

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2021

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

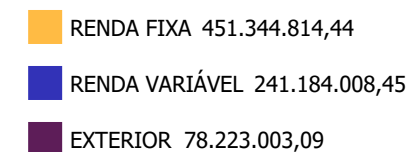
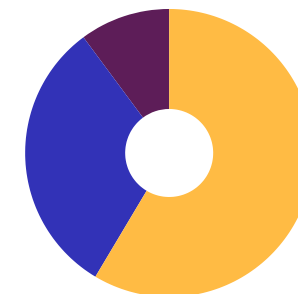
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	25.038.024,94	3,25%	1.007	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	14.107.238,42	1,83%	763	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	106.858.250,52	13,86%	653	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.724.658,92	0,48%	1.156	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	5.220.048,58	0,68%	92	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	47.220.621,87	6,13%	976	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	27.497.224,25	3,57%	305	1,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.014.636,51	0,52%	1.278	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.573.728,05	1,50%	9.379	4,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	27.655.392,03	3,59%	9.746	2,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.742.484,36	2,04%	43	8,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	106.284.965,97	13,79%	116	7,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	D+1	Não há	24.712.702,52	3,21%	3.406	7,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	21.526.527,60	2,79%	246	4,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	183.021,72	0,02%		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%		100,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.985.288,17	1,30%	74	1,58%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	17.406.259,76	2,26%	111	1,49%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	9.522.917,97	1,24%	40	1,64%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	20.342.070,90	2,64%	8.633	3,25%	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
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.073.509,52	0,53%	17.223	1,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.912.858,33	0,90%	5.846	1,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	31.495.138,46	4,09%	27.324	2,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	28.881.006,55	3,75%	58.072	1,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	23.229.701,19	3,01%	11.109	5,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	16.854.849,10	2,19%	11.994	1,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	29.456.299,80	3,82%	6.545	2,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	14.296.515,74	1,85%	18.650	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	37.396.427,75	4,85%	57.014	1,56%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	214.358,16	0,03%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	6.691,82	0,00%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	629.036,43	0,08%		1,66%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	466.366,97	0,06%		1,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	19.442.650,39	2,52%	16.491	1,21%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	23.009.679,99	2,99%	13.112	1,17%	Artigo 9º - A, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	7.550.724,63	0,98%	269	2,91%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	28.219.948,08	3,66%	142.980	0,74%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>770.751.825,98</b>				

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

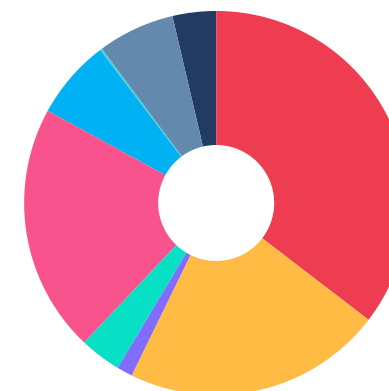
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	770.751.825,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	272.909.824,09	35,41%	5,00%	32,50%	100,00%	497.842.001,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	770.751.825,98
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.537.591,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	462.451.095,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	462.451.095,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	168.266.680,45	21,83%	0,00%	21,10%	45,00%	178.571.641,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	308.300.730,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	154.150.365,20
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	115.612.773,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	115.612.773,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	183.021,73	0,02%	0,00%	0,03%	5,00%	38.354.569,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	9.985.288,17	1,30%	0,00%	1,37%	5,00%	28.552.303,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.537.591,30
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>451.344.814,44</b>	<b>58,56%</b>	<b>5,00%</b>	<b>55,00%</b>	<b>575,00%</b>	



