

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

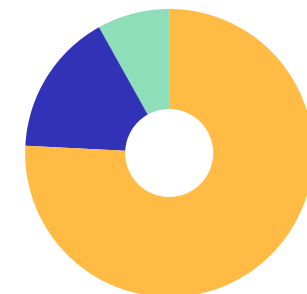
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.697.542,44	3,77%	36	4,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.202.599,29	5,71%	21	11,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	15.684.958,15	4,66%	644	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	5.079.153,66	1,51%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	7.016.793,98	2,08%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	541.350,95	0,16%	165	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.630.375,00	2,56%	104	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.740.625,00	2,89%	74	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.121.365,00	2,71%	18	13,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	51.016.006,84	15,16%	966	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	25.561,80	0,01%	1.000	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.194.940,58	2,14%	1.316	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	19.582.232,74	5,82%	392	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.667.297,35	0,50%	298	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	19.241.433,73	5,72%	324	13,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.570.734,43	0,47%	13.075	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.407.014,65	0,72%	144	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	50.553.937,25	15,02%	560	1,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.179.179,73	0,94%	637	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.953.201,31	3,25%	74	1,74%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	16.236.927,76	4,82%	276	0,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	2.061.269,99	0,61%	86	9,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	8.496.200,05	2,52%	854	1,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.477.275,88	0,74%	23.295	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.782.453,79	0,53%	169	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.228.353,57	0,96%	128	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.352.529,99	0,40%	3.447	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	8.791.246,64	2,61%	122	0,71%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	7.445.581,81	2,21%	14.217	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.290.000,00	0,68%		1,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	5.543.964,59	1,65%	87	0,53%	Artigo 9º - A, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	1.696.693,10	0,50%	215	1,27%	Artigo 9º - A, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	2.388.095,07	0,71%	435	0,63%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	17.646.013,93	5,24%	407	0,59%	Artigo 9º - A, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		80.814,35	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			336.542.910,05				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			80.814,35	Artigo 6º			
PL Total			336.623.724,40				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 3	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%	2,00%	6.730.858,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	165.533.505,43	49,19%	20,00%	45,00%	85,00%	120.527.968,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.730.858,20
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.365.429,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	75,00%	1.667.297,35	0,50%	0,00%	0,50%	4,00%	11.794.419,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	75,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.730.858,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	55,00%	76.952.299,79	22,87%	10,00%	31,00%	55,00%	108.146.300,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	55,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.365.429,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.365.429,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	20,00%	10.953.201,31	3,25%	0,00%	3,50%	7,00%	12.604.802,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.365.429,10
Total Renda Fixa	100,00%	255.106.303,88	75,80%	30,00%	80,00%	161,00%	



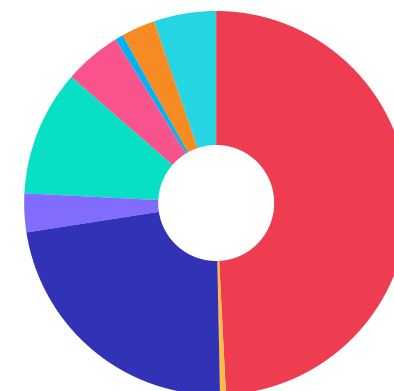
REDA FIXA 255.106.303,88
REDA VARIÁVEL 54.161.839,48
EXTERIOR 27.274.766,69

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!

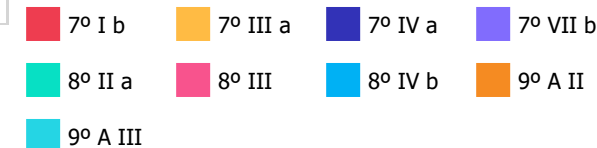


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.730.858,20
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.730.858,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	35,00%	35.635.011,03	10,59%	2,00%	7,50%	20,00%	31.673.570,98
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.730.858,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	16.236.828,45	4,82%	1,00%	4,00%	10,00%	17.417.462,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.730.858,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	15,00%	2.290.000,00	0,68%	0,00%	1,50%	5,00%	14.537.145,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.730.858,20
Total Renda Variável	45,00%	54.161.839,48	16,09%	3,00%	13,00%	45,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	9.628.752,76	2,86%	0,00%	0,00%	3,00%	467.534,54
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	17.646.013,93	5,24%	0,00%	7,00%	10,00%	16.008.277,08
Total Exterior	10,00%	27.274.766,69	8,10%	0,00%	7,00%	13,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	143.151.246,69	42,54	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	109.526.015,55	32,54	0,01
BANESTES DTVM	71.356.252,30	21,20	1,06
VINCI PARTNERS	5.010.807,36	1,49	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	4.084.788,17	1,21	0,05
OCCAM BRASIL	1.352.529,99	0,40	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 %		

