

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

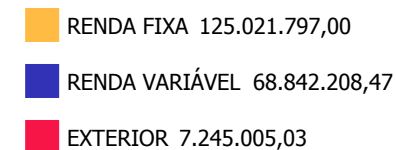
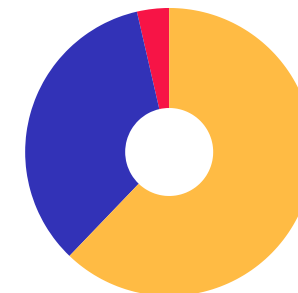
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.071.850,05	2,02%	1.007	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	18.328.916,72	9,11%	763	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.738.310,69	2,36%	653	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.182.099,45	1,58%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	27.897.474,50	13,87%	976	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	26.878.425,68	13,37%	1.048	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.726.378,66	3,84%	1.007	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.135.726,13	0,56%	76	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	324.578,67	0,16%	802	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.036.611,70	4,49%	195	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	280.947,87	0,14%	302	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.364.782,71	5,65%	249	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.308.178,32	2,64%	135	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	275.630,42	0,14%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.471.885,43	2,22%	33	3,24%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.087.143,98	1,54%	2.738	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.698.852,50	1,84%	5.846	0,94%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.518.632,19	1,25%	27.324	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.285.096,01	1,63%	1.147	1,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	8.858.890,62	4,41%	5.899	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	4.042.645,33	2,01%	138	0,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.174.674,28	2,08%	5.392	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.062.372,42	1,52%	239	2,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.983.344,72	1,48%	36.178	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.953.543,16	1,47%	2.402	0,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.019.559,46	2,50%	30.065	1,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.719.870,66	2,35%	21	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.681.777,64	3,32%	16.766	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.322.326,33	2,65%	936	3,58%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.223.829,63	1,11%	364	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	3.027.187,23	1,51%	15	3,28%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.182.462,31	1,58%	28	2,32%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕ...	D+6 du	Não há	3.099.315,10	1,54%	27	0,53%	Artigo 9º - A, Inciso II
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+5 du	Não há	986.900,88	0,49%	186	0,22%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	997.971,15	0,50%	37.463	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.160.817,90	1,07%	1.227	0,06%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			201.109.010,50				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	20.110.901,05
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	93.959.181,88	46,72%	15,00%	36,00%	76,00%	58.883.666,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	120.665.406,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	26.315.099,27	13,08%	5,00%	20,00%	40,00%	54.128.504,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	4.747.515,85	2,36%	0,00%	4,00%	10,00%	15.363.385,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.055.450,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.055.450,53
Total Renda Fixa	100,00%	125.021.797,00	62,17%	20,00%	60,00%	206,00%	



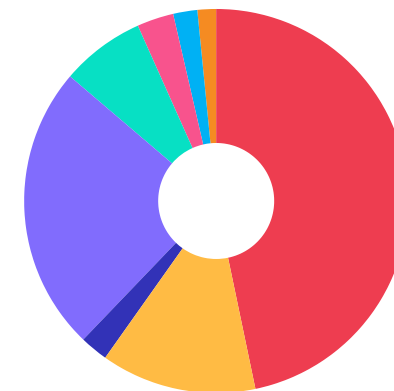
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	20.110.901,05
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	20.110.901,05
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30,00%	48.404.625,33	24,07%	7,00%	27,00%	30,00%	11.928.077,82
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	14.227.933,60	7,07%	5,00%	8,00%	10,00%	5.882.967,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	6.209.649,54	3,09%	0,00%	5,00%	5,00%	3.845.800,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.055.450,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.055.450,53
Total Renda Variável	40,00%	68.842.208,47	34,23%	12,00%	40,00%	75,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	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%	10.055.450,53
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	4.086.215,98	2,03%	0,00%	0,00%	10,00%	16.024.685,07
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	3.158.789,05	1,57%	0,00%	0,00%	10,00%	16.952.112,00
Total Exterior	10,00%	7.245.005,03	3,60%	0,00%	0,00%	25,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	69.465.004,35	34,54	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.047.670,50	21,90	0,00
ITAÚ UNIBANCO	20.643.206,63	10,26	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	11.886.077,85	5,91	0,00
TRÍGONO CAPITAL	9.739.430,12	4,84	0,26
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.036.611,70	4,49	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	5.520.373,66	2,74	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.322.326,33	2,65	0,08
GRAPHEN INVESTIMENTOS	4.471.885,43	2,22	1,41
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.174.674,28	2,08	0,23
VINCI PARTNERS	4.042.645,33	2,01	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.285.096,01	1,63	0,01
KPTL	3.182.462,31	1,58	0,83
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.062.372,42	1,52	0,49
PERFIN INVESTIMENTOS	2.953.543,16	1,47	0,02
PLURAL	275.630,42	0,14	0,00