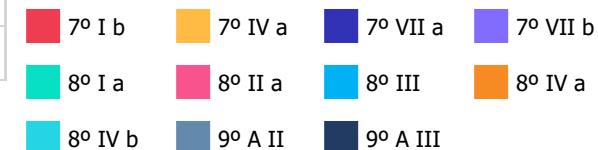
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	26.929.177,73	3,49%	0,00%	4,70%	35,00%	242.833.961,36
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	269.763.139,09
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	161.245.433,85	20,92%	2,00%	25,00%	25,00%	31.442.522,65
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	154.150.365,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	51.692.943,49	6,71%	0,00%	5,00%	10,00%	25.382.239,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	221.049,98	0,03%	0,00%	0,01%	5,00%	38.316.541,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.095.403,40	0,14%	0,00%	0,29%	5,00%	37.442.187,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	38.537.591,30
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>241.184.008,45</b>	<b>31,29%</b>	<b>2,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>140,00%</b>	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 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%	10,00%	77.075.182,60
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	50.003.055,01	6,49%	0,00%	6,50%	10,00%	27.072.127,59
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	28.219.948,08	3,66%	0,00%	3,50%	10,00%	48.855.234,52
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>78.223.003,09</b>	<b>10,15%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>30,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	236.296.022,41	30,66	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	150.519.808,42	19,53	0,02
WESTERN ASSET	139.510.997,98	18,10	0,28
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	122.027.450,33	15,83	0,01
ICATU VANGUARDA	41.030.027,85	5,32	0,09
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	32.532.597,96	4,22	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	20.342.070,90	2,64	0,07
XP ASSET MANAGEMENT	19.442.650,39	2,52	0,23
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	7.550.724,63	0,98	0,14
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.095.403,40	0,14	0,12
PLURAL	214.358,17	0,03	0,00
VILA RICA CAPITAL	183.021,72	0,02	0,18
PÁTRIA INVESTIMENTOS	6.691,82	0,00	0,00

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

**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 Agosto/2021 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,73%	4,43%	2,00%	3,59%	6,30%	14,26%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,08%	-11,63%	0,32%	-9,44%	18,07%	639,19%	-	-
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,37%	1,37%	0,77%	1,29%	2,24%	7,41%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	1,16%	0,68%	1,12%	1,83%	6,69%	0,15%	0,00%
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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,15%	1,47%	0,05%	1,97%	4,77%	14,45%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,47%	-2,10%	-1,17%	0,06%	1,41%	13,32%	1,85%	0,04%
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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-1,09%	-2,17%	-1,04%	0,19%	3,27%	10,12%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,16%	-2,94%	-1,16%	-0,22%	2,34%	9,19%	3,40%	0,06%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	-1,70%	-5,72%	-2,24%	-1,64%	0,04%	8,93%	4,02%	0,09%
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%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,60%	-2,63%	-0,86%	-0,67%	-1,25%	7,35%	-	-

**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
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-2,33%	-8,90%	-3,62%	-4,40%	-6,46%	3,86%	3,78%	0,07%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,43%	2,07%	1,10%	1,78%	2,72%	6,68%	-	-
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	-0,83%	-5,32%	-1,41%	-2,06%	-3,61%	6,66%	1,29%	0,05%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,87%	5,67%	2,38%	4,51%	9,68%	12,35%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,20%	0,78%	0,06%	1,78%	4,43%	13,30%	1,41%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,24%	1,75%	0,55%	2,36%	4,93%	14,07%	0,93%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-1,45%	-1,51%	-2,22%	-1,04%	-0,01%	9,20%	1,87%	0,03%
<b>Não Possui (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	900,00%	-	900,00%	900,00%	-	-	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-2,38%	-5,56%	-2,45%	-1,78%	1,53%	5,42%	5,69%	0,10%
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
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,75%	12,90%	5,05%	9,99%	21,15%	37,13%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,30%	145,81%	-3,89%	147,77%	136,75%	-92,64%	0,00%	0,03%
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	2,90%	20,41%	7,58%	18,67%	29,21%	54,54%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,35%	22,87%	8,86%	19,87%	30,38%	53,30%	3,85%	0,14%
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	-3,50%	1,23%	-6,61%	8,25%	22,12%	19,45%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-4,05%	1,30%	-7,12%	8,11%	20,43%	17,50%	8,28%	0,22%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-2,48%	-0,20%	-5,89%	7,95%	19,54%	17,45%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-5,26%	-3,07%	-9,58%	2,00%	6,19%	3,82%	8,13%	0,18%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,95%	-4,70%	-8,30%	3,11%	8,30%	-2,56%	7,66%	0,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,06%	0,75%	-5,54%	11,42%	22,72%	32,58%	7,26%	0,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,87%	4,86%	-7,43%	9,79%	19,41%	20,87%	8,64%	0,20%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-2,62%	-1,73%	-5,96%	6,87%	12,68%	6,56%	8,12%	0,20%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	-0,31%	-24,38%	-10,02%	-14,72%	-29,49%	-99,81%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-0,93%	-9,37%	-1,53%	-9,37%	-5,94%	65,99%	-	-
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 - RENDA VARIÁVEL**

