

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos
em maio de 2021

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			212.420.415,26	14,77%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.618.009,28	1,43%	600	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	66.484.878,58	4,62%	735	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	29.544.304,09	2,05%	644	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	25.601.320,20	1,78%	966	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	57.090.639,96	3,97%	1.000	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	44.608.997,84	3,10%	392	2,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.842.743,14	1,94%	30	2,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	21.133.123,90	1,47%	83	2,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	61.615.129,18	4,28%	190	4,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	37.326.168,29	2,60%	196	3,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	42.596.771,76	2,96%	25	2,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	15.218.047,53	1,06%	15.734	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	16.532.116,69	1,15%	10.641	1,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	15.081.417,30	1,05%	298	0,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI...	D+3	Não há	2.511.754,45	0,17%	1.926	1,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	37.018.383,81	2,57%	560	0,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	23.942.883,26	1,66%	265	1,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	30.719.069,85	2,14%	143	2,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	48.091.396,86	3,34%	119	2,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	23.480.940,87	1,63%	257	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.696.706,39	0,47%	2.888	4,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	D+45 a ...	01/08/2016	8.475.996,50	0,59%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	17.845,27	0,00%	28	4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	39.580.607,22	2,75%	6	4,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	13.220.729,39	0,92%	9.567	1,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	53.979.169,28	3,75%	5.791	2,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	11.693.823,56	0,81%	35	0,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.705.755,99	0,19%	6.121	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	15.970.176,16	1,11%	169	1,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	38.604.222,18	2,68%	128	4,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	10.562.472,81	0,73%	6.581	0,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	14.946.863,93	1,04%	322	3,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	34.920.855,89	2,43%	37.572	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.832.573,38	0,54%	56	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	32.265.874,46	2,24%	113	3,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	34.633.983,54	2,41%	14.031	0,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	15.430.988,69	1,07%	3.447	1,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.062.601,76	0,14%	2.572	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

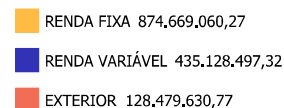
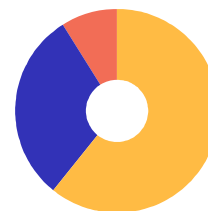
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.700.444,07	0,33%	36	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.521.833,29	0,45%	2.437	3,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC ...	D+2	27 meses	4.245.642,70	0,30%	723	4,09%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC...	D+2	22 meses	4.769.902,44	0,33%	668	4,38%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.641.720,23	0,18%	9	3,96%	Artigo 8º, Inciso III
MAG FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.734.835,51	0,40%	40	4,86%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	36.295.825,64	2,52%	41.623	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	Não se ...	Não se aplica	293.489,05	0,02%	19	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.354.637,15	0,23%	99	0,70%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.885.987,76	0,13%	39	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.049.080,46	0,35%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I M...	Não se ...	Não se aplica	17.734.527,17	1,23%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTISTRATÉGIA II FI...	Não se ...	Não se aplica	2.707.436,59	0,19%	46	3,20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	6.577.437,02	0,46%		5,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.205.000,00	0,29%		4,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	20.628.388,61	1,43%	93	1,00%	Artigo 9º - A, Inciso II
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVES...	D+5 du	Não há	14.060.141,80	0,98%	3.590	4,30%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	31.007.491,98	2,16%	18.056	1,83%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	17.677.237,60	1,23%	13.895	0,84%	Artigo 9º - A, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	5.911.944,95	0,41%	118	2,69%	Artigo 9º - A, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3,922
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR I...	D+5 du	Não há	5.147.860,46	0,36%	1.507	2,59%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO N...	D+5 du	Não há	4.508.834,68	0,31%	56	0,47%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	29.537.730,69	2,05%	140.892	0,86%	Artigo 9º - A, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.158.959,13	0,08%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.438.277.188,36				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.158.959,13				Artigo 6º
PL Total			1.439.436.147,49				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	212.420.415,26	14,77%	17,00%	25,00%	40,00%	362.890.460,08
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	466.212.250,44	32,41%	20,00%	22,00%	50,00%	252.926.343,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	17.593.171,75	1,22%	1,00%	5,00%	35,00%	485.803.844,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	45,00%	169.949.381,04	11,82%	1,00%	6,00%	40,00%	405.361.494,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	8.493.841,78	0,59%	1,00%	2,00%	3,00%	34.654.473,87
Total Renda Fixa	100,00%	874.669.060,27	60,81%	40,00%	60,00%	168,00%	

