

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

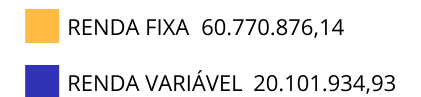
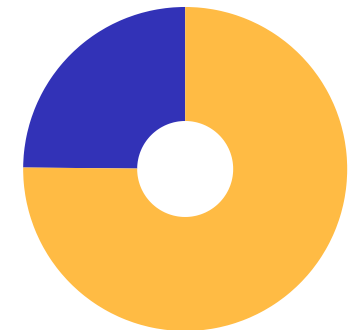
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	13.554.431,33	16,76%	992	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.141.110,45	7,59%	745	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.345.556,52	1,66%	662	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.130.255,34	5,11%	1.169	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	315.454,69	0,39%	165	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	13.279.448,02	16,42%	974	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.290.725,88	1,60%	1.007	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	5.626.940,09	6,96%	883	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	211.316,77	0,26%	1.309	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	14.337.819,63	17,73%	572	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	129.778,04	0,16%	793	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	390.871,59	0,48%	659	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	17.167,79	0,02%	16.043	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.337.378,08	5,36%	2.840	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.941.066,79	3,64%	25.862	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.227.435,38	1,52%	20.596	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.579.169,51	4,43%	2.355	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.471.821,07	1,82%	200	0,38%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	709.315,34	0,88%	126	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.835.748,76	7,22%	16.802	0,29%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			80.872.811,07				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			68.565,33	Artigo 6º			
PL Total			80.941.376,40				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Junho / 2021)

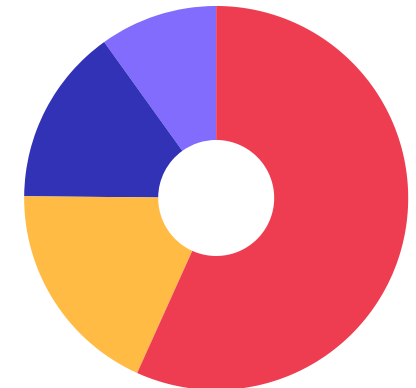
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	45.895.239,09	56,75%	11,51%	52,54%	89,18%	26.227.133,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	14.875.637,05	18,39%	2,06%	20,32%	40,00%	17.473.487,38
Total Renda Fixa	100,00%	60.770.876,14	75,14%	13,57%	72,86%	129,18%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2021)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	12.085.049,76	14,94%	3,69%	18,45%	20,00%	4.089.512,45
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.016.885,17	9,91%	3,07%	8,07%	10,00%	70.395,94
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	20.101.934,93	24,86%	6,76%	26,52%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	4.043.640,55
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	4.043.640,55
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,62%	10,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	50.322.978,91	62,22	0,00
CAIXA DTVM	30.549.832,16	37,78	-

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	11,51	89,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	2,06	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	3,69	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,07	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