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M 1 (Benchmark)	0,20%	0,60%	0,52%	0,91%	2,11%	8,57%	-	-
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,10%	-0,47%	0,22%	0,56%	1,36%	11,99%	0,36%	0,02%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,69%	1,42%	1,92%	3,27%	7,39%	17,55%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,67%	1,31%	1,85%	3,15%	7,10%	16,90%	1,01%	0,02%

IMA-B (Benchmark)	1,06%	-1,14%	1,25%	3,66%	9,17%	16,46%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,06%	-1,25%	1,20%	3,54%	8,86%	15,68%	2,38%	0,08%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,14%	-4,56%	0,34%	3,02%	6,56%	8,87%	3,39%	0,14%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	-1,98%	2,10%	0,50%	1,57%	8,62%	1,49%	0,06%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,79%	-5,88%	0,08%	-0,68%	2,82%	5,92%	2,93%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,53%	-1,96%	2,10%	0,53%	1,56%	8,23%	1,49%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	1,83%	1,55%	3,06%	6,86%	13,60%	0,77%	0,01%

IRF-M (Benchmark)	0,20%	-1,79%	0,19%	0,13%	0,71%	12,10%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,16%	-1,87%	0,11%	0,06%	0,51%	11,56%	1,19%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	0,51%	0,46%	0,79%	1,89%	8,12%	0,14%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,17%	-1,87%	0,05%	0,06%	0,49%	11,59%	1,19%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,28%	0,99%	0,73%	1,24%	2,28%	6,64%	0,04%	0,00%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,35%	1,49%	1,02%	1,82%	3,76%	4,91%	0,05%	0,01%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,13%	0,27%	0,24%	0,29%	0,40%	2,27%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,83%	3,22%	2,08%	4,61%	8,06%	10,08%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,53%	0,73%	1,72%	2,62%	6,94%	15,80%	1,19%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	1,42%	1,72%	3,05%	6,93%	15,76%	0,89%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	-0,44%	0,96%	2,25%	4,15%	-	1,19%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,72%	1,21%	2,05%	3,45%	15,85%	1,14%	0,02%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,54%	-1,05%	0,63%	1,52%	2,59%	11,03%	1,06%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	1,85%	1,56%	3,09%	8,00%	18,47%	0,77%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	6,16%	6,05%	14,70%	15,91%	44,41%	30,08%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	4,39%	5,86%	13,17%	15,30%	43,71%	25,14%	6,87%	0,22%

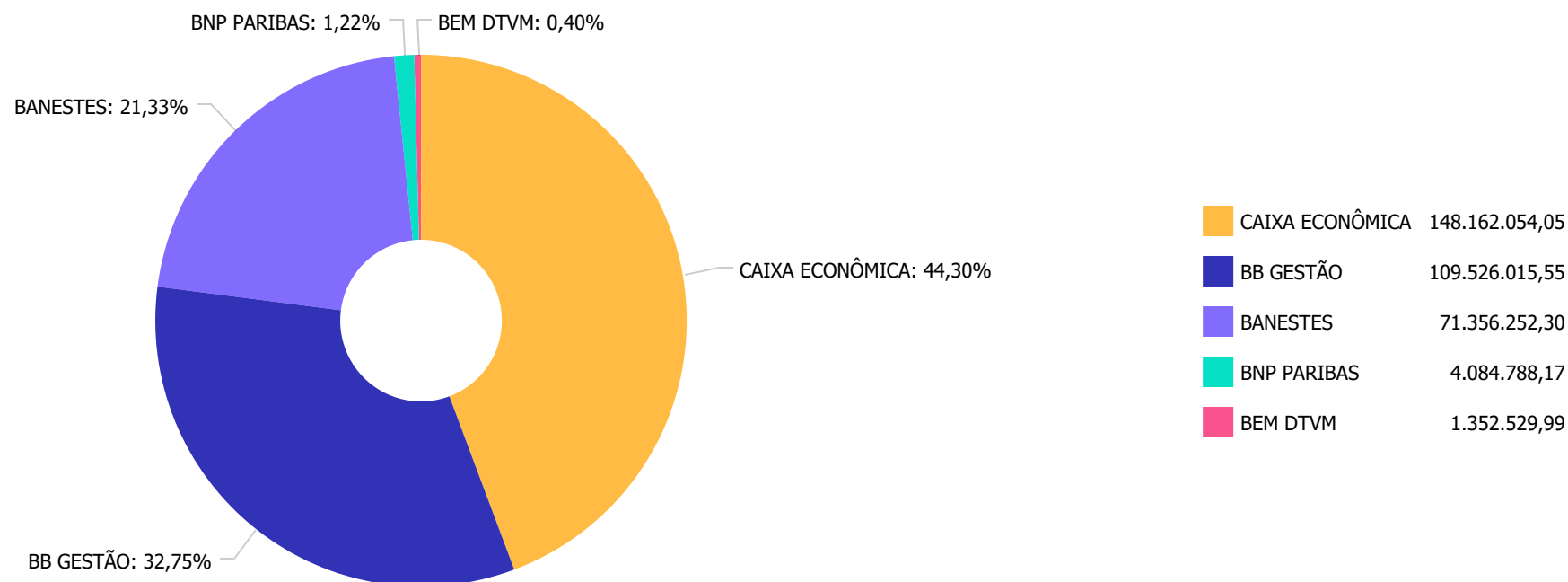
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	6,36%	6,11%	14,58%	15,74%	41,26%	45,18%	7,52%	0,22%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,95%	5,64%	14,72%	15,54%	36,82%	35,21%	6,27%	0,22%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,58%	-33,07%	-6,53%	-36,39%	-29,54%	-10,19%	16,86%	0,46%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,62%	3,12%	6,44%	8,46%	33,67%	38,26%	9,19%	0,16%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,48%	13,08%	10,17%	16,63%	36,09%	49,57%	7,04%	0,15%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,37%	3,36%	3,55%	4,69%	10,72%	-	1,31%	0,05%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2,90%	2,94%	11,33%	9,04%	-	-	7,70%	-
OCCAM FIC AÇÕES	4,38%	5,12%	12,29%	15,75%	42,51%	40,28%	8,17%	0,21%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,81%	6,66%	17,96%	17,78%	53,80%	48,84%	6,90%	0,25%

