

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2021)

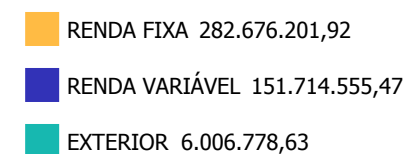
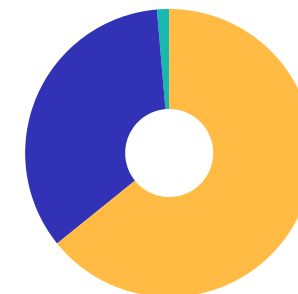
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	30.483.453,08	6,92%	977	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.963.232,62	3,85%	735	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	13.406.501,05	3,04%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	88.824.687,12	20,17%	966	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	71.476.379,17	16,23%	1.034	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.055.464,65	0,24%	879	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	137.017,14	0,03%	1.316	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.624.278,40	3,55%	265	1,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	21.606.974,74	4,91%	197	1,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.630.703,74	0,82%	43	5,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	1.499.728,76	0,34%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.819.343,69	0,41%	31	1,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	2.936.037,11	0,67%	8	6,24%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.478.760,70	0,56%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	11.092.080,52	2,52%	825	4,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	11.406.769,82	2,59%	5.809	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	11.216.749,12	2,55%	889	6,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	14.569.507,68	3,31%	211	10,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	21.839.280,27	4,96%	237	6,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	13.254.788,92	3,01%	282	13,44%	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
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.457.200,55	1,69%	2.740	0,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	8.166.580,02	1,85%	2.572	1,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	17.966.906,60	4,08%	16	2,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	1.460.756,14	0,33%		0,00%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.999.175,39	1,36%	1.255	0,30%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.049.080,44	1,15%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	11.025.486,62	2,50%	28	<b>8,00%</b>	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.462.522,34	1,69%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	2.548.386,74	0,58%		1,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.199.284,30	0,27%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+5 du	Não há	6.006.778,63	1,36%	183	1,07%	Artigo 9º - A, Inciso II
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	4.770.758,26	1,08%	8	10,46%	Desenquadrado - RF
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.962.881,69	1,35%	5	<b>28,95%</b>	Desenquadrado - RF
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>440.397.536,02</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 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 ' b '	100,00%	222.346.734,83	50,49%	9,96%	49,81%	62,26%	51.844.771,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	44.181.029,33	10,03%	3,86%	9,29%	40,00%	131.977.985,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	5.414.797,81	1,23%	0,00%	2,28%	2,28%	4.626.266,01
Desenquadrado - RF	0,00%	10.733.639,95	2,44%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.733.639,95
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>282.676.201,92</b>	<b>64,19%</b>	<b>13,82%</b>	<b>61,38%</b>	<b>104,54%</b>	



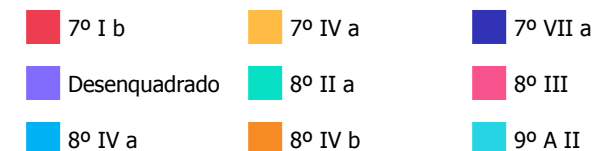
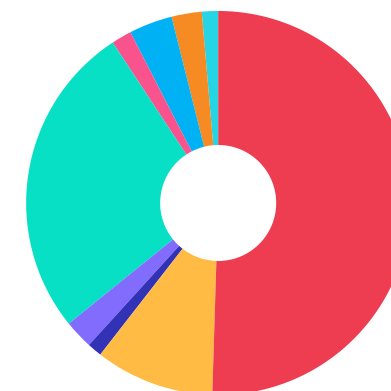
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	25,00%	116.969.863,50	26,56%	3,58%	17,91%	25,00%	-6.870.479,50
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.459.931,53	1,69%	3,14%	3,14%	10,00%	36.579.822,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	16.074.567,06	3,65%	0,00%	3,91%	5,00%	5.945.309,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	11.210.193,38	2,55%	0,00%	2,80%	5,00%	10.809.683,42
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>151.714.555,47</b>	<b>34,45%</b>	<b>6,72%</b>	<b>27,76%</b>	<b>45,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	6.006.778,63	1,36%	0,00%	0,43%	5,00%	16.013.098,17
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,43%	5,00%	22.019.876,80
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>6.006.778,63</b>	<b>1,36%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,86%</b>	<b>10,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	161.493.548,08	36,67	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	76.477.465,15	17,37	0,00
META ASSET MANAGEMENT	21.839.280,27	4,96	6,21
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	21.606.974,74	4,91	0,00
MULTINVEST CAPITAL	19.217.670,61	4,36	2,16
TRÍGONO CAPITAL	17.966.906,60	4,08	0,87
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	14.569.507,68	3,31	3,11
ITAÚ UNIBANCO	12.005.954,02	2,73	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	11.406.769,82	2,59	0,58
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	11.216.749,12	2,55	0,18
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	11.092.080,52	2,52	0,31
KPTL	11.025.486,62	2,50	2,85
PERFIN INVESTIMENTOS	8.166.580,02	1,85	0,07
ÚNICA ADMINISTRADORA	7.462.522,34	1,69	-
NAVI CAPITAL	7.457.200,55	1,69	0,45
KINEA INVESTIMENTOS	5.049.080,44	1,15	0,00
AURORA CAPITAL	4.770.758,26	1,08	1,17
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.630.703,74	0,82	1,00
TERCON ASSET MANAGEMENT	2.936.037,11	0,67	0,04
ZION INVEST	2.548.386,74	0,58	0,31
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.478.760,70	0,56	2,55
PLURAL	1.819.343,69	0,41	0,02
RJI CORRETORA DE VALORES	1.499.728,76	0,34	0,00
CAPITÂNIA	1.460.756,14	0,33	0,01
HEDGE INVESTMENTS	1.199.284,30	0,27	0,10