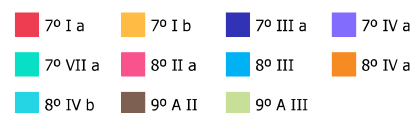
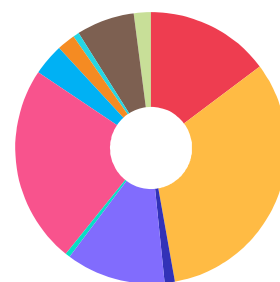


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestor!

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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alinea 'a'	35,00%	0,00	0,00%	1,00%	1,00%	5,00%	71.913.859,42
Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'a'	25,00%	339.632.975,60	23,61%	6,00%	18,00%	25,00%	19.936.321,49
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	53.687.926,52	3,73%	1,00%	6,00%	10,00%	90.139.792,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a'	5,00%	31.025.158,18	2,16%	1,00%	3,00%	3,00%	12.123.157,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'b'	5,00%	10.782.437,02	0,75%	1,00%	2,00%	5,00%	61.131.422,40
Total Renda Variável	35,00%	435.128.497,32	30,25%	10,00%	30,00%	48,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	98.941.900,08	6,88%	1,00%	8,00%	10,00%	44.885.818,76
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	29.537.730,69	2,05%	1,00%	2,00%	10,00%	114.289.988,15
Total Exterior	10,00%	128.479.630,77	8,93%	2,00%	10,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	212.420.415,26	14,77	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	198.236.847,63	13,78	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	159.215.306,83	11,07	0,04
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	151.397.920,44	10,53	0,03
ITAÚ UNIBANCO	108.256.255,38	7,53	0,01
WESTERN ASSET	106.082.509,96	7,38	0,21
AZ QUEST INVESTIMENTOS	85.590.428,62	5,95	0,31
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	78.810.466,71	5,48	0,01
VINCI PARTNERS	61.982.279,00	4,31	0,04
ARX INVESTIMENTOS	39.580.607,22	2,75	0,10
ICATU VANGUARDA	38.405.215,95	2,67	0,09
XP ASSET MANAGEMENT	37.529.325,27	2,61	0,24
MOAT CAPITAL	34.633.983,54	2,41	0,22
KINEA INVESTIMENTOS	22.783.607,63	1,58	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	21.133.123,90	1,47	0,01
OCCAM BRASIL	15.430.988,69	1,07	0,05
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	15.218.047,53	1,06	0,05
OLIVEIRA TRUST	8.475.996,50	0,59	0,07
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	8.246.589,96	0,57	0,10
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	7.946.380,90	0,55	0,00
ITAÚ DTVM	7.832.573,38	0,54	0,00
BV ASSET	6.577.437,02	0,46	0,01
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.911.944,95	0,41	0,12
REAG GESTORA DE RECURSOS	4.205.000,00	0,29	1,12
PERFIN INVESTIMENTOS	2.062.601,76	0,14	0,02
BRZ INVESTIMENTOS	293.489,05	0,02	0,01
PLURAL	17.845,28	0,00	0,00

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
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	0,37%	1,46%	0,99%	1,73%	3,40%	9,73%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	0,47%	1,98%	1,31%	2,36%	4,72%	11,05%	-	-

IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	-0,66%	0,61%	1,45%	3,33%	11,00%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	-0,79%	0,68%	1,57%	3,44%	11,29%	1,07%	0,04%

CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,56%	2,38%	1,56%	2,86%	5,74%	14,76%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-6,67%	-31,12%	-19,37%	-32,55%	-16,42%	-35,01%	-	0,50%

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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,68%	1,34%	1,87%	3,18%	7,13%	17,09%	1,00%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,69%	1,36%	1,89%	3,19%	7,12%	17,04%	1,01%	0,02%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,54%	-0,94%	1,25%	2,27%	5,61%	18,51%	1,40%	0,05%

IMA-B (Benchmark)	1,06%	-1,14%	1,25%	3,66%	9,17%	16,46%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	-1,22%	1,21%	3,52%	8,86%	15,63%	2,41%	0,08%
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%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,29%	-2,57%	1,01%	2,82%	7,38%	15,45%	2,89%	0,09%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1,03%	-1,26%	1,17%	3,51%	8,82%	15,51%	2,39%	0,08%

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
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,08%	-1,42%	1,15%	3,52%	8,49%	15,91%	2,47%	0,08%
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,17%	-1,87%	0,05%	0,06%	0,49%	11,59%	1,19%	0,03%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,17%	-1,78%	0,16%	0,17%	0,61%	11,55%	1,19%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,30%	-0,23%	0,43%	0,21%	0,87%	7,88%	0,26%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,83%	3,22%	2,08%	4,61%	8,06%	10,08%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	-0,44%	0,96%	2,25%	4,15%	-	1,19%	0,04%
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,99%	-1,80%	0,95%	3,06%	8,41%	15,49%	2,54%	0,08%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0,98%	-0,82%	1,32%	3,73%	9,55%	15,05%	3,03%	0,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,60%	0,82%	1,65%	2,61%	6,49%	16,54%	1,09%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,27%	0,72%	0,52%	0,92%	1,75%	9,72%	0,03%	0,01%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	0,65%	1,24%	1,82%	3,07%	6,90%	16,75%	1,03%	0,02%

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
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	2,01%	9,23%	5,77%	12,06%	24,20%	45,43%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	-0,12%	-12,75%	-25,83%	-10,68%	-2,37%	17,00%	0,03%	0,32%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,40%	6,08%	3,85%	8,15%	15,59%	25,97%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-5,62%	-90,97%	-90,41%	-90,69%	-92,00%	-90,97%	18,83%	0,14%

IBX (Benchmark)	5,92%	8,14%	15,50%	18,03%	47,63%	34,45%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4,68%	11,49%	12,76%	19,22%	47,09%	53,19%	8,64%	0,22%

Ibovespa (Benchmark)	6,16%	6,05%	14,70%	15,91%	44,41%	30,08%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5,11%	5,45%	12,30%	14,27%	40,30%	32,96%	7,71%	0,21%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,05%	5,67%	12,42%	10,53%	21,00%	21,09%	6,86%	0,17%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5,60%	7,20%	12,81%	15,42%	37,69%	24,59%	7,72%	0,19%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,27%	0,13%	13,77%	8,36%	18,82%	9,48%	8,83%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	8,02%	8,38%	16,64%	17,02%	33,87%	8,80%	9,68%	0,25%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,26%	3,92%	12,44%	12,20%	27,00%	15,90%	6,07%	0,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,67%	12,46%	13,59%	19,54%	50,35%	41,02%	7,60%	0,18%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4,88%	5,70%	12,54%	15,42%	41,24%	45,66%	7,11%	0,21%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO	0,52%	-0,02%	0,89%	1,20%	2,12%	-	0,62%	0,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	-0,43%	-1,23%	-0,13%	0,10%	-	-	0,63%	-

