

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2021



**Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2021)**

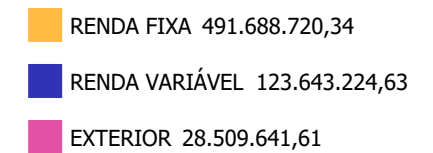
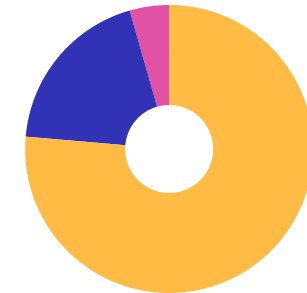
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			52.353.686,84	8,13%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	48.025.128,70	7,46%	590	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	71.548.298,76	11,11%	661	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	91.024.826,54	14,14%	1.154	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	61.127.302,75	9,49%	984	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	97.489.987,44	15,14%	1.050	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	13.617.687,78	2,12%	385	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	486.027,17	0,08%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	47.707.144,14	7,41%	251	1,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.743.180,44	0,58%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.070.414,63	0,17%	18	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.802.128,28	0,28%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.692.906,84	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	29.418.376,79	4,57%	9.033	4,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	25.323.434,72	3,93%	6.135	1,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	29.875.873,21	4,64%	1.181	9,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	30.762.522,95	4,78%	36.608	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 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	223.869,33	0,03%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.519.286,74	0,24%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIELABORAÇÃO FIP	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	15	100,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIELABORAÇÃO FIP	Não se ...	Não se aplica	537.528,80	0,08%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.997.654,49	0,31%		5,28%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	S/Info	Não se aplica	262.958,46	0,04%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se ...	Não se aplica	2.297.000,00	0,36%		0,17%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.424.719,13	0,22%		3,04%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	13.618.324,43	2,12%	17.232	0,84%	Artigo 9º - A, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	14.891.317,18	2,31%	191	6,09%	Artigo 9º - A, Inciso II
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		345.312,24	0,05%		0,00%	DF - Artigo 6º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>643.841.586,58</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>345.312,24</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>644.186.898,82</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 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%	52.353.686,84	8,13%	5,00%	10,00%	100,00%	591.487.899,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	382.833.231,97	59,46%	10,00%	52,50%	100,00%	261.008.354,61
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	45,00%	53.006.766,38	8,23%	0,00%	10,00%	40,00%	204.529.868,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	3.495.035,15	0,54%	0,00%	0,50%	3,00%	15.820.212,45
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>491.688.720,34</b>	<b>76,37%</b>	<b>15,00%</b>	<b>73,00%</b>	<b>243,00%</b>	

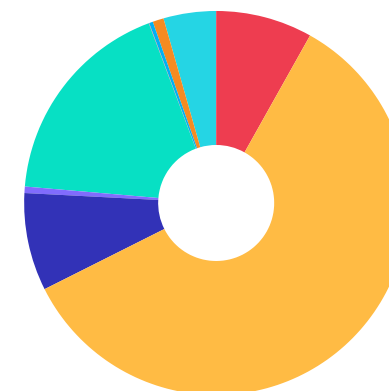


**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

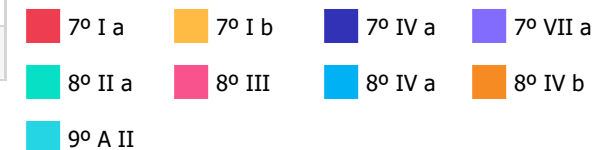


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2021)

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%	96.576.237,99
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	96.576.237,99
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	115.380.207,67	17,92%	5,00%	17,50%	20,00%	13.388.109,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	32.192.079,33
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	223.869,33	0,03%	0,00%	0,50%	5,00%	31.968.210,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.056.815,55	0,32%	0,00%	1,00%	5,00%	30.135.263,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	5.982.332,08	0,93%	0,00%	1,00%	5,00%	26.209.747,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	32.192.079,33
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>123.643.224,63</b>	<b>19,20%</b>	<b>5,00%</b>	<b>22,00%</b>	<b>75,00%</b>	