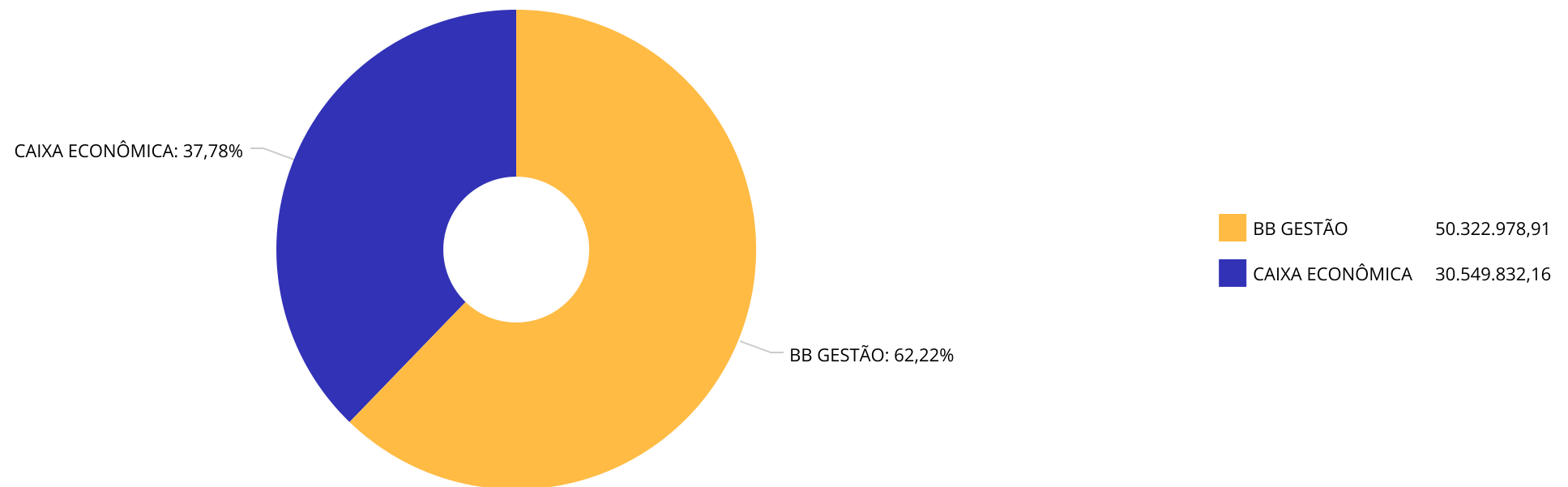
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,32%	1,87%	1,91%	1,87%	7,06%	16,45%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,21%	0,81%	0,68%	0,81%	2,04%	8,17%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
IMA-B (Benchmark)	0,42%	-0,72%	2,14%	-0,72%	7,42%	12,74%	-	-
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-

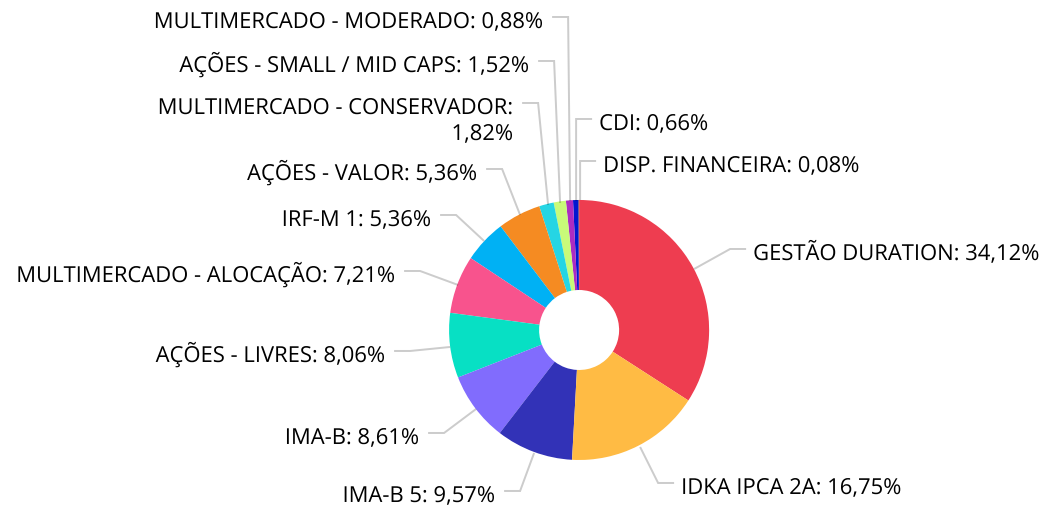
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
SMLL (Benchmark)	1,29%	11,42%	12,41%	11,42%	39,64%	46,83%	-	-

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



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



■ GESTÃO DURATION	27.617.267,65	■ IDKA IPCA 2A	13.554.431,33	■ IMA-B 5	7.747.291,02
■ IMA-B	6.972.496,61	■ AÇÕES - LIVRES	6.520.236,30	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	5.835.748,76
■ IRF-M 1	4.341.572,11	■ AÇÕES - VALOR	4.337.378,08	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.471.821,07
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.227.435,38	■ MULTIMERCADO - MODERADO	709.315,34	■ CDI	537.817,42
■ DISP. FINANCEIRA	68.565,33				

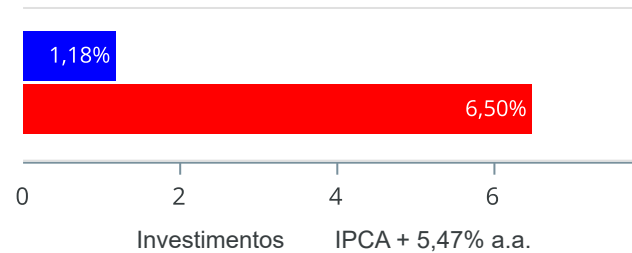
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