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)

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 '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	93.959.181,88	46,72	15,00	76,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	26.315.099,27	13,08	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.747.515,85	2,36	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	48.404.625,33	24,07	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	14.227.933,60	7,07	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.209.649,54	3,09	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	4.086.215,98	2,03	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	3.158.789,05	1,57	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,26%	1,95%	-0,23%	2,29%	5,08%	15,28%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19%	1,70%	-0,15%	2,10%	4,83%	14,10%	1,13%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,47%	10,52%	4,18%	8,19%	17,33%	28,60%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-9,84%	-11,29%	-10,97%	-11,24%	-11,33%	-30,74%	15,58%	0,11%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,15%	1,47%	0,05%	1,97%	4,77%	14,45%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	1,30%	-0,06%	1,82%	4,51%	13,87%	1,31%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	2,17%	0,79%	2,54%	5,35%	15,88%	0,78%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	1,30%	0,00%	1,85%	4,50%	13,83%	1,29%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-1,09%	-2,17%	-1,04%	0,19%	3,27%	10,12%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,13%	-2,32%	-1,14%	0,07%	3,03%	9,60%	3,42%	0,06%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-1,59%	-4,31%	-1,78%	-0,79%	0,67%	8,93%	3,68%	0,08%
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	1,31%	0,77%	1,18%	1,53%	4,35%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,70%	2,44%	1,65%	2,72%	3,14%	-	0,29%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,87%	5,67%	2,38%	4,51%	9,68%	12,35%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-1,45%	-1,51%	-2,22%	-1,04%	-0,01%	9,20%	1,87%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,31%	1,47%	0,75%	1,28%	1,63%	6,45%	0,80%	0,00%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,50%	-1,50%	-0,37%	0,04%	0,46%	6,52%	1,57%	0,03%
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,35%	28,45%	12,92%	11,64%	26,94%	36,94%	0,03%	0,20%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,32%	1,44%	0,81%	1,28%	1,79%	4,84%	0,01%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	1,68%	0,17%	2,06%	5,08%	14,20%	1,09%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,75%	12,90%	5,05%	9,99%	21,15%	37,13%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-0,14%	2,31%	-0,39%	-2,05%	1,80%	-	-	0,04%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,55%	11,20%	4,43%	8,71%	18,42%	31,01%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,20%	7,79%	-0,55%	0,45%	7,33%	-	-	0,08%

IDIV (Benchmark)	-0,50%	-0,20%	-4,33%	10,92%	19,40%	15,05%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	3,58%	61,10%	11,53%	51,83%	109,26%	165,18%	10,79%	0,16%

Ibovespa (Benchmark)	-2,48%	-0,20%	-5,89%	7,95%	19,54%	17,45%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,82%	-7,11%	-9,94%	-4,11%	1,31%	11,58%	9,38%	0,15%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,13%	-2,43%	-7,66%	3,81%	-2,54%	7,21%	8,04%	0,15%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-2,88%	-1,82%	-7,47%	6,02%	15,38%	20,49%	8,78%	0,20%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,06%	0,75%	-5,54%	11,42%	22,72%	32,58%	7,26%	0,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,81%	0,25%	-4,83%	11,81%	26,40%	23,03%	7,17%	0,25%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,21%	6,37%	-5,41%	7,44%	21,25%	18,06%	7,73%	0,17%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,08%	60,23%	9,66%	50,99%	87,67%	-	11,72%	0,21%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-3,92%	-3,39%	-6,89%	4,54%	13,09%	15,01%	8,20%	0,21%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,21%	3,70%	-7,45%	10,80%	17,43%	16,85%	8,33%	0,21%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-0,18%	6,10%	-3,30%	12,88%	26,04%	39,95%	6,98%	0,19%

