

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2021)

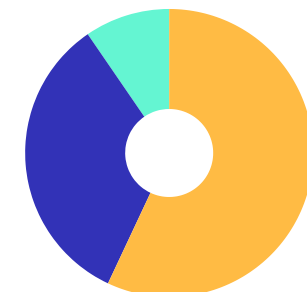
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			4.539.430,90	7,18%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	296.052,89	0,47%	653	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	919.949,34	1,45%	167	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.635.134,04	16,82%	976	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	843.310,35	1,33%	305	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.186.522,24	1,88%	872	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	949.157,57	1,50%	1.278	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.066.717,94	1,69%	296	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	416.462,42	0,66%	584	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.777.686,30	10,72%	195	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	51.149,01	0,08%	419	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.389.282,39	8,52%	49	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	28.191,29	0,04%	500	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.375.540,74	3,76%	249	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	552.146,17	0,87%	98	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	1.379,61	0,00%	467	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.665.254,77	2,63%	2.596	0,13%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
BRABESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	2.255.428,51	3,57%	53	0,66%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
BRABESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.001.348,77	3,17%	178	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.203.716,96	1,90%	5.899	0,04%	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 AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.633.151,39	5,75%	2.319	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.764.521,21	2,79%	4.569	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.203.966,24	1,90%	5.392	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	781.189,05	1,24%	36.178	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	904.294,82	1,43%	18	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	495.377,76	0,78%	111	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	243.900,70	0,39%	7.609	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	428.440,24	0,68%	16.766	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	3.778.351,87	5,98%	18.650	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	789.503,91	1,25%	7	1,75%	Artigo 8º, Inciso III
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI ...	D+5 du	Não há	1.123.309,70	1,78%	89	0,53%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	1.099.580,89	1,74%	16.491	0,07%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	1.277.853,31	2,02%	269	0,49%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.250.873,03	1,98%	478	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	1.298.776,31	2,05%	4.959	0,56%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		972.100,29	1,54%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			63.226.952,64				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			972.100,29	Artigo 6º			
PL Total			64.199.052,93				

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

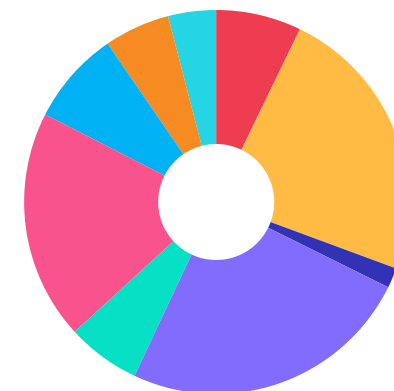
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	4.539.430,90	7,18%	0,00%	10,00%	100,00%	58.687.521,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	14.830.126,43	23,46%	40,00%	27,00%	100,00%	48.396.826,21
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	63.226.952,64
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.161.347,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	1.066.717,94	1,69%	0,00%	2,00%	60,00%	36.869.453,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	37.936.171,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	15.591.837,93	24,66%	0,00%	10,00%	40,00%	9.698.943,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	25.290.781,06
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	12.645.390,53
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	9.484.042,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	9.484.042,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.161.347,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.161.347,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.161.347,63
Total Renda Fixa	100,00%	36.028.113,20	56,98%	40,00%	57,00%	570,00%	



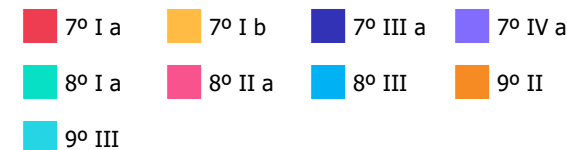
■ RENDA FIXA 36.028.113,20
■ RENDA VARIÁVEL 21.148.446,20
■ EXTERIOR 6.050.393,24