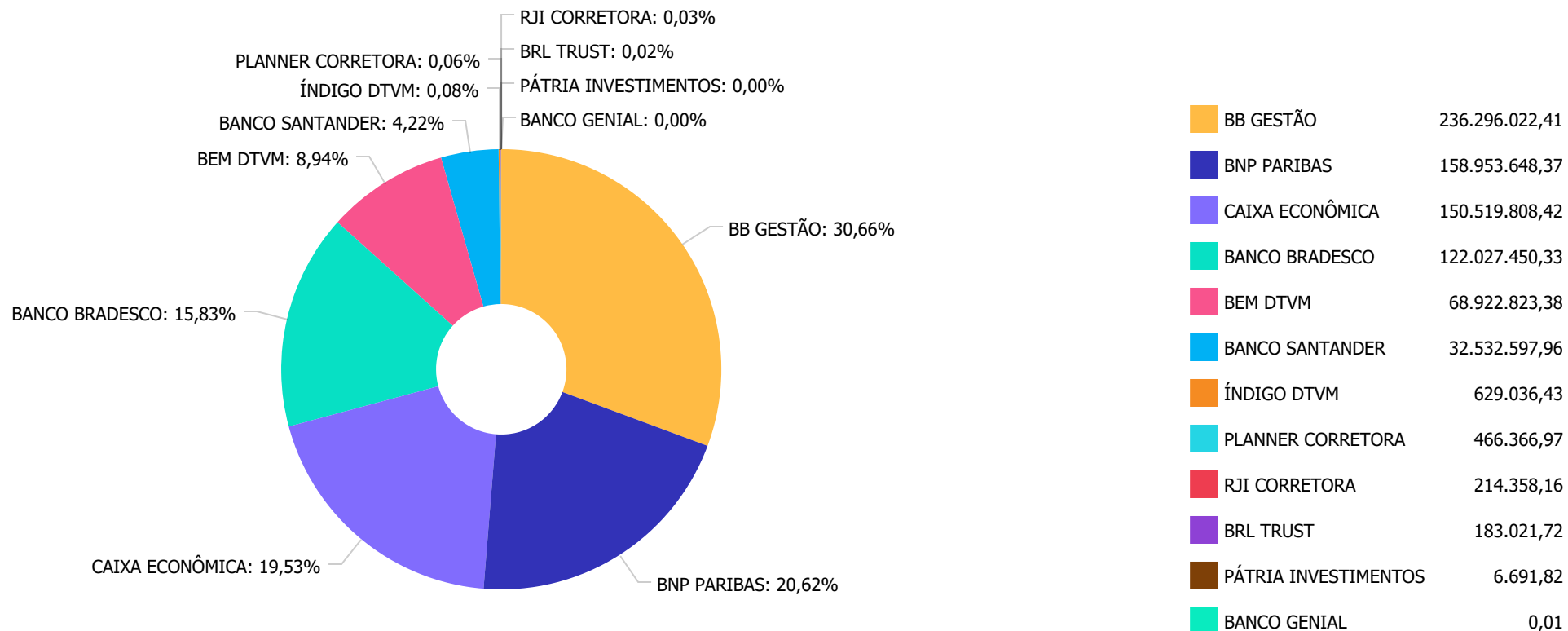
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3,34%	23,18%	8,93%	20,01%	30,11%	52,19%	3,86%	0,14%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-4,04%	-6,69%	-8,67%	-0,03%	-1,04%	4,48%	9,38%	0,16%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-1,27%	0,00%	0,14%	-3,74%	-18,08%	0,00%	0,30%