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%	32.192.079,33
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	28.509.641,61	4,43%	0,00%	5,00%	10,00%	35.874.517,05
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	32.192.079,33
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>28.509.641,61</b>	<b>4,43%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>20,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	210.598.254,00	32,71	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	172.234.977,97	26,75	0,03
ITAU UNIBANCO	78.469.667,09	12,19	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	54.741.811,51	8,50	0,20
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	52.353.686,84	8,13	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	29.875.873,21	4,64	0,05
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	14.891.317,18	2,31	0,30
XP ASSET MANAGEMENT	13.618.324,43	2,12	0,21
GRAPHEN INVESTIMENTOS	5.769.178,05	0,90	1,76
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.427.687,53	0,84	0,58
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.297.000,00	0,36	0,63
PETRA CAPITAL	1.692.906,84	0,26	0,03
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.070.414,63	0,17	0,04
PLURAL	537.528,83	0,08	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	262.958,46	0,04	0,00
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 '	52.353.686,84	8,13	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	382.833.231,97	59,46	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	53.006.766,38	8,23	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	115.380.207,67	17,92	10,00	20,00
Artigo 9º - A, Inciso II	28.509.641,61	4,43	0,00	10,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-0,18%	1,68%	0,38%	1,54%	5,88%	15,07%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	1,50%	0,50%	1,36%	5,46%	14,00%	0,95%	0,02%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,56%	8,92%	4,11%	8,07%	16,56%	27,63%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,27%	-1,84%	0,45%	-1,87%	-3,22%	-8,08%	0,42%	0,04%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,19%	1,00%	0,60%	0,96%	1,99%	7,60%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	0,82%	0,52%	0,79%	1,58%	6,89%	0,23%	0,00%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,37%	-1,09%	1,10%	-0,24%	2,53%	10,89%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-1,20%	1,05%	-0,34%	2,27%	10,39%	2,07%	0,06%
BRA1 FI RENDA FIXA	-0,50%	-17,46%	-9,45%	-17,21%	-29,11%	-64,33%	0,51%	0,13%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,47%	-2,04%	-0,06%	-1,25%	-1,40%	8,27%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,47%	-2,15%	-0,12%	-1,39%	-1,63%	7,76%	1,28%	0,03%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,96%	4,76%	2,34%	4,50%	8,99%	11,51%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,16%	1,16%	0,72%	1,03%	1,19%	6,46%	0,42%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,78%	-0,06%	-0,54%	-0,09%	0,90%	10,67%	1,68%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não Possui (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,20%	-4,40%	-3,74%	-4,21%	1,26%	-9,80%	0,04%	0,08%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	900,00%	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	900,00%	900,00%	-	900,00%	900,00%	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	900,00%	900,00%	-	900,00%	900,00%	-	-	-

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,04%	-0,11%	0,52%	0,17%	-0,52%	-0,09%	0,76%	0,02%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,39%	-4,19%	-4,35%	-3,86%	-14,01%	-20,63%	1,53%	0,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,25%	-0,93%	0,34%	-0,38%	0,55%	7,68%	1,14%	0,03%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,84%	10,96%	4,97%	9,81%	20,34%	36,10%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,31%	146,56%	150,83%	147,70%	-	-92,59%	0,02%	0,03%

<b>IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,88%	11,25%	5,09%	10,05%	20,88%	37,33%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	0,00%	-	-	-	-	-	0,00%	1,17%

<b>IBX (Benchmark)</b>	-3,99%	4,47%	2,33%	7,73%	20,73%	23,34%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-4,44%	8,25%	1,64%	10,37%	15,22%	28,77%	8,99%	0,18%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-3,94%	2,34%	2,44%	5,85%	18,35%	19,63%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-5,02%	2,31%	0,78%	5,08%	9,87%	10,77%	8,23%	0,17%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,68%	0,56%	2,27%	3,93%	13,72%	17,66%	8,11%	0,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-3,08%	8,77%	4,14%	10,39%	23,74%	22,61%	6,67%	0,17%

<b>IFIX (Benchmark)</b>	2,51%	-1,60%	-1,29%	-1,92%	3,33%	6,19%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	0,01%	-8,71%	-5,21%	-9,89%	-10,98%	-16,60%	6,95%	0,12%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	1,77%	-2,67%	5,32%	1,01%	-9,81%	-18,55%	3,71%	0,11%

<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-1,27%	-6,09%	0,26%	-3,74%	-19,79%	0,00%	0,30%