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	3.920.683,28	6,20%	0,00%	6,00%	30,00%	15.047.402,51
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	18.968.085,79
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	12.231.466,90	19,35%	0,00%	20,00%	20,00%	413.923,63
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	12.645.390,53
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.996.296,02	7,90%	0,00%	2,00%	10,00%	1.326.399,24
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.161.347,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.161.347,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.161.347,63
Total Renda Variável	30,00%	21.148.446,20	33,45%	0,00%	33,00%	125,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.322.695,26
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.500.743,90	5,54%	0,00%	5,00%	10,00%	2.821.951,36
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.549.649,34	4,03%	0,00%	5,00%	10,00%	3.773.045,92
Total Exterior	10,00%	6.050.393,24	9,57%	0,00%	10,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.564.371,17	40,43	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	16.474.894,98	26,06	0,00
ITAÚ UNIBANCO	5.740.387,77	9,08	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	4.539.430,90	7,18	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.377.770,08	3,76	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.277.853,31	2,02	0,02
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	1.203.966,24	1,90	0,07
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	1.203.716,96	1,90	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	1.123.309,70	1,78	0,00
XP ASSET MANAGEMENT	1.099.580,89	1,74	0,01
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	919.949,34	1,45	0,01
ITAÚ DTVM	904.294,82	1,43	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	553.525,78	0,88	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	243.900,70	0,39	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 '	4.539.430,90	7,18	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	14.830.126,43	23,46	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.066.717,94	1,69	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	15.591.837,93	24,66	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
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 '	3.920.683,28	6,20	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	12.231.466,90	19,35	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	4.996.296,02	7,90	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	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, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	3.500.743,90	5,54	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	2.549.649,34	4,03	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
IMA Geral (Benchmark)	-0,41%	-0,37%	-0,16%	0,57%	1,87%	8,50%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	-0,68%	-1,02%	-0,63%	-0,03%	1,47%	8,35%	1,70%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,22%	-5,44%	-2,16%	-1,52%	1,80%	6,60%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,36%	-5,68%	-2,36%	-1,74%	1,53%	5,86%	5,58%	0,10%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,37%	1,37%	0,77%	1,29%	2,24%	7,41%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	1,21%	0,70%	1,17%	2,00%	6,95%	0,15%	0,00%
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%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,97%	-1,93%	-0,92%	0,28%	2,81%	8,99%	3,05%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,14%	-2,35%	-1,14%	0,05%	3,01%	9,40%	3,40%	0,06%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,12%	-2,32%	-1,08%	0,10%	3,01%	9,46%	3,43%	0,06%
Selic (Benchmark)	0,41%	2,05%	1,08%	1,76%	2,69%	6,66%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,42%	1,96%	1,11%	1,72%	2,37%	6,12%	0,01%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40%	1,95%	1,10%	1,67%	2,24%	6,23%	0,02%	0,01%

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
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,48%	2,38%	1,20%	2,08%	3,07%	6,17%	0,06%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,87%	5,67%	2,38%	4,51%	9,68%	12,35%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,46%	-0,96%	-0,52%	0,44%	1,76%	-	1,34%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,50%	-1,50%	-0,37%	0,04%	0,46%	6,52%	1,57%	0,03%
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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,23%	1,33%	0,81%	1,41%	1,86%	8,41%	0,36%	0,01%

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
IDIV (Benchmark)	-0,50%	-0,20%	-4,33%	10,92%	19,40%	15,05%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,39%	-3,04%	-6,66%	10,16%	16,43%	7,99%	8,02%	0,24%

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%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,27%	-1,70%	-5,09%	4,18%	15,34%	3,86%	8,05%	0,16%
BRDESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-2,51%	-0,42%	-5,98%	7,76%	19,18%	16,75%	8,14%	0,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-3,74%	-2,89%	-7,76%	1,95%	10,89%	20,06%	8,82%	0,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-2,21%	6,37%	-5,41%	7,44%	21,25%	18,06%	7,73%	0,17%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,21%	3,70%	-7,45%	10,80%	17,43%	16,85%	8,33%	0,21%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-3,82%	-1,85%	-5,72%	5,13%	5,96%	-0,78%	8,08%	0,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,10%	4,76%	-3,34%	12,74%	13,56%	-5,94%	10,10%	0,22%

CDI (Benchmark)	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-1,36%	1,34%	-1,89%	2,01%	4,67%	10,50%	1,74%	0,04%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,24%	0,61%	0,04%	0,88%	1,98%	0,13%	0,54%	0,01%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,78%	-0,21%	-5,92%	5,36%	12,20%	19,12%	8,49%	0,19%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,34%	23,18%	8,93%	20,01%	30,11%	52,19%	3,86%	0,14%

