não definido (Benchmark) | - | - | - | - | - | - | - | - |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ... | -3,72% | 9,31% | -4,20% | 9,31% | - | - | 6,90% | - |

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



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



| | |
|--------------------------------|----------------|
| GESTÃO DURATION | 109.238.018,88 |
| IDKA IPCA 2A | 97.553.336,35 |
| AÇÕES - LIVRES | 94.052.892,65 |
| IRF-M 1 | 88.732.206,49 |
| IMA-B | 77.128.453,25 |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 52.506.656,25 |
| IMA-GERAL | 48.145.325,92 |
| AÇÕES - EXTERIOR | 27.464.916,50 |
| AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 26.500.950,12 |
| IRF-M | 13.681.840,91 |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 6.169.119,24 |
| FIDC | 3.493.616,75 |
| FIP | 2.060.184,34 |
| DISP. FINANCEIRA | 227.627,33 |
| MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO | 224.775,43 |

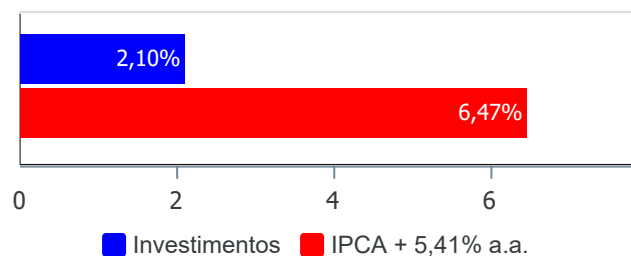
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2021)

| 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 | 08/10/2004 | 750 | 1.322,840000 | 3.926,189927 | 992.130,00 | 2.944.642,45 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 22/09/2004 | 760 | 1.314,210000 | 3.926,189927 | 998.799,60 | 2.983.904,34 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 02/09/2004 | 770 | 1.299,461390 | 3.926,189927 | 1.000.585,27 | 3.023.166,24 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 22/07/2004 | 850 | 1.322,487235 | 3.926,189927 | 1.124.114,15 | 3.337.261,44 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 06/04/2004 | 750 | 1.342,192893 | 3.926,189927 | 1.006.644,67 | 2.944.642,45 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 17/03/2004 | 750 | 1.333,000000 | 3.926,189927 | 999.750,00 | 2.944.642,45 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 14/12/2004 | 1.100 | 1.352,073136 | 3.926,189927 | 1.487.280,45 | 4.318.808,92 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 04/01/2005 | 630 | 1.364,164873 | 3.926,189927 | 859.423,87 | 2.473.499,65 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 04/01/2005 | 100 | 1.364,164800 | 3.926,189927 | 136.416,48 | 392.618,99 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 07/01/2005 | 730 | 1.366,595342 | 3.926,189927 | 997.614,60 | 2.866.118,65 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 20/01/2004 | 1.100 | 1.345,077073 | 3.926,189927 | 1.479.584,78 | 4.318.808,92 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 18/11/2003 | 880 | 1.247,941000 | 3.926,189927 | 1.098.188,08 | 3.455.047,14 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 17/11/2004 | 610 | 1.468,534148 | 4.441,198792 | 895.805,83 | 2.709.131,26 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 18/11/2004 | 1.010 | 1.468,534139 | 4.441,198792 | 1.483.219,48 | 4.485.610,78 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 19/11/2004 | 1.180 | 1.468,534144 | 4.441,198792 | 1.732.870,29 | 5.240.614,57 | Mercado |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 29/04/2005 | 916 | 1.363,723504 | 4.441,198792 | 1.249.170,73 | 4.068.138,09 | 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% |
| Abril | 611.375.804,55 | 75.050.000,00 | 72.311.550,96 | 620.833.332,43 | 6.719.078,84 | 3.800.431,33 | 1,09% | 0,61% | 0,73% | 4,12% | 14,78% | 2,40% |
| Mai | 620.833.332,43 | 46.140.000,00 | 44.003.911,27 | 631.122.954,67 | 8.153.533,51 | 11.953.964,84 | 1,31% | 1,93% | 1,27% | 5,44% | 35,37% | 2,87% |
| Junho | 631.122.954,67 | 5.090.000,00 | 3.007.489,90 | 634.274.225,65 | 1.068.760,88 | 13.022.725,72 | 0,17% | 2,10% | 0,97% | 6,47% | 32,42% | 2,10% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