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-8,52%	-20,71%	-17,14%	-5,02%	-13,78%	-25,16%	14,46%	0,29%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-5,01%	0,30%	-9,02%	6,03%	14,68%	19,17%	10,99%	0,23%

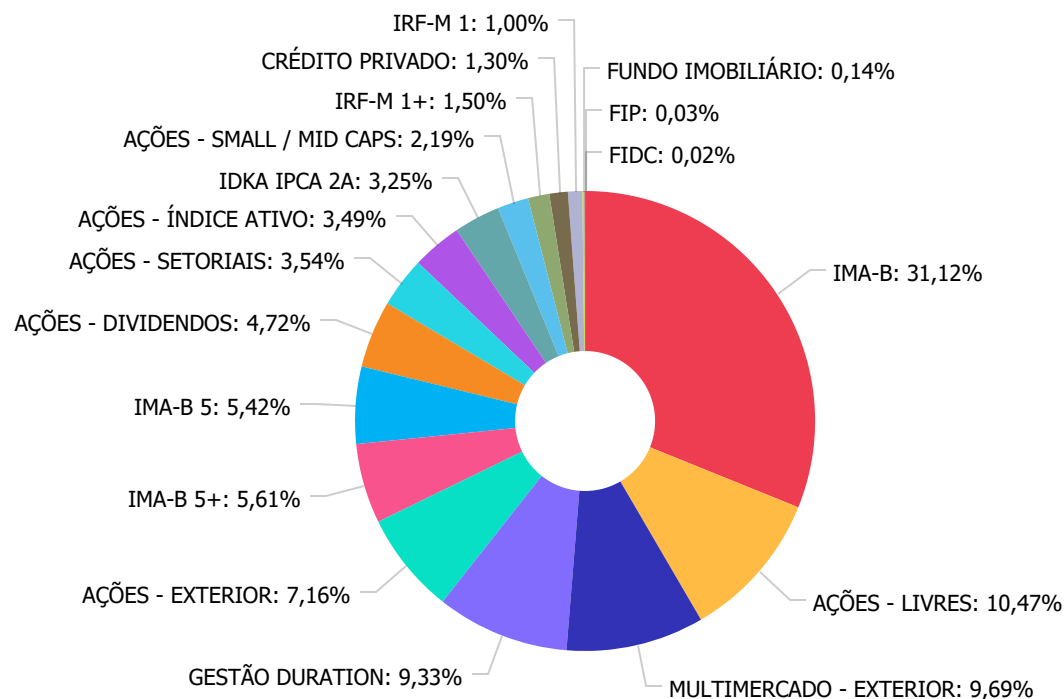
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	2,78%	15,58%	3,77%	7,14%	20,26%	82,56%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,31%	14,45%	3,57%	3,57%	19,91%	97,55%	5,88%	0,10%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	1,45%	4,89%	1,45%	-3,69%	10,96%	-	6,35%	0,10%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	2,02%	18,59%	4,45%	5,94%	27,00%	-	5,85%	0,11%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,59%	16,76%	8,57%	11,21%	15,64%	105,62%	6,25%	0,10%