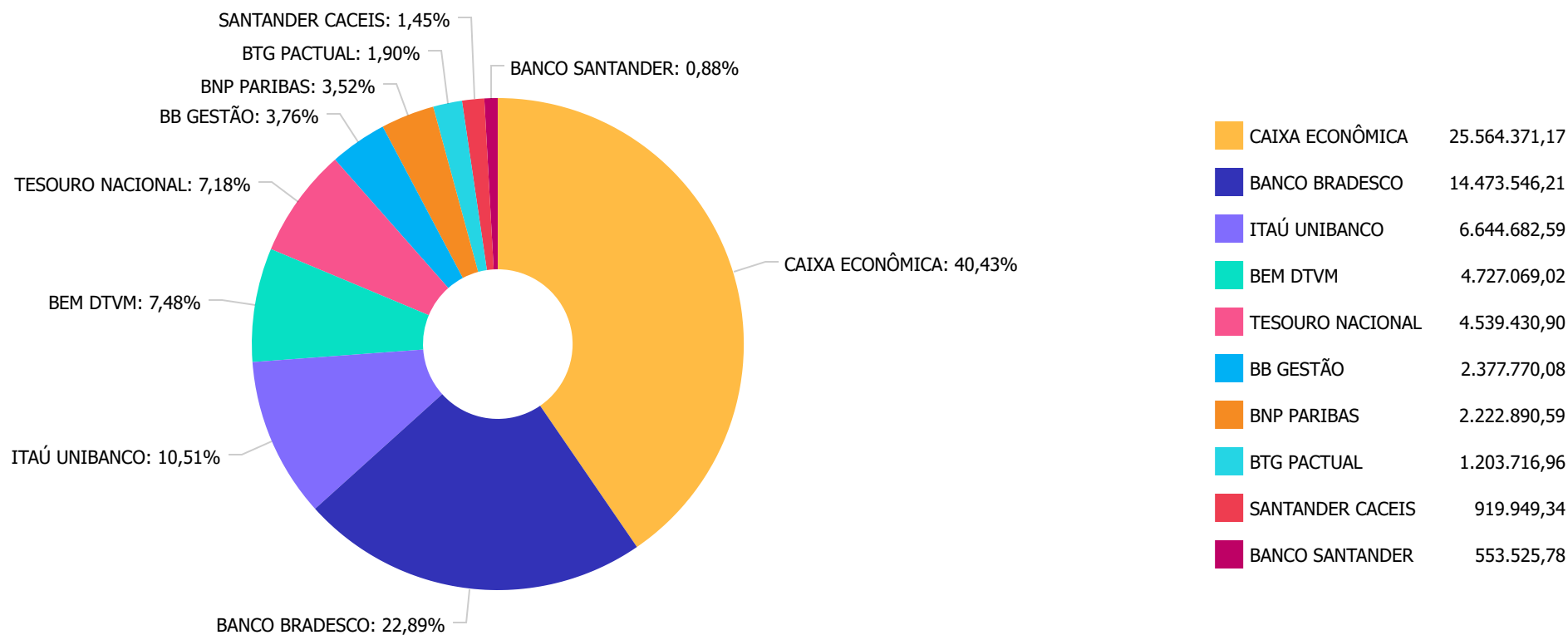
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-3,15%	1,35%	-6,39%	7,82%	19,72%	19,25%	8,14%	0,22%