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	80.019.819,02	2.250.171,02	2.178.938,13	79.565.737,47	-525.314,44	-525.314,44	-0,66%	-0,66%	0,67%	0,67%	-97,22%	2,19%
Fevereiro	79.565.737,47	65.652,90	644.967,58	78.159.871,17	-826.551,62	-1.351.866,06	-1,04%	-1,69%	1,24%	1,93%	-87,57%	2,15%
Março	78.159.871,17	921.710,41	630.818,01	78.864.906,52	414.142,95	-937.723,11	0,53%	-1,17%	1,42%	3,38%	-34,62%	2,60%
Abril	78.864.906,52	24.280.319,16	24.118.247,73	79.729.753,36	702.775,41	-234.947,70	0,89%	-0,29%	0,73%	4,14%	-7,01%	1,91%
Maio	79.729.753,36	494.860,74	654.494,23	80.682.671,86	1.112.551,99	877.604,29	1,40%	1,10%	1,28%	5,47%	20,14%	2,11%
Junho	80.682.671,86	1.115.521,52	989.188,55	80.872.811,07	63.806,24	941.410,53	0,08%	1,18%	0,98%	6,50%	18,18%	1,93%

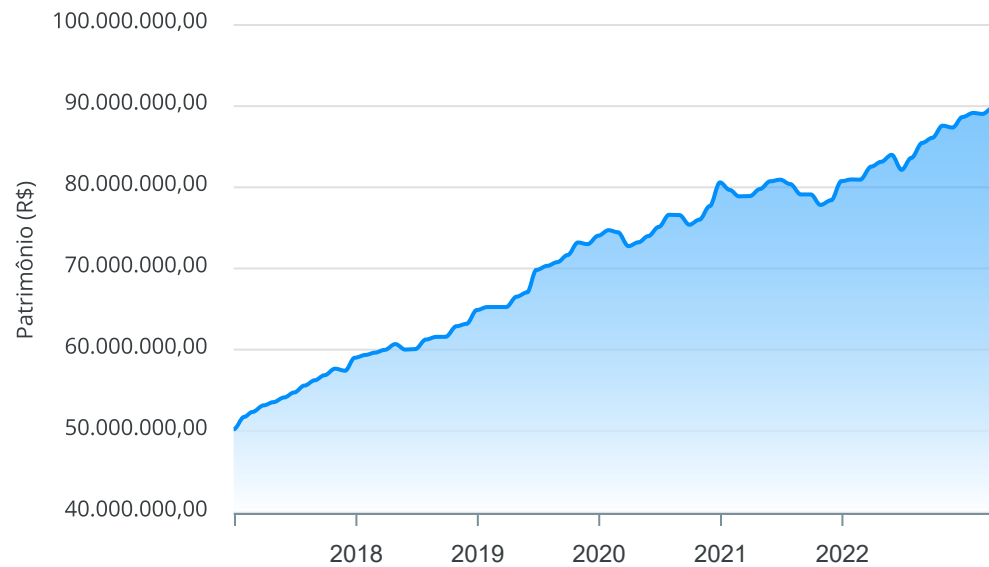
Investimentos x Meta de Rentabilidade



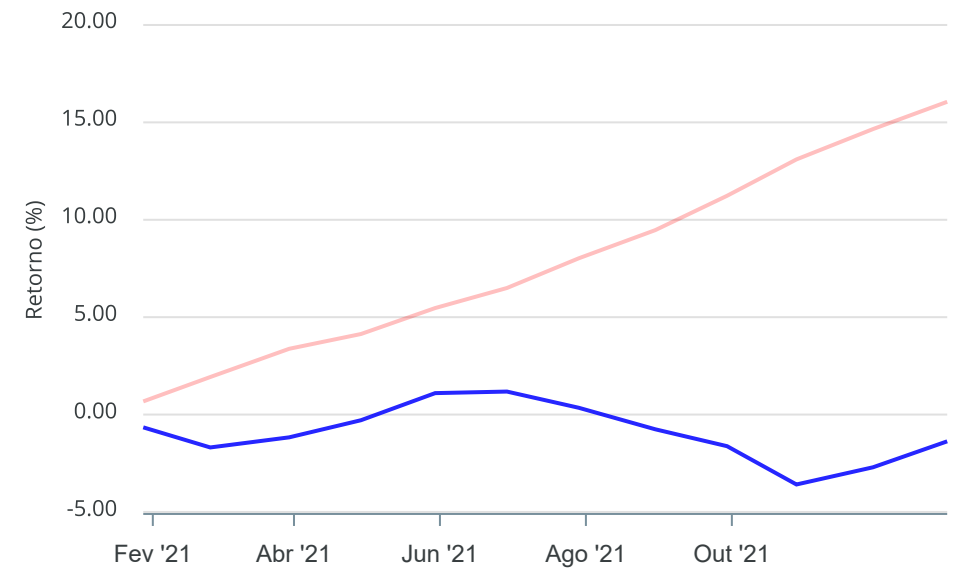
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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 Junho/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.564.064,68	0,00	965.256,27	5.626.940,09	28.131,68	0,43%	0,40%	2,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.340.520,78	0,00	0,00	1.345.556,52	5.035,74	0,38%	0,38%	2,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	314.354,59	0,00	0,00	315.454,69	1.100,10	0,35%	0,35%	0,84%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	389.590,24	0,00	0,00	390.871,59	1.281,35	0,33%	0,33%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	114.765,99	18.191,07	3.460,45	129.778,04	281,43	0,21%	0,22%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	210.918,90	0,00	0,00	211.316,77	397,87	0,19%	0,19%	0,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.122.832,26	0,00	0,00	4.130.255,34	7.423,08	0,18%	0,18%	0,16%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.163,64	34.454,87	20.471,83	17.167,79	21,11	0,06%	0,16%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	14.317.233,78	13.902,83	0,00	14.337.819,63	6.683,02	0,05%	0,05%	1,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.627.938,13	650.956,38	0,00	13.279.448,02	553,51	0,00%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.567.117,74	0,00	0,00	13.554.431,33	-12.686,41	-0,09%	-0,09%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.292.661,11	0,00	0,00	1.290.725,88	-1.935,23	-0,15%	-0,15%	1,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.152.544,39	0,00	0,00	6.141.110,45	-11.433,94	-0,19%	-0,19%	1,55%
Total Renda Fixa	61.017.706,23	717.505,15	989.188,55	60.770.876,14	24.853,31	0,04%		1,34%

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