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
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,53%	8,25%	15,93%	17,17%	-	-	6,88%	-
CDI (Benchmark)	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
MAG FI MULTIMERCADO	0,66%	-0,74%	-0,05%	0,34%	2,08%	4,93%	0,43%	0,02%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	0,15%	0,58%	0,85%	1,54%	3,66%	1,94%	0,73%	0,02%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,60%	7,08%	4,46%	9,39%	18,28%	31,90%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	-0,14%	-0,56%	-0,37%	-5,43%	-21,70%	-24,62%	0,04%	0,18%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-16,53%	-24,21%	-5,55%	-28,76%	-19,60%	-38,67%	16,62%	0,58%
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%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,64%	3,14%	6,47%	8,54%	33,85%	38,48%	9,23%	0,16%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,11%	0,18%	-0,37%	0,08%	-	-	-	-
OCCAM FIC AÇÕES	4,38%	5,12%	12,29%	15,75%	42,51%	40,28%	8,17%	0,21%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIELABORADA FI...	-0,62%	31,36%	0,30%	31,84%	-	-	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIELABORADA II FIP	-0,36%	-3,50%	1,17%	56,42%	-	59,36%	0,42%	0,63%
BTG ECONOMIA REAL MULTIELABORADA FIP	-0,54%	-	20,97%	-	-	-	-	-

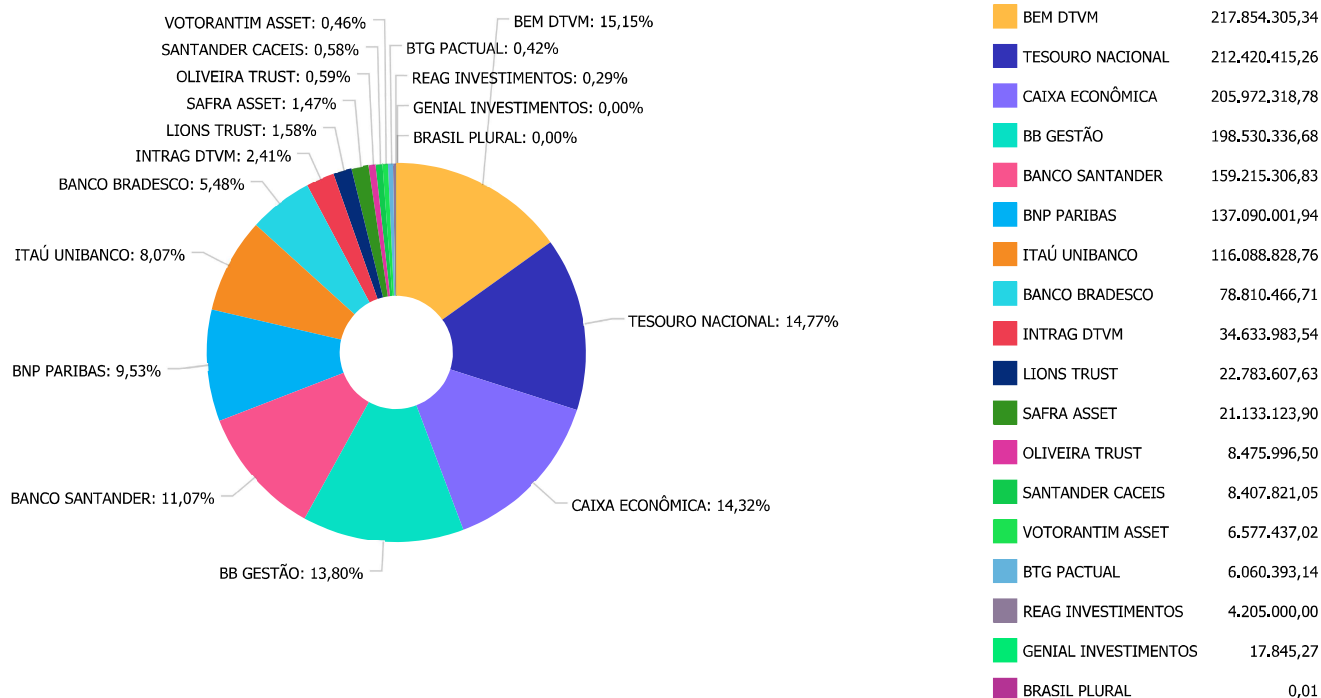
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,44%	3,64%	14,36%	13,24%	37,67%	22,49%	6,51%	0,24%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,41%	12,87%	10,11%	16,47%	36,42%	50,88%	7,03%	0,15%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,68%	11,49%	12,80%	19,22%	46,81%	-	8,66%	0,22%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	7,25%	-0,73%	12,61%	6,27%	36,50%	-	7,81%	0,29%