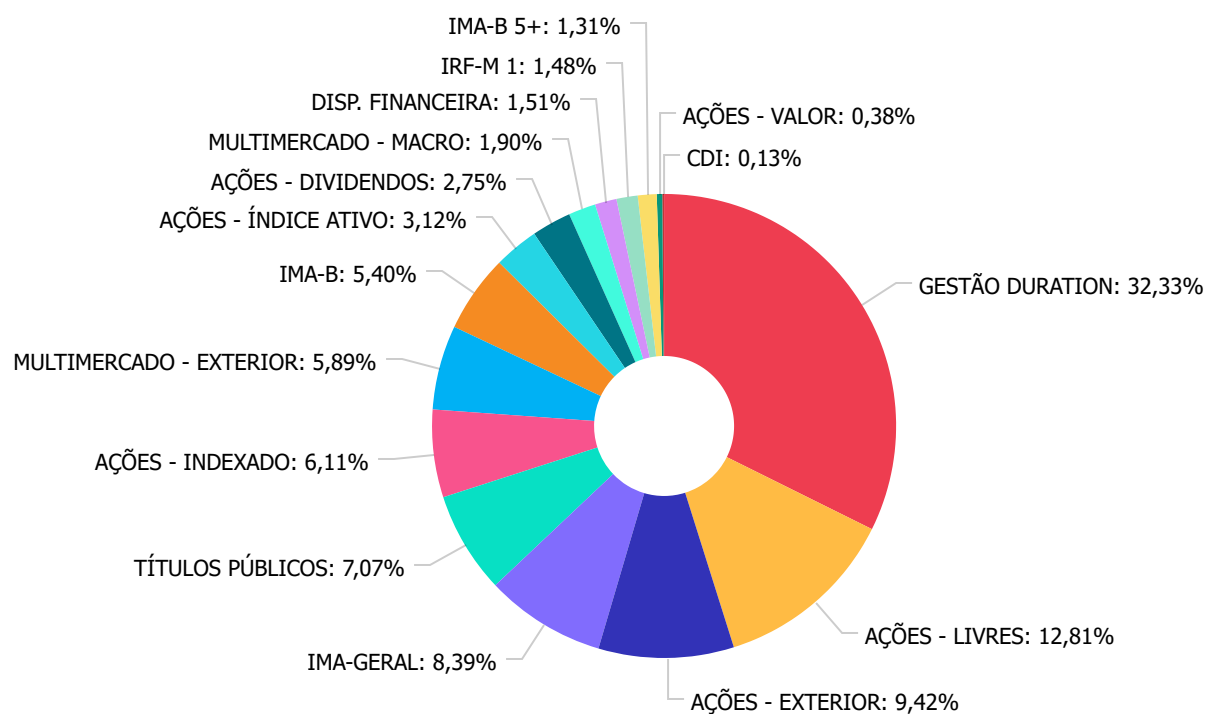
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-0,28%	13,85%	3,14%	7,21%	15,60%	53,52%	6,18%	0,11%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,44%	17,02%	6,70%	6,83%	16,19%	96,21%	6,20%	0,11%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÃO...	1,45%	4,89%	1,45%	-3,69%	10,96%	-	6,35%	0,10%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,75%	17,96%	2,13%	4,05%	18,37%	73,15%	6,26%	0,14%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	2,02%	18,59%	4,45%	5,94%	27,00%	-	5,85%	0,11%

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



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



GESTÃO DURATION	20.756.969,67
AÇÕES - LIVRES	8.221.696,22
AÇÕES - EXTERIOR	6.050.393,24
IMA-GERAL	5.389.282,39
TÍTULOS PÚBLICOS	4.539.430,90
AÇÕES - INDEXADO	3.920.683,28
MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.778.351,87
IMA-B	3.469.242,41
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.001.348,77
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.764.521,21
MULTIMERCADO - MACRO	1.217.944,15
DISP. FINANCEIRA	972.100,29
IRF-M 1	949.157,57
IMA-B 5+	843.310,35
AÇÕES - VALOR	243.900,70
CDI	80.719,91