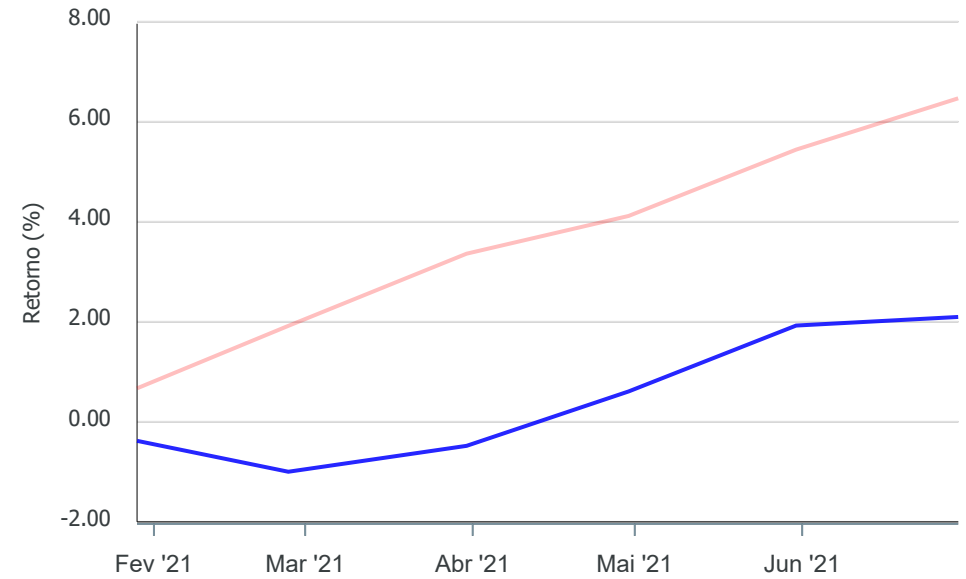
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 |
|--|-----------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 71.554.971,80 | 0,00 | 0,00 | 71.823.772,10 | 268.800,30 | 0,38% | 0,38% | 2,45% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 47.496.869,98 | 0,00 | 0,00 | 47.632.894,02 | 136.024,04 | 0,29% | 0,29% | 0,01% |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 3.734.620,42 | 0,00 | 0,00 | 3.741.647,02 | 7.026,60 | 0,19% | 0,19% | 0,57% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 13.656.946,66 | 0,00 | 0,00 | 13.681.840,91 | 24.894,25 | 0,18% | 0,18% | 1,14% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 86.138.891,37 | 5.450.000,00 | 3.020.000,00 | 88.732.206,49 | 163.315,12 | 0,18% | 0,18% | 0,16% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 1.795.159,11 | 0,00 | 0,00 | 1.797.266,94 | 2.107,83 | 0,12% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 48.091.705,52 | 0,00 | 0,00 | 48.145.325,92 | 53.620,40 | 0,11% | 0,11% | 1,23% |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN... | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | - | - |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN... | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | - | - |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN... | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 61.606.982,84 | 0,00 | 0,00 | 61.605.124,86 | -1.857,98 | 0,00% | 0,00% | 0,97% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 52.508.867,10 | 0,00 | 0,00 | 52.506.656,25 | -2.210,85 | 0,00% | - | - |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.088.920,75 | 0,00 | 13.117,93 | 1.074.568,15 | -1.234,67 | -0,11% | -1,32% | 2,31% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 1.699.083,62 | 0,00 | 0,00 | 1.696.349,78 | -2.733,84 | -0,16% | -0,16% | 0,01% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 97.804.538,31 | 20.000,00 | 0,00 | 97.553.336,35 | -271.201,96 | -0,28% | -0,28% | 1,53% |
| BRA1 FI RENDA FIXA | 537.505,14 | 0,00 | 45.878,81 | 488.465,98 | -3.160,35 | -0,59% | -9,12% | 14,18% |
| Total Renda Fixa | 487.715.062,65 | 5.470.000,00 | 3.078.996,74 | 490.479.454,80 | 373.388,89 | 0,08% | | 1,11% |