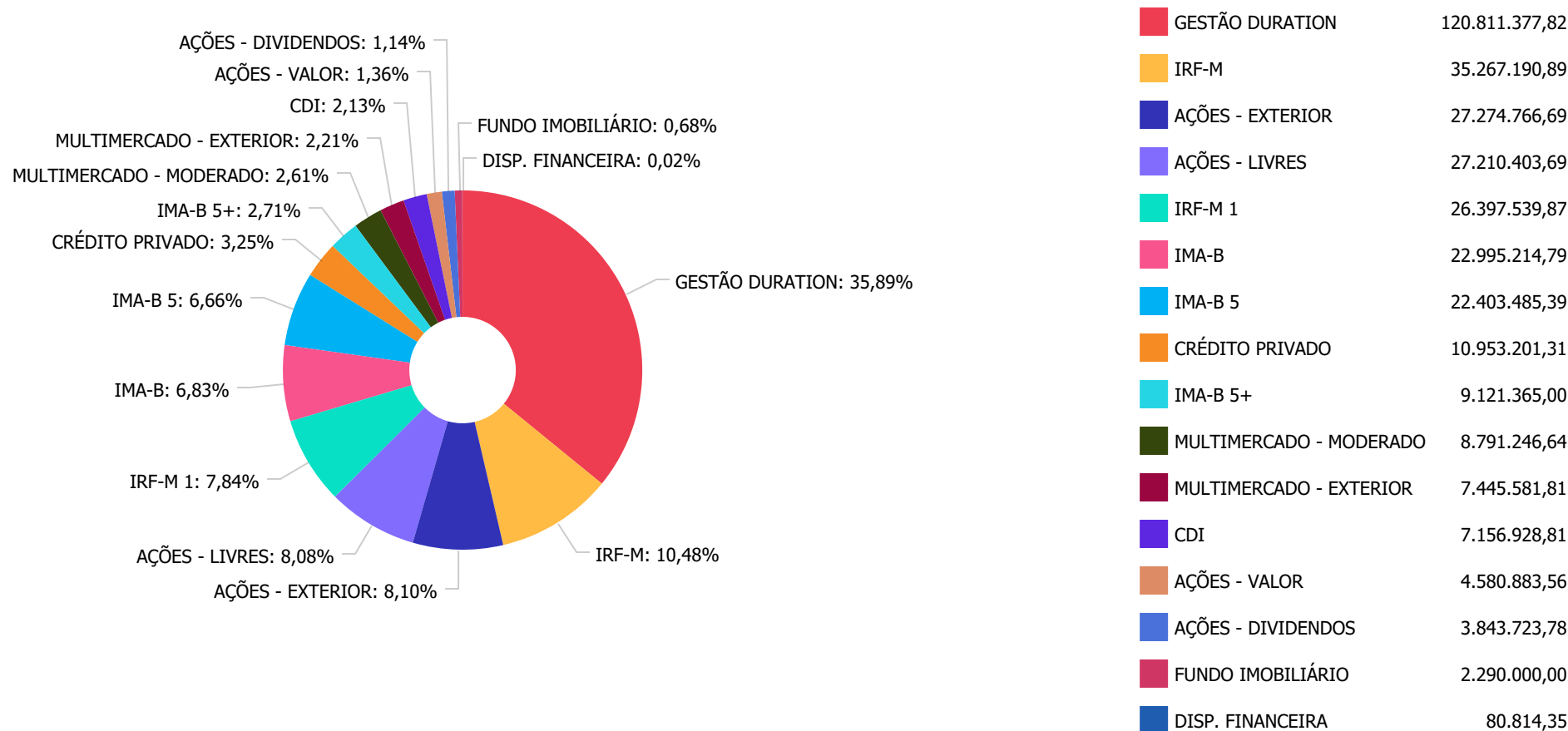
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,79%	9,66%	0,11%	10,42%	33,33%	105,13%	5,87%	0,17%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,23%	2,48%	2,12%	-0,23%	-	-	6,73%	-
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-6,90%	-2,31%	-9,86%	-2,27%	-	-	18,93%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-2,62%	11,91%	2,13%	13,83%	48,02%	124,61%	7,10%	0,12%