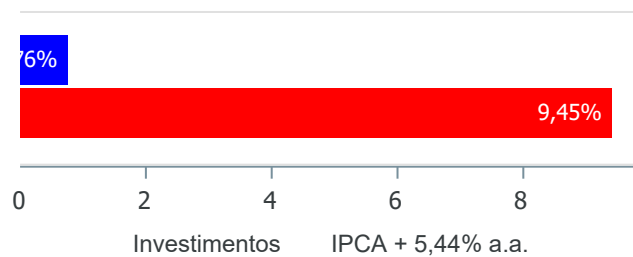
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	10/09/2021	20	4.180,254864	4.177,795727	83.605,10	83.555,91	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	49	4.207,948227	4.173,512862	206.189,46	204.502,13	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	26/03/2020	146	4.019,240685	4.433,055224	586.809,14	647.226,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	72	4.335,641566	4.286,652189	312.166,19	308.638,96	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/09/2021	351	4.270,102744	4.286,652189	1.498.806,06	1.504.614,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	31/03/2020	71	4.148,947183	4.522,886785	294.575,25	321.124,96	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	02/04/2020	146	4.067,803630	4.436,320773	593.899,33	647.702,83	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/04/2020	123	4.013,130081	4.377,826897	493.615,00	538.472,71	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	08/04/2020	122	4.043,872787	4.410,181899	493.352,48	538.042,19	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	09/04/2020	124	3.983,552016	4.345,826689	493.960,45	538.882,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/05/2020	147	4.023,229864	4.403,683384	591.414,79	647.341,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	29/03/2019	122	4.047,992459	4.563,684426	493.855,08	556.769,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	23/11/2020	3	4.290,810000	4.605,032359	12.872,43	13.815,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	10/03/2021	19	4.557,733157	4.739,662040	86.596,93	90.053,58	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	10/09/2021	69	4.336,997338	4.290,163921	299.252,82	296.021,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	10/09/2021	134	4.425,584114	4.377,323670	593.028,27	586.561,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	01/09/2021	359	4.431,775081	4.377,323670	1.591.007,25	1.571.459,20	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	58.857.947,29	0,00	380,00	58.621.089,51	-236.477,78	-236.477,78	-0,40%	-0,40%	0,67%	0,67%	-59,76%	5,22%
Fevereiro	58.621.089,51	293.649,50	0,00	58.360.103,75	-554.635,26	-791.113,04	-0,94%	-1,34%	1,24%	1,92%	-69,65%	4,59%
Março	58.360.103,75	1.491.538,18	848.276,76	59.724.148,40	720.783,23	-70.329,81	1,22%	-0,13%	1,42%	3,37%	-3,98%	5,42%
Abril	59.724.148,40	1.420.973,02	681.057,90	61.282.254,57	818.191,05	747.861,24	1,35%	1,22%	0,73%	4,13%	29,49%	3,27%
Maio	61.282.254,57	1.165.145,03	328.059,99	63.051.834,35	932.494,74	1.680.355,98	1,50%	2,74%	1,28%	5,46%	50,16%	3,69%
Junho	63.051.834,35	669.957,38	370.666,43	63.426.679,28	75.553,98	1.755.909,96	0,12%	2,86%	0,97%	6,48%	44,10%	2,81%
Julho	63.426.679,28	1.624.189,11	1.338.960,00	63.172.742,38	-539.166,01	1.216.743,95	-0,85%	1,99%	1,43%	8,00%	24,85%	4,02%
Agosto	63.172.742,38	4.311.576,20	3.484.754,62	63.226.952,64	-772.611,32	444.132,63	-1,21%	0,76%	1,34%	9,45%	8,02%	4,21%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



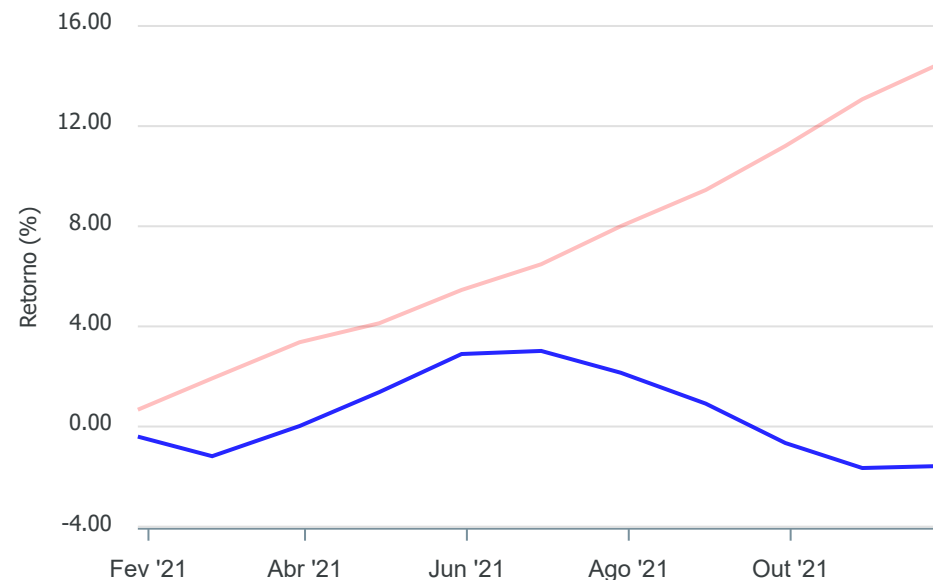
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.078,28	0,00	0,00	28.191,29	113,01	0,40%	0,40%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	945.905,58	0,00	0,00	949.157,57	3.251,99	0,34%	0,34%	0,15%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	1.302,70	483.224,33	484.754,62	1.379,61	1.607,20	0,33%	0,48%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.368.281,47	0,00	0,00	2.375.540,74	7.259,27	0,31%	0,31%	0,80%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	1.005,26	50.000,00	0,00	51.149,01	143,75	0,28%	0,42%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	550.892,92	0,00	0,00	552.146,17	1.253,25	0,23%	0,23%	0,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	418.365,46	0,00	0,00	416.462,42	-1.903,04	-0,45%	-0,45%	1,34%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	6.811.999,40	0,00	0,00	6.777.686,30	-34.313,10	-0,50%	-0,50%	1,57%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	5.426.210,34	0,00	0,00	5.389.282,39	-36.927,95	-0,68%	-0,68%	1,70%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.576.919,28	0,00	0,00	4.539.430,90	-37.488,38	-0,82%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	928.952,94	0,00	0,00	919.949,34	-9.003,60	-0,97%	-0,97%	3,05%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.078.827,76	0,00	0,00	1.066.717,94	-12.109,82	-1,12%	-1,12%	3,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	299.436,43	0,00	0,00	296.052,89	-3.383,54	-1,13%	-1,13%	3,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.200.169,66	0,00	0,00	1.186.522,24	-13.647,42	-1,14%	-1,14%	3,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	13.839.065,45	0,00	3.000.000,00	10.635.134,04	-203.931,41	-1,47%	-1,45%	1,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	863.663,65	0,00	0,00	843.310,35	-20.353,30	-2,36%	-2,36%	5,58%
Total Renda Fixa	39.339.076,58	533.224,33	3.484.754,62	36.028.113,20	-359.433,09	-0,91%		1,86%