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 |
|---|-----------------------|-------------|------------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|--------------|
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP | 213.310,60 | 0,00 | 0,00 | 539.219,80 | 325.909,20 | 152,79% | -3,29% | 5,00% |
| RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11 | 2.214.600,00 | 0,00 | 17.000,00 | 2.257.000,00 | 59.400,00 | 2,68% | 1,91% | 4,09% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 30.828.266,79 | 0,00 | 0,00 | 31.342.177,14 | 513.910,35 | 1,67% | 1,67% | 4,62% |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | 1.619.091,85 | 0,00 | 0,00 | 1.645.588,24 | 26.496,39 | 1,64% | 0,00% | - |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 26.081.371,89 | 0,00 | 0,00 | 26.500.950,12 | 419.578,23 | 1,61% | 1,61% | 4,22% |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 30.823.866,81 | 0,00 | 0,00 | 30.971.783,32 | 147.916,51 | 0,48% | 0,48% | 4,00% |
| BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | 1.522.438,44 | 0,00 | 0,00 | 1.520.964,53 | -1.473,91 | -0,10% | - | - |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 2.006.530,40 | 0,00 | 0,00 | 2.003.605,00 | -2.925,40 | -0,15% | 0,00% | 0,60% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 31.806.052,22 | 0,00 | 0,00 | 31.738.932,19 | -67.120,03 | -0,21% | -0,21% | 4,87% |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 225.669,24 | 0,00 | 0,00 | 224.775,43 | -893,81 | -0,40% | -0,40% | 0,00% |
| BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11 | 269.093,40 | 0,00 | 1.493,16 | 262.926,00 | -4.674,24 | -1,74% | -2,29% | 3,67% |
| Total Renda Variável | 127.610.291,65 | 0,00 | 18.493,16 | 129.007.921,78 | 1.416.123,29 | 1,11% | | 4,37% |

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 |
|---|----------------------|-------------|-------------|----------------------|--------------------|---------------|------------|--------------|
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E... | 13.618.201,22 | 0,00 | 0,00 | 13.461.606,26 | -156.594,96 | -1,15% | -1,15% | 7,83% |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN... | 14.544.625,07 | 0,00 | 0,00 | 14.003.310,24 | -541.314,83 | -3,72% | -3,72% | 6,90% |
| Total Exterior | 28.162.826,29 | 0,00 | 0,00 | 27.464.916,50 | -697.909,79 | -2,48% | | 7,36% |