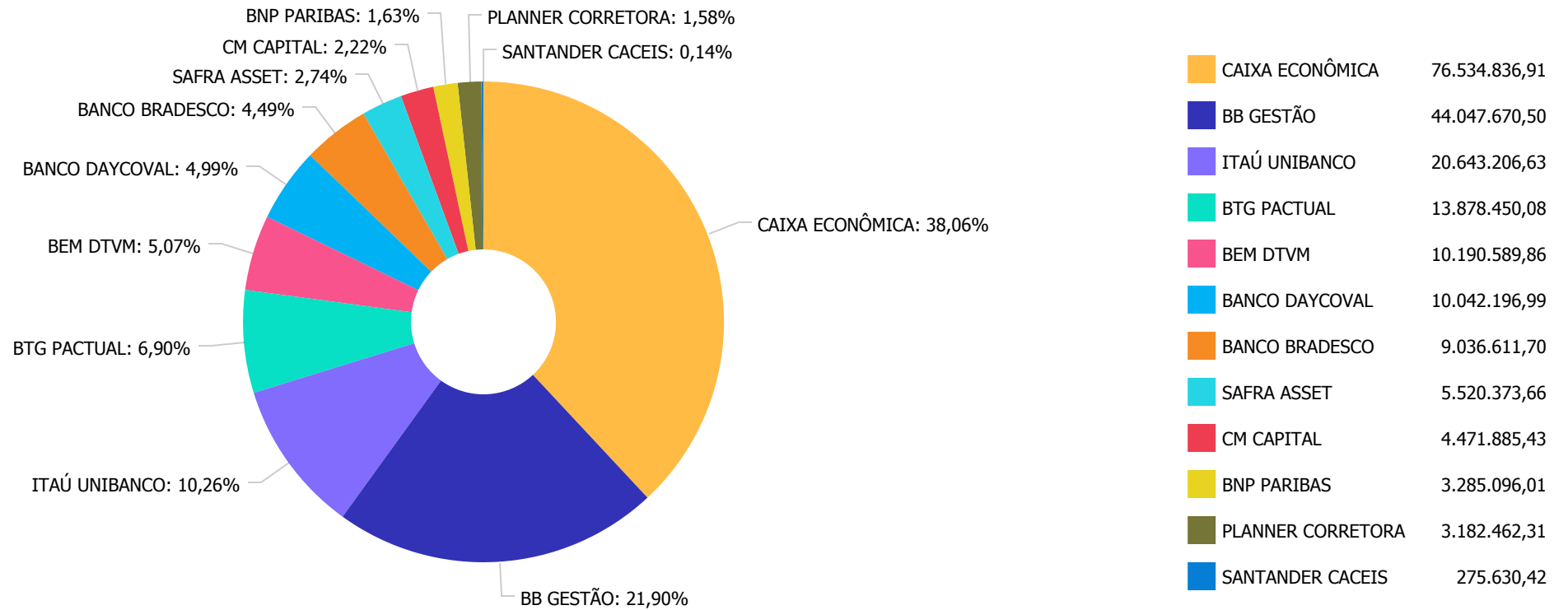
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3,32%	22,73%	8,84%	19,84%	30,12%	53,55%	3,83%	0,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-1,36%	1,34%	-1,89%	2,01%	4,67%	10,50%	1,74%	0,04%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	-0,35%	0,66%	0,22%	0,78%	0,52%	6,12%	0,81%	0,01%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,60%	4,21%	-5,70%	13,49%	27,17%	24,70%	8,44%	0,20%