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.208.577,47	0,00	0,00	1.227.435,38	18.857,91	1,56%	1,56%	6,70%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.325.565,77	200.000,00	0,00	3.579.169,51	53.603,74	1,52%	1,66%	4,45%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.635.231,20	179.056,35	0,00	5.835.748,76	21.461,21	0,37%	0,39%	1,47%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.468.880,81	0,00	0,00	1.471.821,07	2.940,26	0,20%	0,20%	0,46%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	709.284,94	0,00	0,00	709.315,34	30,40	0,00%	0,00%	0,80%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.352.696,48	18.960,02	0,00	4.337.378,08	-34.278,42	-0,78%	-0,77%	5,64%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.964.728,96	0,00	0,00	2.941.066,79	-23.662,17	-0,80%	-0,80%	5,55%
Total Renda Variável	19.664.965,63	398.016,37	0,00	20.101.934,93	38.952,93	0,19%		3,72%

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
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.369.963,97	0,00	3.000.000,00	13.554.431,33	184.467,36	1,13%	1,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.447.166,98	3.729.491,06	0,00	14.337.819,63	161.161,59	1,14%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.089.192,32	0,00	1.605.538,80	5.626.940,09	143.286,57	2,02%	2,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.019.261,64	4.164.014,31	0,00	13.279.448,02	96.172,07	0,73%	0,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.058.120,49	0,00	0,00	6.141.110,45	82.989,96	1,37%	1,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	55.524,95	11.213.731,42	11.198.928,96	129.778,04	59.450,63	0,53%	0,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.317.979,81	0,00	0,00	1.345.556,52	27.576,71	2,09%	2,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.105.544,53	0,00	0,00	4.130.255,34	24.710,81	0,60%	0,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.898.776,14	0,00	631.445,60	1.290.725,88	23.395,34	1,23%	1,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	310.765,52	0,00	0,00	315.454,69	4.689,17	1,51%	1,51%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	387.713,13	0,00	0,00	390.871,59	3.158,46	0,81%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	209.967,44	0,00	0,00	211.316,77	1.349,33	0,64%	0,64%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	5.256,14	34.454,87	22.572,33	17.167,79	29,11	0,07%	0,36%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.189.635,09	0,00	8.178.745,53	0,00	-10.889,56	-0,13%	1,15%
Total Renda Fixa	65.464.868,15	19.141.691,66	24.637.231,22	60.770.876,14	801.547,55	0,95%	