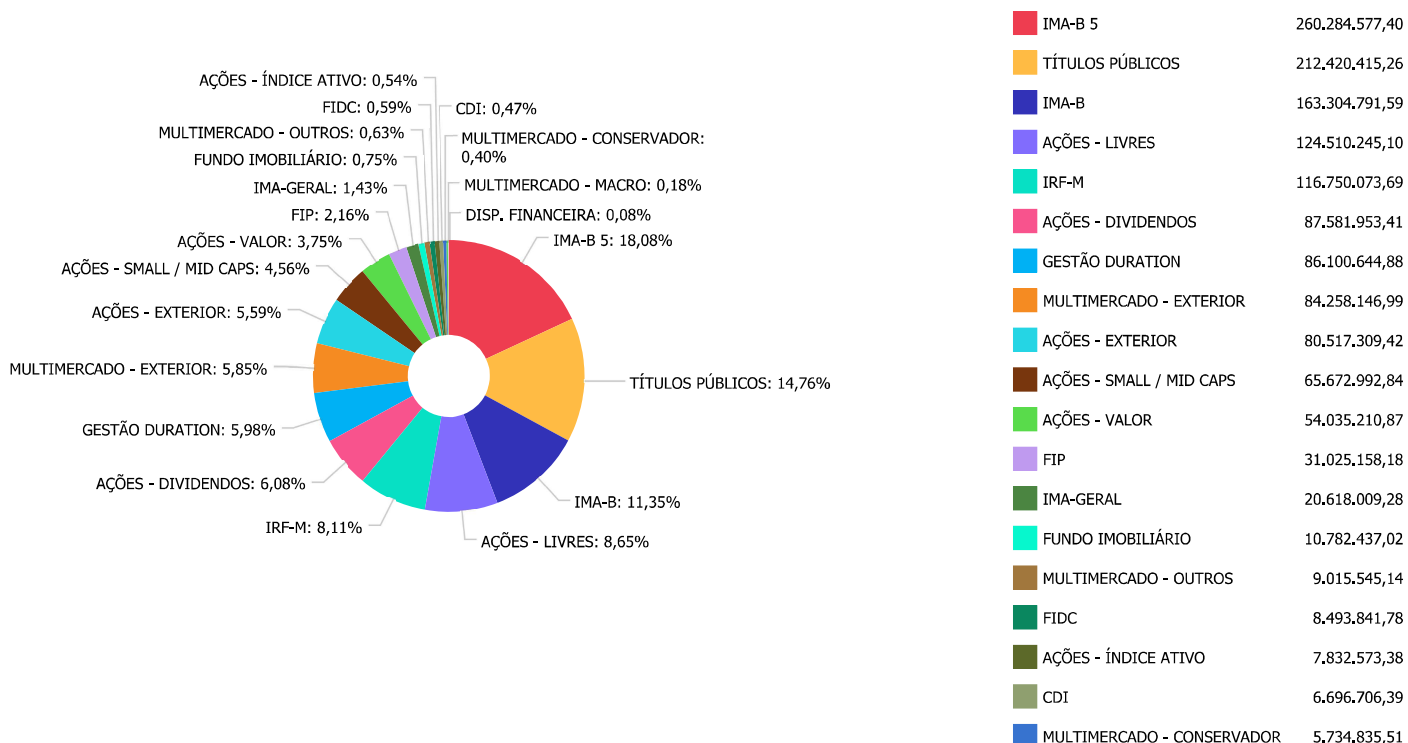
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	-5,39%	3,40%	-5,06%	3,58%	40,25%	-	10,12%	0,18%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MUL...	1,59%	-3,76%	2,11%	-2,58%	6,67%	13,36%	2,91%	0,10%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INVESTIMENTO NO EX...	-2,07%	-3,32%	-4,54%	-5,31%	2,92%	45,75%	4,50%	0,08%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,04%	7,54%	2,44%	7,30%	32,48%	111,75%	7,10%	0,18%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-3,51%	10,50%	0,01%	11,03%	37,52%	106,65%	5,80%	0,13%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-2,01%	14,44%	2,77%	15,69%	43,96%	107,06%	7,02%	0,15%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	-1,72%	13,54%	1,43%	13,80%	-	-	8,68%	-
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERI...	-0,22%	6,49%	9,11%	8,85%	31,81%	56,50%	7,16%	0,16%