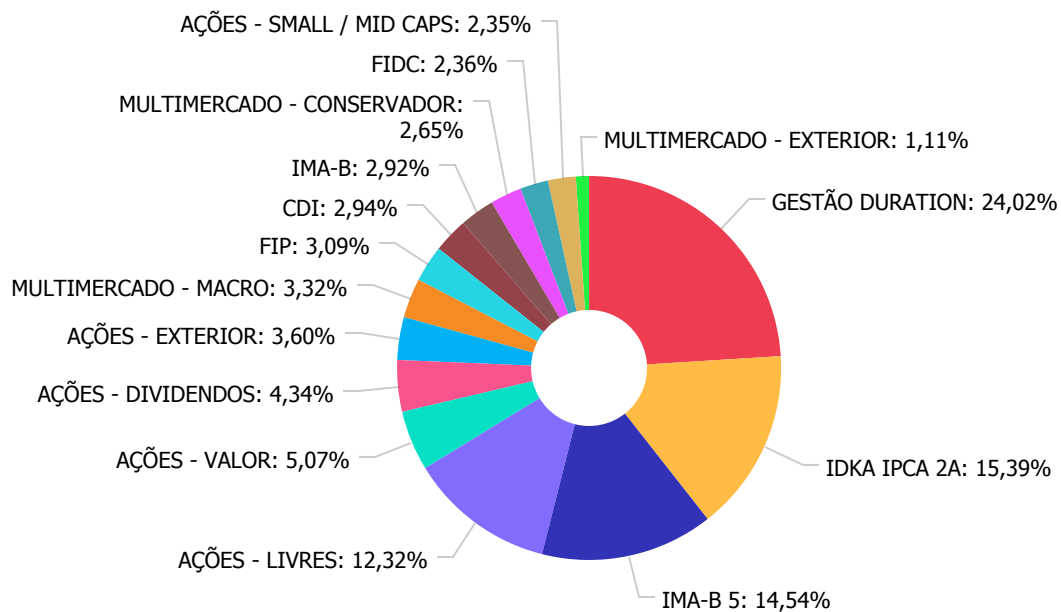
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	2,78%	15,58%	3,77%	7,14%	20,26%	82,56%	-	-
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,14%	17,85%	4,55%	7,00%	22,74%	88,65%	5,57%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	-2,48%	-0,20%	-5,89%	7,95%	19,54%	17,45%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,54%	12,52%	2,37%	6,03%	17,11%	57,09%	7,38%	0,13%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,24%	20,01%	8,37%	10,72%	18,52%	82,12%	6,36%	0,10%
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2,23%	12,75%	3,80%	8,19%	20,27%	52,48%	2,91%	0,11%

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



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

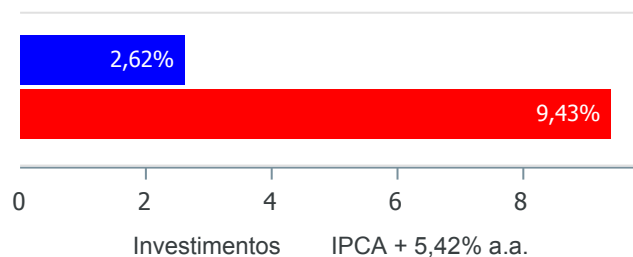


GESTÃO DURATION	48.298.868,91
IDKA IPCA 2A	30.950.275,73
IMA-B 5	29.237.394,83
AÇÕES - LIVRES	24.774.180,98
AÇÕES - VALOR	10.192.161,73
AÇÕES - DIVIDENDOS	8.718.411,96
AÇÕES - EXTERIOR	7.245.005,03
MULTIMERCADO - MACRO	6.681.777,64
FIP	6.209.649,54
CDI	5.913.704,86
IMA-B	5.874.036,82
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.322.326,33
FIDC	4.747.515,85
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.719.870,66
MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.223.829,63