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 |
|---|----------------|---------------|---------------|-------------------------|---------------------|--------------|------------|
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 70.351.769,20 | 0,00 | 0,00 | 71.823.772,10 | 1.472.002,90 | 2,09% | 2,09% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 96.692.212,16 | 0,00 | 45.340.353,40 | 52.506.656,25 | 1.154.797,49 | 1,19% | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 66.003.650,04 | 30.470.000,00 | 0,00 | 97.553.336,35 | 1.079.686,31 | 1,12% | 1,59% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 47.565.975,45 | 0,00 | 0,00 | 48.145.325,92 | 579.350,47 | 1,22% | 1,22% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 68.910.725,66 | 63.010.000,00 | 43.747.000,00 | 88.732.206,49 | 558.480,83 | 0,42% | 0,60% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 51.098.608,71 | 10.000.000,00 | 0,00 | 61.605.124,86 | 506.516,15 | 0,83% | 0,90% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 47.317.740,48 | 0,00 | 0,00 | 47.632.894,02 | 315.153,54 | 0,67% | 0,67% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 43.420.609,36 | 0,00 | 30.000.000,00 | 13.681.840,91 | 261.231,55 | 0,60% | 1,13% |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 3.713.301,69 | 0,00 | 0,00 | 3.741.647,02 | 28.345,33 | 0,76% | 0,76% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 1.788.402,06 | 0,00 | 0,00 | 1.797.266,94 | 8.864,88 | 0,50% | 0,50% |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNI... | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNI... | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNI... | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | 0,00% |
| BRA1 FI RENDA FIXA | 536.371,31 | 0,00 | 45.878,81 | 488.465,98 | -2.026,52 | -0,38% | -8,93% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.121.935,51 | 0,00 | 39.353,78 | 1.074.568,15 | -8.013,58 | -0,71% | -4,22% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 1.760.282,79 | 0,00 | 0,00 | 1.696.349,78 | -63.933,01 | -3,63% | -3,63% |
| | | | | Total Renda Fixa | 5.890.456,34 | 0,98% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|---|----------------|------------|------------|-----------------------------|----------------------|---------------|------------|
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 23.299.847,73 | 0,00 | 0,00 | 26.500.950,12 | 3.201.102,39 | 13,74% | 13,74% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 28.593.056,69 | 0,00 | 0,00 | 31.738.932,19 | 3.145.875,50 | 11,00% | 11,00% |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 27.848.930,28 | 0,00 | 0,00 | 30.971.783,32 | 3.122.853,04 | 11,21% | 11,21% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 28.681.000,35 | 0,00 | 0,00 | 31.342.177,14 | 2.661.176,79 | 9,28% | 9,28% |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP | 215.328,20 | 0,00 | 0,00 | 539.219,80 | 323.891,60 | 150,42% | 150,42% |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | 1.921.566,10 | 0,00 | 388.886,66 | 1.645.588,24 | 112.908,80 | 5,88% | 0,33% |
| RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11 | 2.214.000,00 | 0,00 | 51.000,00 | 2.257.000,00 | 94.000,00 | 4,25% | 1,94% |
| BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11 | 266.172,00 | 0,00 | 4.479,48 | 262.926,00 | 1.233,48 | 0,46% | -1,22% |
| BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP | 23,50 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | -23,49 | -99,96% | -100,00% |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 227.484,55 | 0,00 | 0,00 | 224.775,43 | -2.709,12 | -1,19% | -1,19% |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | 1.525.517,32 | 0,00 | 0,00 | 1.520.964,53 | -4.552,79 | -0,30% | -0,30% |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 2.019.215,92 | 0,00 | 0,00 | 2.003.605,00 | -15.610,92 | -0,77% | -0,77% |
| | | | | Total Renda Variável | 12.640.145,28 | 10,82% | |

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 |
|---|----------------|---------------|----------|-----------------------|----------------------|---------------|------------|
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN... | 5.979.795,81 | 9.000.000,00 | 0,00 | 14.003.310,24 | -976.485,57 | -6,52% | -4,20% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E... | 0,00 | 15.000.000,00 | 0,00 | 13.461.606,26 | -1.538.393,74 | -10,26% | -4,10% |
| | | | | Total Exterior | -2.514.879,31 | -8,39% | |