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



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



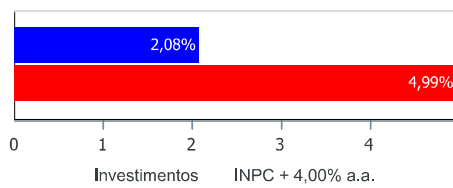
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	11/03/2015	7.600	3.031,376224	3.825,999376	23.038.459,30	29.077.595,26	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2.000	2.593,340767	3.825,999376	5.186.681,53	7.651.998,75	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	4.022,388719	10.048.181,87	13.676.121,64	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	8.500	3.097,511439	4.246,781118	26.328.847,23	36.097.639,50	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	6.000	3.097,511438	4.246,781118	18.585.068,63	25.480.686,71	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.246,781118	7.520.551,00	13.589.699,58	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	06/12/2016	3.450	2.896,880939	4.246,781118	9.994.239,24	14.651.394,86	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	13.000	3.271,849021	4.246,781118	42.534.037,27	55.208.154,53	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.246,781118	13.087.396,08	16.987.124,47	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	1.320.231.395,12	35.973.755,95	20.643.927,70	1.324.155.868,46	-11.405.354,91	-11.405.354,91	-0,85%	-0,85%	0,58%	0,58%	-146,58%	6,17%
Fevereiro	1.324.155.868,46	13.599.501,88	2.905.461,40	1.322.668.875,91	-12.181.033,03	-23.586.387,94	-0,91%	-1,76%	1,10%	1,69%	-103,95%	5,38%
Março	1.322.668.875,91	19.786.890,41	2.255.094,70	1.352.915.564,03	12.714.892,41	-10.871.495,53	0,95%	-0,83%	1,22%	2,93%	-28,17%	6,31%
Abril	1.352.915.564,03	30.923.340,78	5.109.519,98	1.399.842.495,29	21.113.110,46	10.241.614,93	1,53%	0,69%	0,69%	3,65%	18,97%	3,94%
Maior	1.399.842.495,29	83.985.765,84	65.161.724,13	1.438.277.188,36	19.610.651,36	29.852.266,29	1,38%	2,08%	1,29%	4,99%	41,80%	4,20%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