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	188.473.692,48	5.654.725,25	5.789.001,22	187.393.812,64	-945.603,87	-945.603,87	-0,50%	-0,50%	0,67%	0,67%	-74,79%	3,86%
Fevereiro	187.393.812,64	3.546.838,03	2.619.901,54	187.163.096,06	-1.157.653,07	-2.103.256,94	-0,61%	-1,11%	1,24%	1,92%	-57,98%	3,44%
Março	187.163.096,06	7.392.439,30	6.082.509,67	191.421.943,55	2.948.917,86	845.660,92	1,56%	0,43%	1,42%	3,36%	12,89%	3,93%
Abril	191.421.943,55	14.142.147,15	12.890.911,44	195.891.212,90	3.218.033,64	4.063.694,56	1,67%	2,11%	0,73%	4,12%	51,24%	2,45%
Mai	195.891.212,90	16.479.543,24	15.291.892,62	200.351.809,71	3.272.946,19	7.336.640,75	1,66%	3,81%	1,27%	5,45%	69,89%	2,89%
Junho	200.351.809,71	10.648.648,62	9.486.400,04	202.198.814,52	684.756,23	8.021.396,98	0,34%	4,16%	0,97%	6,47%	64,26%	2,55%
Julho	202.198.814,52	4.011.951,28	2.655.325,43	202.082.129,08	-1.473.311,29	6.548.085,69	-0,72%	3,41%	1,43%	7,99%	42,62%	3,03%
Agosto	202.082.129,08	9.715.610,85	9.157.920,82	201.109.010,50	-1.530.808,61	5.017.277,08	-0,76%	2,62%	1,34%	9,43%	27,82%	3,73%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