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit |
|--|----------------|---------------|---------------|-------------------------|---------------------|--------------|------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | 95.287.356,19 | 0,00 | 46.276.303,71 | 52.506.656,25 | 3.495.603,77 | 3,67% | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 65.075.853,74 | 31.420.000,00 | 0,00 | 97.553.336,35 | 1.057.482,61 | 1,10% | 1,56% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 53.074.807,27 | 88.770.000,00 | 53.711.000,00 | 88.732.206,49 | 598.399,22 | 0,42% | 0,65% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 47.158.043,34 | 0,00 | 0,00 | 47.632.894,02 | 474.850,68 | 1,01% | 1,01% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 51.192.179,13 | 10.000.000,00 | 0,00 | 61.605.124,86 | 412.945,73 | 0,67% | 0,72% |
| 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% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 1.117.214,29 | 0,00 | 39.353,78 | 1.074.568,15 | -3.292,36 | -0,29% | -3,82% |
| LME REC IMA-B FI RENDA FIXA | 3.747.135,36 | 0,00 | 0,00 | 3.741.647,02 | -5.488,34 | -0,15% | -0,15% |
| BRA1 FI RENDA FIXA | 588.856,99 | 0,00 | 91.757,62 | 488.465,98 | -8.633,39 | -1,47% | -17,05% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 1.835.861,87 | 0,00 | 0,00 | 1.797.266,94 | -38.594,93 | -2,10% | -2,10% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 1.770.892,46 | 0,00 | 0,00 | 1.696.349,78 | -74.542,68 | -4,21% | -4,21% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 48.475.489,13 | 0,00 | 0,00 | 48.145.325,92 | -330.163,21 | -0,68% | -0,68% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 72.416.199,36 | 0,00 | 0,00 | 71.823.772,10 | -592.427,26 | -0,82% | -0,82% |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 44.664.843,77 | 0,00 | 30.000.000,00 | 13.681.840,91 | -983.002,86 | -2,20% | -1,69% |
| | | | | Total Renda Fixa | 4.003.136,98 | 0,82% | |

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 |
|--|----------------|------------|--------------|-----------------------------|----------------------|--------------|------------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 28.282.216,50 | 0,00 | 0,00 | 31.738.932,19 | 3.456.715,69 | 12,22% | 12,22% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 23.392.520,88 | 0,00 | 0,00 | 26.500.950,12 | 3.108.429,24 | 13,29% | 13,29% |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 28.753.732,43 | 0,00 | 0,00 | 30.971.783,32 | 2.218.050,89 | 7,71% | 7,71% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 29.710.745,46 | 0,00 | 0,00 | 31.342.177,14 | 1.631.431,68 | 5,49% | 5,49% |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP | 218.012,05 | 0,00 | 0,00 | 539.219,80 | 321.207,75 | 147,33% | 147,33% |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | 2.626.105,95 | 0,00 | 1.185.228,21 | 1.645.588,24 | 204.710,50 | 7,80% | -7,96% |
| RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11 | 2.360.000,00 | 0,00 | 106.000,00 | 2.257.000,00 | 3.000,00 | 0,13% | -4,36% |
| BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP | 105,92 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | -105,91 | -99,99% | -100,00% |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 230.305,58 | 0,00 | 0,00 | 224.775,43 | -5.530,15 | -2,40% | -2,40% |
| BRASIL FLORESTAL FICFIP | 1.531.051,33 | 0,00 | 0,00 | 1.520.964,53 | -10.086,80 | -0,66% | -0,66% |
| BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11 | 288.050,04 | 0,00 | 9.251,93 | 262.926,00 | -15.872,11 | -5,51% | -8,72% |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 2.040.285,96 | 0,00 | 0,00 | 2.003.605,00 | -36.680,96 | -1,80% | -1,27% |
| | | | | Total Renda Variável | 10.875.269,82 | 9,11% | |

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 |
|---|----------------|---------------|-----------------------|---------------|----------------------|---------------|------------|
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN... | 5.240.339,18 | 9.000.000,00 | 0,00 | 14.003.310,24 | -237.028,94 | -1,66% | 9,31% |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E... | 0,00 | 15.000.000,00 | 0,00 | 13.461.606,26 | -1.538.393,74 | -10,26% | 2,21% |
| | | | Total Exterior | | -1.775.422,68 | -6,07% | |

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.