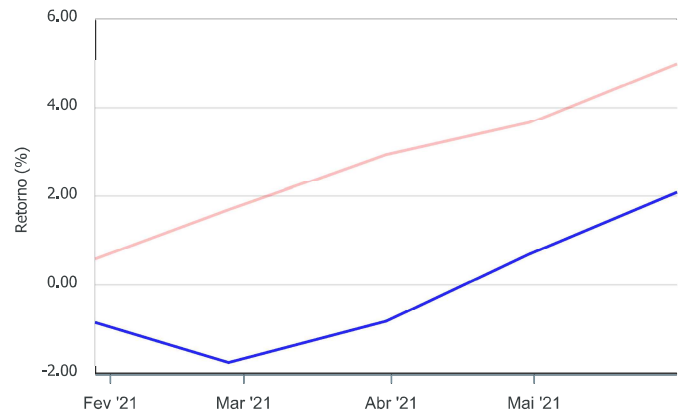
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	20.863.618,16	0,00	0,00	21.133.123,90	269.505,74	1,29%	1,29%	2,89%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	2.485.045,57	0,00	0,00	2.511.754,45	26.708,88	1,07%	1,07%	2,47%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	14.922.894,55	0,00	0,00	15.081.417,30	158.522,75	1,06%	1,06%	2,38%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.692.979,82	0,00	0,00	23.942.883,26	249.903,44	1,05%	1,05%	2,41%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	36.946.195,94	0,00	0,00	37.326.168,29	379.972,35	1,03%	1,03%	2,39%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	47.619.387,89	0,00	0,00	48.091.396,86	472.008,97	0,99%	0,99%	2,54%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	15.069.769,61	0,00	0,00	15.218.047,53	148.277,92	0,98%	0,98%	3,03%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	61.199.930,19	0,00	0,00	61.615.129,18	415.198,99	0,68%	0,68%	1,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	46.747.726,35	19.292.695,48	0,00	66.484.878,58	444.456,75	0,67%	0,69%	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	56.711.025,41	0,00	0,00	57.090.639,96	379.614,55	0,67%	0,67%	1,01%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	30.534.587,06	0,00	0,00	30.719.069,85	184.482,79	0,60%	0,60%	1,09%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.443.780,02	0,00	0,00	16.532.116,69	88.336,67	0,54%	0,54%	1,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.519.349,43	0,00	0,00	20.618.009,28	98.659,85	0,48%	0,48%	1,07%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	8.436.013,23	0,00	0,00	8.475.996,50	39.983,27	0,47%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	36.850.327,23	0,00	37.018.383,81	168.056,58	0,46%	0,60%	1,19%
TÍTULOS PÚBLICOS	229.104.481,81	0,00	17.499.162,98	212.420.415,26	815.096,43	0,36%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	27.662.377,22	27.842.743,13	27.842.743,13	27.842.743,14	180.365,92	0,32%	0,65%	1,03%
QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.676.898,18	0,00	0,00	6.696.706,39	19.808,21	0,30%	0,30%	0,26%
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	523.844,08	0,00	525.298,48	0,00	1.454,40	0,28%	0,35%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.417.516,65	0,00	0,00	23.480.940,87	63.424,22	0,27%	0,27%	0,03%

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	25.540.358,14	0,00	0,00	25.601.320,20	60.962,06	0,24%	0,24%	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	44.533.492,83	0,00	0,00	44.608.997,84	75.505,01	0,17%	0,17%	1,19%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.525.990,83	0,00	0,00	42.596.771,76	70.780,93	0,17%	0,17%	1,19%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.497.425,57	0,00	0,00	29.544.304,09	46.878,52	0,16%	0,16%	1,19%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	19.120,76	0,00	0,00	17.845,27	-1.275,49	-6,67%	-	-
Total Renda Fixa	831.693.809,31	83.985.765,84	45.867.204,59	874.669.060,27	4.856.689,71	0,56%		1,42%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	29.869.791,65	0,00	0,00	32.265.874,46	2.396.082,81	8,02%	8,02%	9,68%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	32.433.146,13	0,00	0,00	34.920.855,89	2.487.709,76	7,67%	7,67%	7,60%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.079.832,95	0,00	0,00	6.521.833,29	442.000,34	7,27%	7,27%	8,83%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	32.294.356,55	0,00	0,00	34.633.983,54	2.339.626,99	7,24%	7,24%	7,81%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	3.921.000,00	0,00	0,00	4.205.000,00	284.000,00	7,24%	-5,62%	18,83%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	36.296.283,46	0,00	0,00	38.604.222,18	2.307.938,72	6,36%	6,36%	7,52%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.073.896,35	0,00	0,00	15.970.176,16	896.279,81	5,95%	5,95%	6,27%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.520.230,75	0,00	0,00	13.220.729,39	700.498,64	5,59%	5,59%	7,72%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	37.505.242,35	0,00	0,00	39.580.607,22	2.075.364,87	5,53%	5,53%	6,88%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.175.927,77	0,00	0,00	14.946.863,93	770.936,16	5,44%	5,44%	6,51%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.034.855,21	0,00	0,00	10.562.472,81	527.617,60	5,26%	5,26%	6,07%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.451.832,11	0,00	0,00	7.832.573,38	380.741,27	5,11%	5,11%	7,71%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.963.541,68	0,00	0,00	2.062.601,76	99.060,08	5,04%	5,04%	6,86%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.481.563,44	0,00	0,00	4.700.444,07	218.880,63	4,88%	4,88%	7,11%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	51.565.079,83	0,00	0,00	53.979.169,28	2.414.089,45	4,68%	4,68%	8,64%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.171.503,19	0,00	0,00	11.693.823,56	522.320,37	4,68%	4,68%	8,66%
OCCAM FIC AÇÕES	14.784.161,94	0,00	0,00	15.430.988,69	646.826,75	4,38%	4,38%	8,17%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.610.814,11	0,00	0,00	2.705.755,99	94.941,88	3,64%	3,64%	9,23%
MAG FI MULTIMERCADO	5.697.070,95	0,00	0,00	5.734.835,51	37.764,56	0,66%	0,66%	0,43%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.223.700,52	0,00	0,00	4.245.642,70	21.942,18	0,52%	0,52%	0,62%