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



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

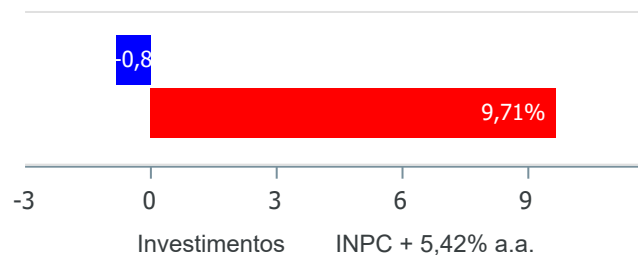


IMA-B	239.889.792,67
AÇÕES - LIVRES	80.718.215,91
MULTIMERCADO - EXTERIOR	74.702.623,48
GESTÃO DURATION	71.933.324,39
AÇÕES - EXTERIOR	55.213.323,10
IMA-B 5+	43.239.708,61
IMA-B 5	41.762.630,45
AÇÕES - DIVIDENDOS	36.369.158,13
AÇÕES - SETORIAIS	27.303.210,71
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	26.929.177,73
IDKA IPCA 2A	25.038.024,94
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	16.854.849,10
IRF-M 1+	11.573.728,05
CRÉDITO PRIVADO	9.985.288,17
IRF-M 1	7.739.295,43
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.095.403,40
FIP	221.049,98
FIDC	183.021,73

**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

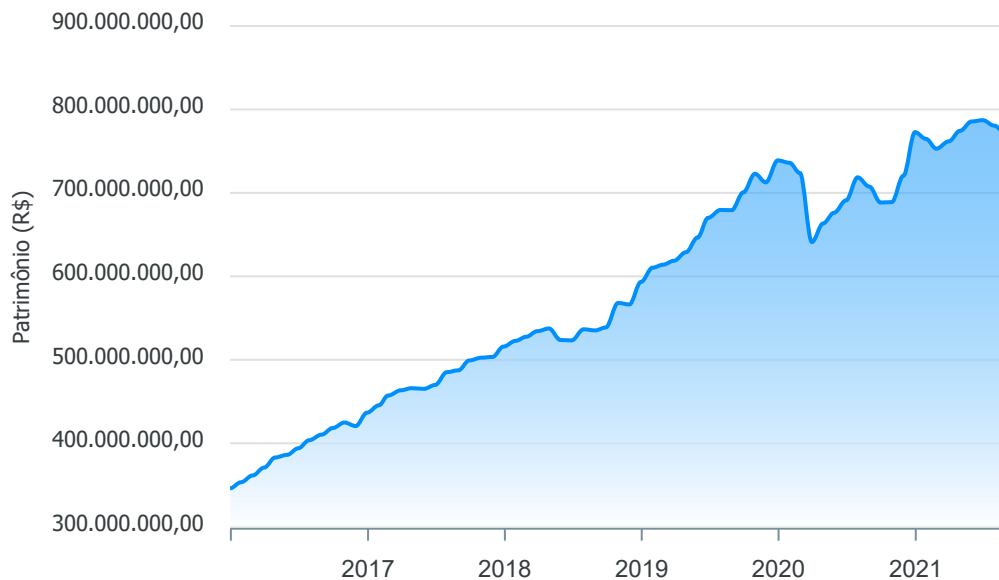
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	772.758.420,48	8.926.995,34	8.588.634,39	764.781.240,64	-8.315.540,79	-8.315.540,79	-1,08%	-1,08%	0,69%	0,69%	-155,68%	5,55%
Fevereiro	764.781.240,64	23.080.818,18	22.847.241,26	752.958.261,07	-12.056.556,49	-20.372.097,28	-1,58%	-2,63%	1,20%	1,90%	-138,66%	4,97%
Março	752.958.261,07	9.371.202,28	8.731.781,55	761.715.952,72	8.118.270,92	-12.253.826,36	1,08%	-1,59%	1,35%	3,27%	-48,45%	6,09%
Abril	761.715.952,72	9.067.020,12	8.348.613,52	774.328.204,36	11.893.845,04	-359.981,32	1,56%	-0,05%	0,80%	4,10%	-1,23%	3,93%
Mai	774.328.204,36	9.274.476,26	8.687.525,57	785.585.670,67	10.670.515,62	10.310.534,30	1,38%	1,33%	1,41%	5,56%	23,83%	4,26%
Junho	785.585.670,67	9.152.662,15	8.591.796,04	787.142.365,96	995.829,18	11.306.363,48	0,13%	1,45%	1,04%	6,66%	21,82%	3,53%
Julho	787.142.365,96	9.211.073,01	8.684.267,26	780.623.216,77	-7.045.954,94	4.260.408,54	-0,89%	0,55%	1,49%	8,25%	6,63%	4,45%
Agosto	780.623.216,77	43.708.535,02	42.955.176,75	770.751.825,98	-10.624.749,06	-6.364.340,52	-1,36%	-0,82%	1,35%	9,71%	-8,45%	4,71%