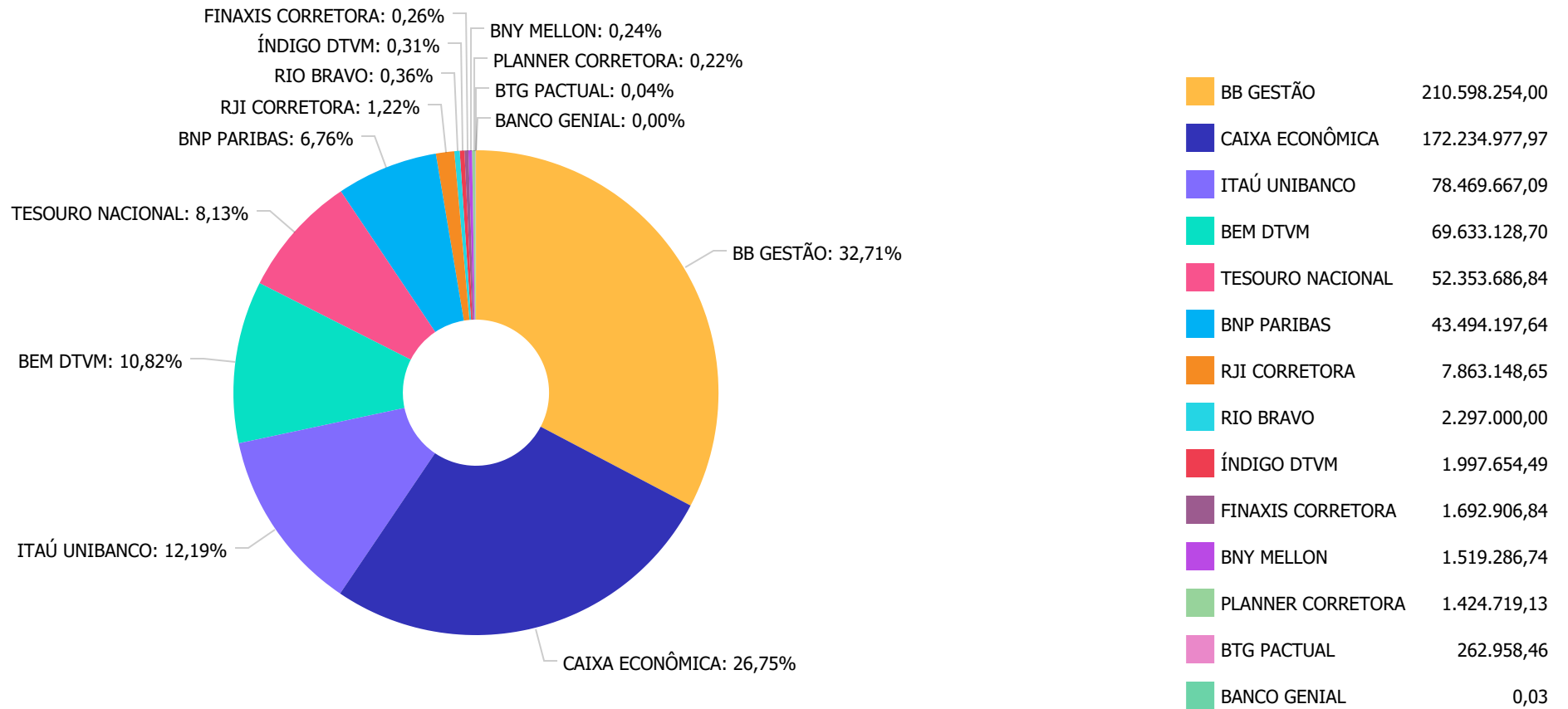
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-2,22%	-8,52%	143,05%	-7,06%	-4,75%	67,54%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,11%	-0,77%	-0,31%	-0,61%	-1,61%	30,50%	-	0,00%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,40%	-2,80%	-1,20%	-2,42%	-4,79%	-3,39%	0,00%	0,00%