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	36.147.510,41	0,00	0,00	36.295.825,64	148.315,23	0,41%	0,41%	7,03%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.637.720,90	0,00	0,00	2.641.720,23	3.999,33	0,15%	0,15%	0,73%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	5.294.266,07	0,00	5.292.695,48	0,00	-1.570,59	-0,03%	0,23%	0,60%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.054.805,95	0,00	0,00	5.049.080,46	-5.725,49	-0,11%	-	-
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	1.888.318,96	0,00	0,00	1.885.987,76	-2.331,20	-0,12%	-0,12%	0,03%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP	293.900,71	0,00	0,00	293.489,05	-411,66	-0,14%	-0,14%	0,04%
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTISTRATÉGIA II FIP	2.717.154,65	0,00	0,00	2.707.436,59	-9.718,06	-0,36%	-0,36%	0,42%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.790.649,46	0,00	0,00	4.769.902,44	-20.747,02	-0,43%	-0,43%	0,63%
BTG ECONOMIA REAL MULTISTRATÉGIA FIP	3.372.798,28	0,00	0,00	3.354.637,15	-18.161,13	-0,54%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	17.844.382,43	0,00	0,00	17.734.527,17	-109.855,26	-0,62%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	7.258.494,25	0,00	1.824,06	6.577.437,02	-679.233,17	-9,36%	-16,53%	16,62%
Total Renda Variável	421.453.833,01	0,00	5.294.519,54	435.128.497,32	18.969.183,85	4,50%		7,61%

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
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	10.434.029,12	0,00	6.000.000,00	4.508.834,68	74.805,56	0,72%	1,59%	2,91%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	14.091.364,24	0,00	0,00	14.060.141,80	-31.222,44	-0,22%	-0,22%	7,16%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	13.224.894,04	0,00	8.000.000,00	5.147.860,46	-77.033,58	-0,58%	-2,07%	4,50%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	6.015.202,23	0,00	0,00	5.911.944,95	-103.257,28	-1,72%	-1,72%	8,68%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	21.050.906,72	0,00	0,00	20.628.388,61	-422.518,11	-2,01%	-2,01%	7,02%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	18.320.832,62	0,00	0,00	17.677.237,60	-643.595,02	-3,51%	-3,51%	5,80%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	30.782.587,29	0,00	0,00	29.537.730,69	-1.244.856,60	-4,04%	-4,04%	7,10%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	32.775.036,71	0,00	0,00	31.007.491,98	-1.767.544,73	-5,39%	-5,39%	10,12%
Total Exterior	146.694.852,97	0,00	14.000.000,00	128.479.630,77	-4.215.222,20	-2,87%		7,46%

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.