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**



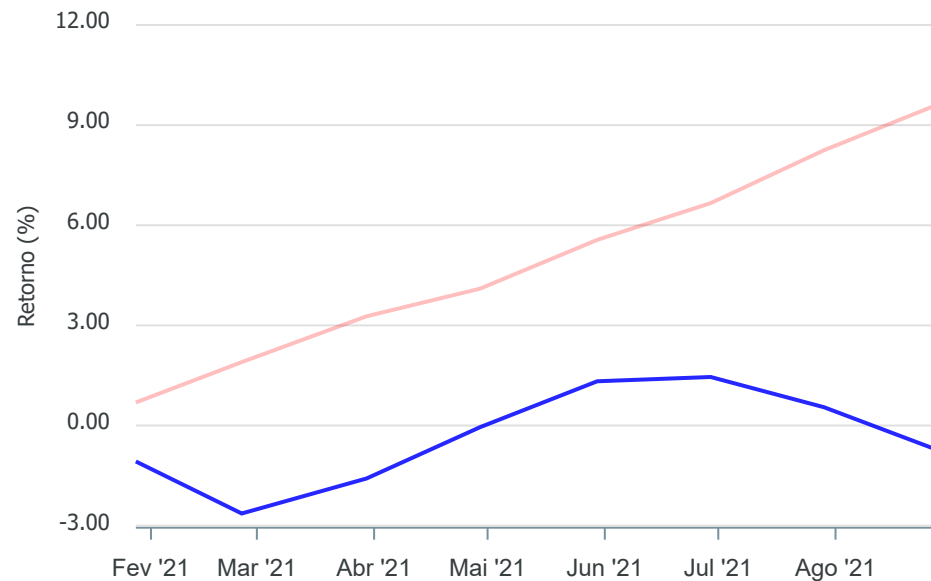
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	14.000.000,00	0,00	14.107.238,42	107.238,42	0,77%	0,10%	1,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.307.682,04	625.347,26	221.000,85	3.724.658,92	12.630,47	0,32%	0,33%	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.058.363,49	42.107,62	1.100.528,29	4.014.636,51	14.693,69	0,29%	0,34%	0,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.935.619,96	8.041.080,14	0,00	25.038.024,94	61.324,84	0,25%	0,18%	1,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.346.189,03	0,00	138.096,09	5.220.048,58	11.955,64	0,22%	0,24%	0,93%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.965.474,58	0,00	0,00	9.985.288,17	19.813,59	0,20%	0,20%	1,41%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	183.158,18	0,00	0,00	183.021,72	-136,46	-0,07%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	27.786.461,41	0,00	0,00	27.655.392,03	-131.069,38	-0,47%	-0,47%	1,85%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	24.919.875,39	0,00	0,00	24.712.702,52	-207.172,87	-0,83%	-0,83%	1,29%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	108.079.513,74	0,00	0,00	106.858.250,52	-1.221.263,22	-1,13%	-1,13%	3,42%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	107.535.719,25	0,00	0,00	106.284.965,97	-1.250.753,28	-1,16%	-1,16%	3,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	54.513.242,00	0,00	6.495.551,52	47.220.621,87	-797.068,61	-1,46%	-1,45%	1,87%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	21.899.295,24	0,00	0,00	21.526.527,60	-372.767,64	-1,70%	-1,70%	4,02%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	26.228.205,24	0,00	14.000.000,00	11.573.728,05	-654.477,19	-2,50%	-2,33%	3,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	42.666.137,26	0,00	14.000.000,00	27.497.224,25	-1.168.913,01	-2,74%	-2,36%	5,58%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	23.430.855,83	0,00	7.000.000,00	15.742.484,36	-688.371,47	-2,94%	-2,38%	5,69%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>477.855.792,65</b>	<b>22.708.535,02</b>	<b>42.955.176,75</b>	<b>451.344.814,44</b>	<b>-6.264.336,48</b>	<b>-1,31%</b>		<b>2,97%</b>