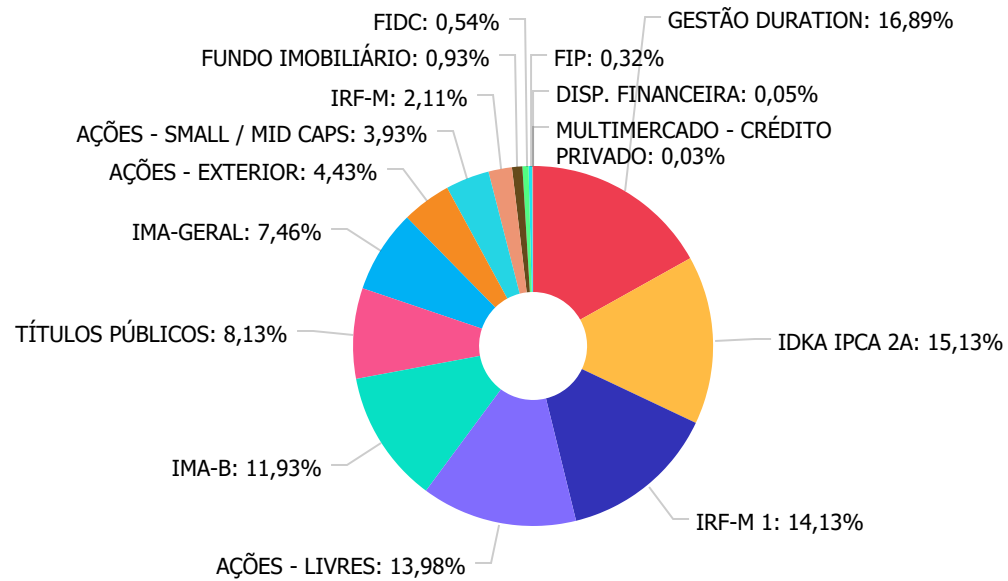
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	1,16%	3,40%	-5,39%	-0,87%	26,07%	-	8,81%	0,18%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	6,34%	16,25%	0,63%	9,39%	-	-	7,80%	-

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



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



GESTÃO DURATION	108.834.446,89
IDKA IPCA 2A	97.489.987,44
IRF-M 1	91.024.826,54
AÇÕES - LIVRES	90.056.772,95
IMA-B	76.847.921,00
TÍTULOS PÚBLICOS	52.353.686,84
IMA-GERAL	48.025.128,70
AÇÕES - EXTERIOR	28.509.641,61
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	25.323.434,72
IRF-M	13.617.687,78
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	5.982.332,08
FIDC	3.495.035,15
FIP	2.056.815,55
DISP. FINANCEIRA	345.312,24
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	223.869,33

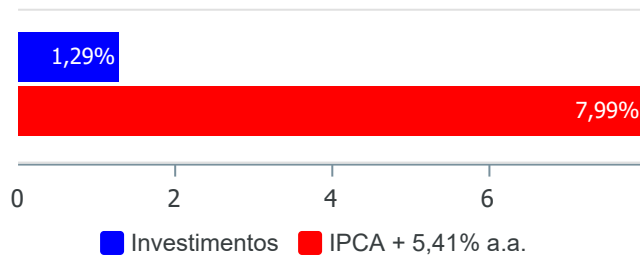
## Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2021)

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	3.919,757461	992.130,00	2.939.818,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.919,757461	998.799,60	2.979.015,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.919,757461	1.000.585,27	3.018.213,24	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.919,757461	1.124.114,15	3.331.793,84	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.919,757461	1.006.644,67	2.939.818,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.919,757461	999.750,00	2.939.818,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1.100	1.352,073136	3.919,757461	1.487.280,45	4.311.733,21	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.919,757461	859.423,87	2.469.447,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.919,757461	136.416,48	391.975,75	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.919,757461	997.614,60	2.861.422,95	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1.100	1.345,077073	3.919,757461	1.479.584,78	4.311.733,21	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.919,757461	1.098.188,08	3.449.386,57	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.415,907159	895.805,83	2.693.703,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1.010	1.468,534139	4.415,907159	1.483.219,48	4.460.066,23	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1.180	1.468,534144	4.415,907159	1.732.870,29	5.210.770,45	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.415,907159	1.249.170,73	4.044.970,96	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%
Julho	634.274.225,65	4.940.000,00	3.353.957,95	630.842.161,70	-5.018.106,00	8.004.619,72	-0,79%	1,29%	1,43%	7,99%	16,17%	2,76%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



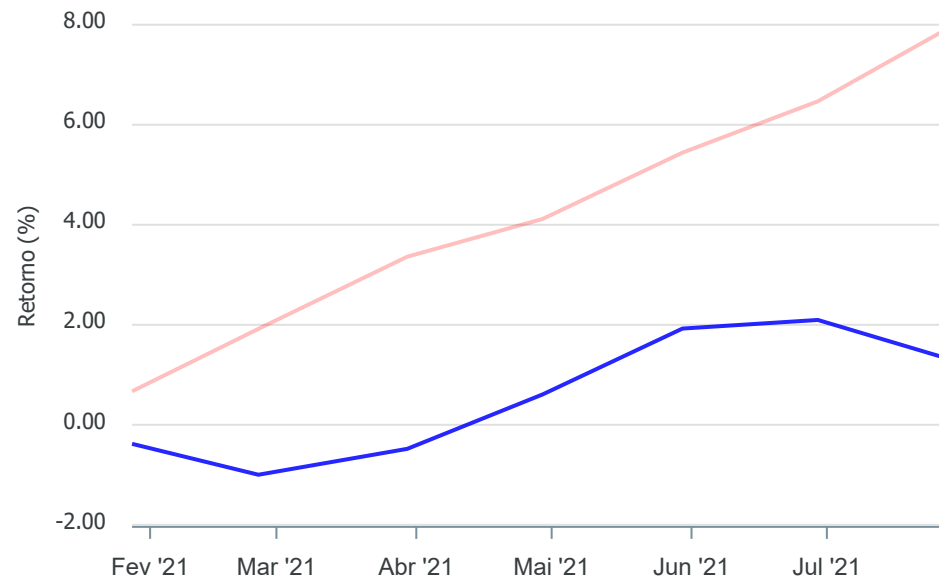
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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 Julho/2021

## FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.797.266,94	0,00	0,00	1.802.128,28	4.861,34	0,27%	0,27%	0,42%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	88.732.206,49	5.340.000,00	3.200.000,00	91.024.826,54	152.620,05	0,16%	0,16%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	47.632.894,02	0,00	0,00	47.707.144,14	74.250,12	0,16%	0,16%	0,42%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.741.647,02	0,00	0,00	3.743.180,44	1.533,42	0,04%	0,04%	0,76%
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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	97.553.336,35	0,00	0,00	97.489.987,44	-63.348,91	-0,06%	-0,06%	0,95%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.696.349,78	0,00	0,00	1.692.906,84	-3.442,94	-0,20%	-0,20%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.145.325,92	0,00	0,00	48.025.128,70	-120.197,22	-0,25%	-0,25%	1,14%
TÍTULOS PÚBLICOS	52.506.656,25	0,00	0,00	52.353.686,84	-152.969,41	-0,29%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	71.823.772,10	0,00	0,00	71.548.298,76	-275.473,34	-0,38%	-0,38%	2,07%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.074.568,15	0,00	0,00	1.070.414,63	-4.153,52	-0,39%	-0,39%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	13.681.840,91	0,00	0,00	13.617.687,78	-64.153,13	-0,47%	-0,47%	1,28%
BRA1 FI RENDA FIXA	488.465,98	0,00	0,00	486.027,17	-2.438,81	-0,50%	-0,50%	0,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	61.605.124,86	0,00	0,00	61.127.302,75	-477.822,11	-0,78%	-0,78%	1,68%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>490.479.454,80</b>	<b>5.340.000,00</b>	<b>3.200.000,00</b>	<b>491.688.720,34</b>	<b>-930.734,46</b>	<b>-0,19%</b>		<b>1,05%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.257.000,00	0,00	24.800,00	2.297.000,00	64.800,00	2,87%	1,77%	3,71%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	262.926,00	0,00	1.493,16	262.958,46	1.525,62	0,58%	0,01%	6,95%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.645.588,24	0,00	227.664,79	1.424.719,13	6.795,68	0,41%	-2,22%	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	1.520.964,53	0,00	0,00	1.519.286,74	-1.677,79	-0,11%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.003.605,00	0,00	0,00	1.997.654,49	-5.950,51	-0,30%	0,00%	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	539.219,80	0,00	0,00	537.528,80	-1.691,00	-0,31%	-0,31%	0,02%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	224.775,43	0,00	0,00	223.869,33	-906,10	-0,40%	-0,40%	0,00%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	31.738.932,19	0,00	0,00	30.762.522,95	-976.409,24	-3,08%	-3,08%	6,67%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	26.500.950,12	0,00	0,00	25.323.434,72	-1.177.515,40	-4,44%	-4,44%	8,99%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	31.342.177,14	0,00	0,00	29.875.873,21	-1.466.303,93	-4,68%	-4,68%	8,11%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	30.971.783,32	0,00	0,00	29.418.376,79	-1.553.406,53	-5,02%	-5,02%	8,23%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>129.007.921,78</b>	<b>0,00</b>	<b>253.957,95</b>	<b>123.643.224,63</b>	<b>-5.110.739,20</b>	<b>-3,96%</b>		<b>7,69%</b>

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

## FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	14.003.310,24	0,00	0,00	14.891.317,18	888.006,94	6,34%	6,34%	7,80%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	13.461.606,26	0,00	0,00	13.618.324,43	156.718,17	1,16%	1,16%	8,81%
<b>Total Exterior</b>	<b>27.464.916,50</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>28.509.641,61</b>	<b>1.044.725,11</b>	<b>3,80%</b>		<b>8,28%</b>

## 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.