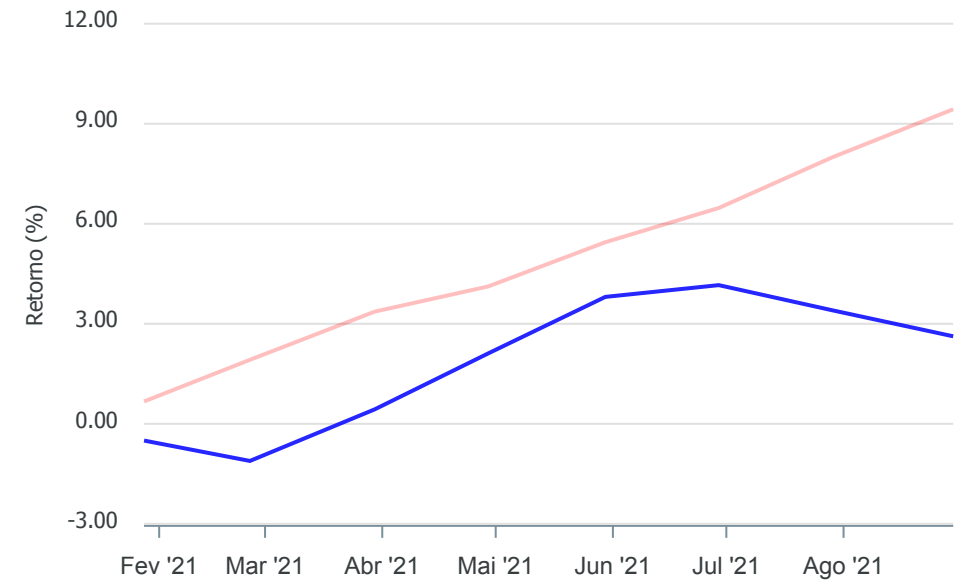
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.271.208,60	0,00	0,00	5.308.178,32	36.969,72	0,70%	0,70%	0,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.330.053,79	0,00	0,00	11.364.782,71	34.728,92	0,31%	0,31%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.257.805,65	0,00	84.951,07	3.182.099,45	9.244,87	0,28%	0,30%	0,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	25.601.034,52	1.725.121,46	500.000,00	26.878.425,68	52.269,70	0,19%	0,19%	1,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.064.596,05	0,00	0,00	4.071.850,05	7.254,00	0,18%	0,18%	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.882.254,66	1.873.305,92	2.039.314,41	7.726.378,66	10.132,49	0,10%	0,13%	1,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	18.309.948,55	0,00	0,00	18.328.916,72	18.968,17	0,10%	0,10%	1,31%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	228.836,06	1.105.946,95	1.011.134,28	324.578,67	929,94	0,07%	0,30%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	790.713,92	2.011.236,52	2.522.521,06	280.947,87	1.518,49	0,05%	0,32%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.472.699,87	0,00	0,00	4.471.885,43	-814,44	-0,02%	-9,84%	15,58%
BBIF MASTER FIDC LP	276.607,38	0,00	0,00	275.630,42	-976,96	-0,35%	-0,35%	0,03%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.082.360,98	0,00	0,00	9.036.611,70	-45.749,28	-0,50%	-0,50%	1,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.792.463,96	0,00	0,00	4.738.310,69	-54.153,27	-1,13%	-1,13%	3,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	28.307.820,06	0,00	0,00	27.897.474,50	-410.345,56	-1,45%	-1,45%	1,87%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.199.646,19	0,00	3.000.000,00	1.135.726,13	-63.920,06	-1,52%	-1,59%	3,68%
Total Renda Fixa	127.868.050,24	6.715.610,85	9.157.920,82	125.021.797,00	-403.943,27	-0,32%		1,90%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	4.846.145,50	0,00	0,00	5.019.559,46	173.413,96	3,58%	3,58%	10,79%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2.152.291,11	0,00	0,00	2.223.829,63	71.538,52	3,32%	3,32%	3,83%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.669.678,74	0,00	0,00	4.719.870,66	50.191,92	1,07%	1,07%	11,72%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	3.186.997,91	0,00	0,00	3.182.462,31	-4.535,60	-0,14%	-	-
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.067.981,43	0,00	0,00	3.062.372,42	-5.609,01	-0,18%	-0,18%	6,98%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.033.086,66	0,00	0,00	3.027.187,23	-5.899,43	-0,19%	-	-
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.340.811,59	0,00	0,00	5.322.326,33	-18.485,26	-0,35%	-0,35%	0,81%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	2.748.754,78	1.000.000,00	0,00	3.698.852,50	-49.902,28	-1,33%	-1,60%	8,44%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.774.185,51	0,00	0,00	6.681.777,64	-92.407,87	-1,36%	-1,36%	1,74%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.144.058,08	0,00	0,00	3.087.143,98	-56.914,10	-1,81%	-1,81%	7,17%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.571.583,24	0,00	0,00	2.518.632,19	-52.951,05	-2,06%	-2,06%	7,26%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.050.617,32	0,00	0,00	2.983.344,72	-67.272,60	-2,21%	-2,21%	7,73%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.162.412,72	0,00	0,00	4.042.645,33	-119.767,39	-2,88%	-2,88%	8,78%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.313.015,43	0,00	0,00	4.174.674,28	-138.341,15	-3,21%	-3,21%	8,33%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.419.196,06	0,00	0,00	3.285.096,01	-134.100,05	-3,92%	-3,92%	8,20%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.080.714,39	0,00	0,00	2.953.543,16	-127.171,23	-4,13%	-4,13%	8,04%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.507.441,55	0,00	0,00	8.858.890,62	-648.550,93	-6,82%	-6,82%	9,38%
Total Renda Variável	69.068.972,02	1.000.000,00	0,00	68.842.208,47	-1.226.763,55	-1,75%		7,25%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.113.416,35	0,00	0,00	2.160.817,90	47.401,55	2,24%	2,24%	6,36%
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	3.031.690,47	0,00	0,00	3.099.315,10	67.624,63	2,23%	2,23%	2,91%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	1.000.000,00	0,00	997.971,15	-2.028,85	-0,20%	-1,54%	7,38%
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	0,00	1.000.000,00	0,00	986.900,88	-13.099,12	-1,31%	2,14%	5,57%
Total Exterior	5.145.106,82	2.000.000,00	0,00	7.245.005,03	99.898,21	1,40%		4,92%

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.