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	36.185.450,57	0,00	0,00	37.396.427,75	1.210.977,18	3,35%	3,35%	3,85%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	14.000.000,00	0,00	14.296.515,74	296.515,74	2,12%	3,34%	3,86%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	215.011,52	0,00	0,00	214.358,16	-653,36	-0,30%	-0,30%	0,00%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	6.712,68	0,00	0,00	6.691,82	-20,86	-0,31%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	470.726,43	0,00	0,00	466.366,97	-4.359,46	-0,93%	-0,93%	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	0,00	7.000.000,00	0,00	6.912.858,33	-87.141,67	-1,24%	-1,60%	8,44%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	32.157.283,90	0,00	0,00	31.495.138,46	-662.145,44	-2,06%	-2,06%	7,26%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	9.779.405,38	0,00	0,00	9.522.917,97	-256.487,41	-2,62%	-2,62%	8,12%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	29.734.658,47	0,00	0,00	28.881.006,55	-853.651,92	-2,87%	-2,87%	8,64%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	30.351.582,11	0,00	0,00	29.456.299,80	-895.282,31	-2,95%	-2,95%	7,66%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	24.207.402,45	0,00	0,00	23.229.701,19	-977.701,26	-4,04%	-4,04%	9,38%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	18.140.751,35	0,00	0,00	17.406.259,76	-734.491,59	-4,05%	-4,05%	8,28%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	17.744.502,11	0,00	0,00	16.854.849,10	-889.653,01	-5,01%	-5,01%	10,99%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	21.472.151,69	0,00	0,00	20.342.070,90	-1.130.080,79	-5,26%	-5,26%	8,13%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.452.730,84	0,00	0,00	4.073.509,52	-379.221,32	-8,52%	-8,52%	14,46%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.063.002,52	0,00	0,00	629.036,43	-433.966,09	-40,82%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>225.981.372,02</b>	<b>21.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>241.184.008,45</b>	<b>-5.797.363,57</b>	<b>-2,35%</b>		<b>7,52%</b>

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

<b>Ativos Exterior</b>	<b>Saldo Anterior</b>	<b>Aplicações</b>	<b>Resgates</b>	<b>Saldo Atual</b>	<b>Retorno (R\$)</b>	<b>Retorno (%)</b>	<b>(%) Instit</b>	<b>Var - Mês</b>
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	27.506.976,42	0,00	0,00	28.219.948,08	712.971,66	2,59%	2,59%	6,25%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	7.401.329,37	0,00	0,00	7.550.724,63	149.395,26	2,02%	2,02%	5,85%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	19.165.546,52	0,00	0,00	19.442.650,39	277.103,87	1,45%	1,45%	6,35%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	22.712.199,79	0,00	0,00	23.009.679,99	297.480,20	1,31%	1,31%	5,88%
<b>Total Exterior</b>	<b>76.786.052,10</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>78.223.003,09</b>	<b>1.436.950,99</b>	<b>1,87%</b>		<b>6,13%</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.