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



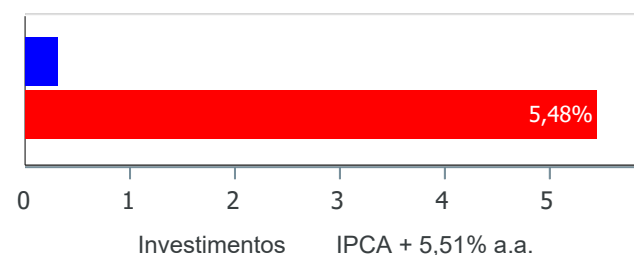
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2021)



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	325.679.727,73	4.334.218,97	4.766.670,31	323.956.966,54	-1.290.309,85	-1.290.309,85	-0,40%	-0,40%	0,68%	0,68%	-58,46%	3,42%
Fevereiro	323.956.966,54	8.288.078,01	5.017.090,33	323.540.486,60	-3.687.467,62	-4.977.777,47	-1,13%	-1,52%	1,25%	1,93%	-78,55%	3,03%
Março	323.540.486,60	6.547.108,04	4.747.719,54	327.003.703,57	1.663.828,47	-3.313.949,00	0,51%	-1,01%	1,43%	3,39%	-29,97%	3,89%
Abril	327.003.703,57	6.589.402,56	3.881.061,96	332.563.008,00	2.850.963,83	-462.985,17	0,86%	-0,16%	0,74%	4,15%	-3,83%	2,73%
Maio	332.563.008,00	7.000.589,93	4.715.840,43	336.410.400,69	1.562.643,19	1.099.658,02	0,47%	0,31%	1,28%	5,48%	5,60%	2,68%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