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
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	787.592,27	0,00	0,00	789.503,91	1.911,64	0,24%	0,24%	0,54%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	3.778.351,87	0,00	3.778.351,87	0,00	0,00%	3,34%	3,86%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	434.365,50	0,00	0,00	428.440,24	-5.925,26	-1,36%	-1,36%	1,74%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.789.307,55	0,00	0,00	1.764.521,21	-24.786,34	-1,39%	-1,39%	8,02%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	798.804,38	0,00	0,00	781.189,05	-17.615,33	-2,21%	-2,21%	7,73%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.047.780,28	0,00	0,00	2.001.348,77	-46.431,51	-2,27%	-2,27%	8,05%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	2.313.399,69	0,00	0,00	2.255.428,51	-57.971,18	-2,51%	-2,51%	8,14%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.737.120,36	0,00	0,00	3.633.151,39	-103.968,97	-2,78%	-1,74%	8,49%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.719.451,97	0,00	0,00	1.665.254,77	-54.197,20	-3,15%	-3,15%	8,14%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.243.863,50	0,00	0,00	1.203.966,24	-39.897,26	-3,21%	-3,21%	8,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	939.453,04	0,00	0,00	904.294,82	-35.158,22	-3,74%	-3,74%	8,82%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	253.592,38	0,00	0,00	243.900,70	-9.691,68	-3,82%	-3,82%	8,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	516.554,32	0,00	0,00	495.377,76	-21.176,56	-4,10%	-4,10%	10,10%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.291.839,93	0,00	0,00	1.203.716,96	-88.122,97	-6,82%	-6,82%	9,38%
Total Renda Variável	17.873.125,17	3.778.351,87	0,00	21.148.446,20	-503.030,84	-2,32%		7,14%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.221.133,56	0,00	0,00	1.250.873,03	29.739,47	2,44%	2,44%	6,20%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	1.252.570,27	0,00	0,00	1.277.853,31	25.283,04	2,02%	2,02%	5,85%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.276.436,26	0,00	0,00	1.298.776,31	22.340,05	1,75%	1,75%	6,26%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	1.083.909,25	0,00	0,00	1.099.580,89	15.671,64	1,45%	1,45%	6,35%
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	1.126.491,29	0,00	0,00	1.123.309,70	-3.181,59	-0,28%	-0,28%	6,18%
Total Exterior	5.960.540,63	0,00	0,00	6.050.393,24	89.852,61	1,51%		6,16%

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.