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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.063.770,77	200.000,00	0,00	3.579.169,51	315.398,74	9,66%	10,34%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.029.626,36	3.031.315,34	0,00	4.337.378,08	276.436,38	6,81%	7,31%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.330.159,48	405.870,82	0,00	2.941.066,79	205.036,49	7,49%	7,62%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.522.212,64	179.056,35	0,00	5.835.748,76	134.479,77	2,36%	2,45%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	1.132.767,25	0,00	1.227.435,38	94.668,13	8,36%	14,12%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.100.000,00	1.124.699,29	0,00	24.699,29	2,25%	8,72%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.454.269,12	0,00	0,00	1.471.821,07	17.551,95	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	700.000,00	0,00	709.315,34	9.315,34	1,33%	1,94%
Total Renda Variável	13.400.038,37	6.749.009,76	1.124.699,29	20.101.934,93	1.077.586,09	5,66%	

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.370.548,52	0,00	3.000.000,00	13.554.431,33	183.882,81	1,12%	1,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.432.284,41	4.378.301,86	609.850,13	13.279.448,02	78.711,88	0,57%	0,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.056.306,10	13.902,86	0,00	6.141.110,45	70.901,49	1,17%	1,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	208.370,50	11.267.000,86	11.405.195,50	129.778,04	59.602,18	0,52%	0,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.103.392,20	0,00	0,00	4.130.255,34	26.863,14	0,65%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.518.662,73	0,00	1.243.235,80	1.290.725,88	15.298,95	0,61%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	317.073,05	0,00	8.424,19	315.454,69	6.805,83	2,15%	2,19%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.050.969,89	34.726,83	700.000,00	390.871,59	5.174,87	0,48%	1,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	209.857,33	0,00	0,00	211.316,77	1.459,44	0,70%	0,70%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	697.789,45	0,00	698.069,00	0,00	279,55	0,04%	1,13%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	13.389,63	34.454,87	30.711,14	17.167,79	34,43	0,07%	0,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.617.880,92	3.742.675,53	0,00	14.337.819,63	-22.736,82	-0,16%	-0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	6.327.327,72	1.586.912,74	2.217.723,65	5.626.940,09	-69.576,72	-0,88%	-0,84%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	480.182,70	968.007,80	0,00	1.345.556,52	-102.633,98	-7,09%	-0,82%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.426.983,04	0,00	8.178.745,53	0,00	-248.237,51	-2,95%	-1,70%
Total Renda Fixa	66.831.018,19	22.025.983,35	28.091.954,94	60.770.876,14	5.829,54	0,01%	

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.051.240,19	3.036.977,93	0,00	4.337.378,08	249.159,96	6,09%	4,52%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.135.178,06	200.000,00	0,00	3.579.169,51	243.991,45	7,32%	7,83%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.323.365,39	449.571,49	0,00	2.941.066,79	168.129,91	6,06%	5,81%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.225.512,38	482.935,73	0,00	5.835.748,76	127.300,65	2,23%	2,29%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	1.132.767,25	0,00	1.227.435,38	94.668,13	8,36%	10,35%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.100.000,00	1.124.699,29	0,00	24.699,29	2,25%	6,77%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.453.504,81	0,00	0,00	1.471.821,07	18.316,26	1,26%	1,26%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	700.000,00	0,00	709.315,34	9.315,34	1,33%	3,36%
Total Renda Variável	13.188.800,83	7.102.252,40	1.124.699,29	20.101.934,93	935.580,99	4,88%	

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 CRÉDITO & MERCADO. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