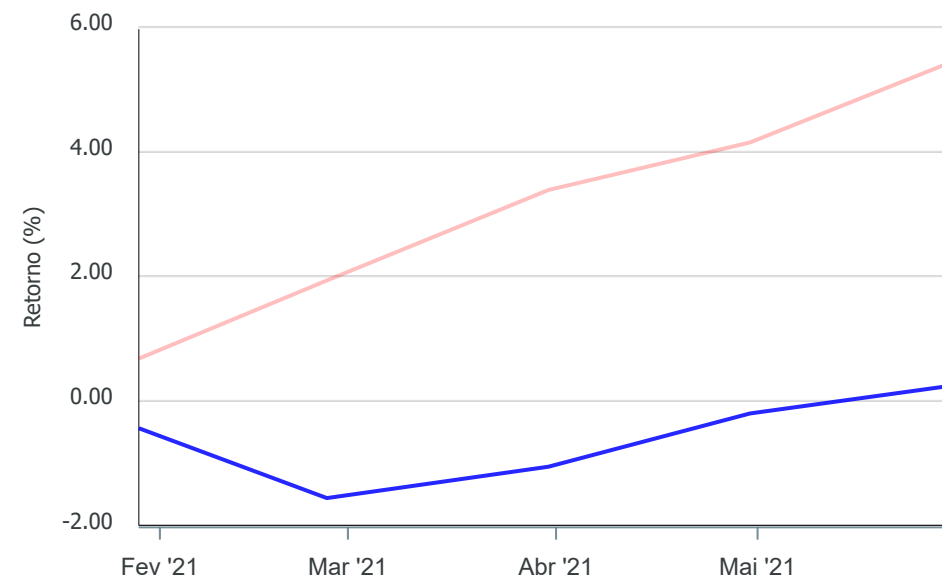
Evolução do Patrimônio



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 Maio/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.554.771,52	0,00	0,00	12.697.542,44	142.770,92	1,14%	1,14%	3,39%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.649.772,17	0,00	0,00	1.667.297,35	17.525,18	1,06%	1,06%	2,38%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.050.320,00	0,00	0,00	9.121.365,00	71.045,00	0,78%	0,79%	2,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.041.359,25	0,00	0,00	5.079.153,66	37.794,41	0,75%	0,75%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	537.337,57	0,00	0,00	541.350,95	4.013,38	0,75%	0,75%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	6.969.219,32	0,00	0,00	7.016.793,98	47.574,66	0,68%	0,68%	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	25.391,83	0,00	0,00	25.561,80	169,97	0,67%	0,67%	1,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	50.251.740,54	0,00	0,00	50.553.937,25	302.196,71	0,60%	0,60%	1,19%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	19.139.115,21	0,00	0,00	19.241.433,73	102.318,52	0,53%	0,53%	1,06%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.689.137,50	0,00	0,00	9.740.625,00	51.487,50	0,53%	0,53%	1,49%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.584.800,00	0,00	0,00	8.630.375,00	45.575,00	0,53%	0,53%	1,49%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.895.486,58	0,00	0,00	10.953.201,31	57.714,73	0,53%	0,53%	1,19%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.863.898,63	0,00	466.481,93	2.407.014,65	9.597,95	0,34%	0,35%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.170.172,56	0,00	0,00	3.179.179,73	9.007,17	0,28%	0,28%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	50.894.527,08	0,00	0,00	51.016.006,84	121.479,76	0,24%	0,24%	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.182.713,56	0,00	0,00	7.194.940,58	12.227,02	0,17%	0,17%	0,14%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.549.087,93	0,00	0,00	19.582.232,74	33.144,81	0,17%	0,17%	1,19%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.660.070,53	0,00	0,00	15.684.958,15	24.887,62	0,16%	0,16%	1,19%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	19.183.855,72	0,00	0,00	19.202.599,29	18.743,57	0,10%	0,10%	0,36%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	1.453.247,81	4.511.984,63	4.397.152,13	1.570.734,43	2.654,12	0,04%	0,13%	0,01%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	254.346.025,31	4.511.984,63	4.863.634,06	255.106.303,88	1.111.928,00	0,43%		1,23%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.035.347,67	0,00	0,00	3.228.353,57	193.005,90	6,36%	6,36%	7,52%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.682.418,74	0,00	0,00	1.782.453,79	100.035,05	5,95%	5,95%	6,27%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.341.308,63	0,00	0,00	2.477.275,88	135.967,25	5,81%	5,81%	6,90%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	8.139.010,32	0,00	0,00	8.496.200,05	357.189,73	4,39%	4,39%	6,87%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	15.669.438,87	0,00	0,00	16.236.927,76	567.488,89	3,62%	3,62%	9,19%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.003.115,09	0,00	0,00	2.061.269,99	58.154,90	2,90%	2,90%	7,70%
OCCAM FIC AÇÕES	0,00	1.329.137,19	0,00	1.352.529,99	23.392,80	1,76%	4,38%	8,17%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	8.672.283,82	0,00	0,00	8.791.246,64	118.962,82	1,37%	1,37%	1,31%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6.743.440,05	673.786,40	0,00	7.445.581,81	28.355,36	0,38%	0,48%	7,04%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.375.000,00	0,00	15.000,00	2.290.000,00	-70.000,00	-2,95%	-3,58%	16,86%
Total Renda Variável	50.661.363,19	2.002.923,59	15.000,00	54.161.839,48	1.512.552,70	2,87%		7,19%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	5.017.355,29	658.786,40	0,00	5.543.964,59	-132.177,10	-2,33%	-2,62%	7,10%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.753.268,29	0,00	0,00	1.696.693,10	-56.575,19	-3,23%	-3,23%	6,73%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	18.341.960,58	0,00	0,00	17.646.013,93	-695.946,65	-3,79%	-3,79%	5,87%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	2.565.106,21	0,00	0,00	2.388.095,07	-177.011,14	-6,90%	-6,90%	18,93%
Total Exterior	27.677.690,37	658.786,40	0,00	27.274.766,69	-1.061.710,08	-3,75%		7,32%

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.