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	222.346.734,83	50,49	9,96	62,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	44.181.029,33	10,03	3,86	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5.414.797,81	1,23	0,00	2,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	116.969.863,50	26,56	3,58	25,00
Artigo 8º, Inciso III	7.459.931,53	1,69	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	16.074.567,06	3,65	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	11.210.193,38	2,55	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	6.006.778,63	1,36	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,48%	6,48%	4,10%	8,65%	16,66%	28,32%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-26,49%	-42,49%	-39,25%	-57,80%	-60,83%	-56,78%	-	1,37%

<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,40%	6,08%	3,85%	8,15%	15,59%	25,97%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,06%	-2,22%	0,46%	-1,75%	-4,20%	-7,57%	-	-

<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,32%	5,68%	3,61%	7,65%	14,51%	23,63%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	1,68%	2,25%	3,68%	7,42%	19,79%	1,04%	0,03%

<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,20%	0,60%	0,52%	0,91%	2,11%	8,57%	-	-
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%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,69%	1,42%	1,92%	3,27%	7,39%	17,55%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-16,58%	-23,45%	-16,28%	-23,66%	-67,84%	-75,73%	26,55%	0,54%
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%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,03%	10,00%	0,00%	12,28%	17,30%	29,04%	1,80%	0,11%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,19%	-0,30%	0,32%	0,29%	-25,79%	-35,86%	0,51%	0,22%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	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%

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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	-1,23%	1,20%	3,55%	8,92%	15,71%	2,39%	0,08%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,20%	-1,79%	0,19%	0,13%	0,71%	12,10%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,45%	1,42%	1,01%	2,70%	-1,25%	3,94%	0,55%	0,05%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,09%	4,40%	2,71%	13,82%	11,37%	16,03%	0,15%	0,12%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,83%	3,22%	2,08%	4,61%	8,06%	10,08%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,42%	-1,13%	0,41%	1,33%	2,64%	10,28%	1,27%	0,04%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,72%	1,21%	2,05%	3,45%	15,85%	1,14%	0,02%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	1,51%	1,89%	3,06%	7,77%	16,46%	0,98%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	1,85%	2,25%	3,53%	7,95%	16,84%	1,07%	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
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,67%	7,48%	4,70%	9,88%	19,35%	34,31%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-1,41%	2,71%	-1,67%	2,73%	-	-	-	0,04%
<b>IBX (Benchmark)</b>	5,92%	8,14%	15,50%	18,03%	47,63%	34,45%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	4,72%	0,92%	12,76%	8,49%	34,30%	36,90%	8,18%	0,23%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	6,16%	6,05%	14,70%	15,91%	44,41%	30,08%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,94%	6,53%	15,41%	14,27%	34,98%	26,76%	5,41%	0,21%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,05%	5,67%	12,42%	10,53%	21,00%	21,09%	6,86%	0,17%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5,18%	5,39%	11,62%	14,72%	44,11%	28,07%	8,73%	0,21%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	4,54%	9,71%	16,73%	17,01%	53,42%	51,64%	6,15%	0,21%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4,36%	12,04%	19,72%	19,08%	38,06%	40,95%	6,61%	0,22%
MULTINVEST FI AÇÕES	6,50%	7,43%	12,78%	15,80%	41,28%	35,91%	7,38%	0,22%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,73%	8,79%	17,41%	21,14%	41,58%	41,77%	7,46%	0,24%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,88%	46,12%	37,69%	62,66%	-	-	7,93%	-
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,27%	0,97%	0,68%	1,13%	2,18%	7,16%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

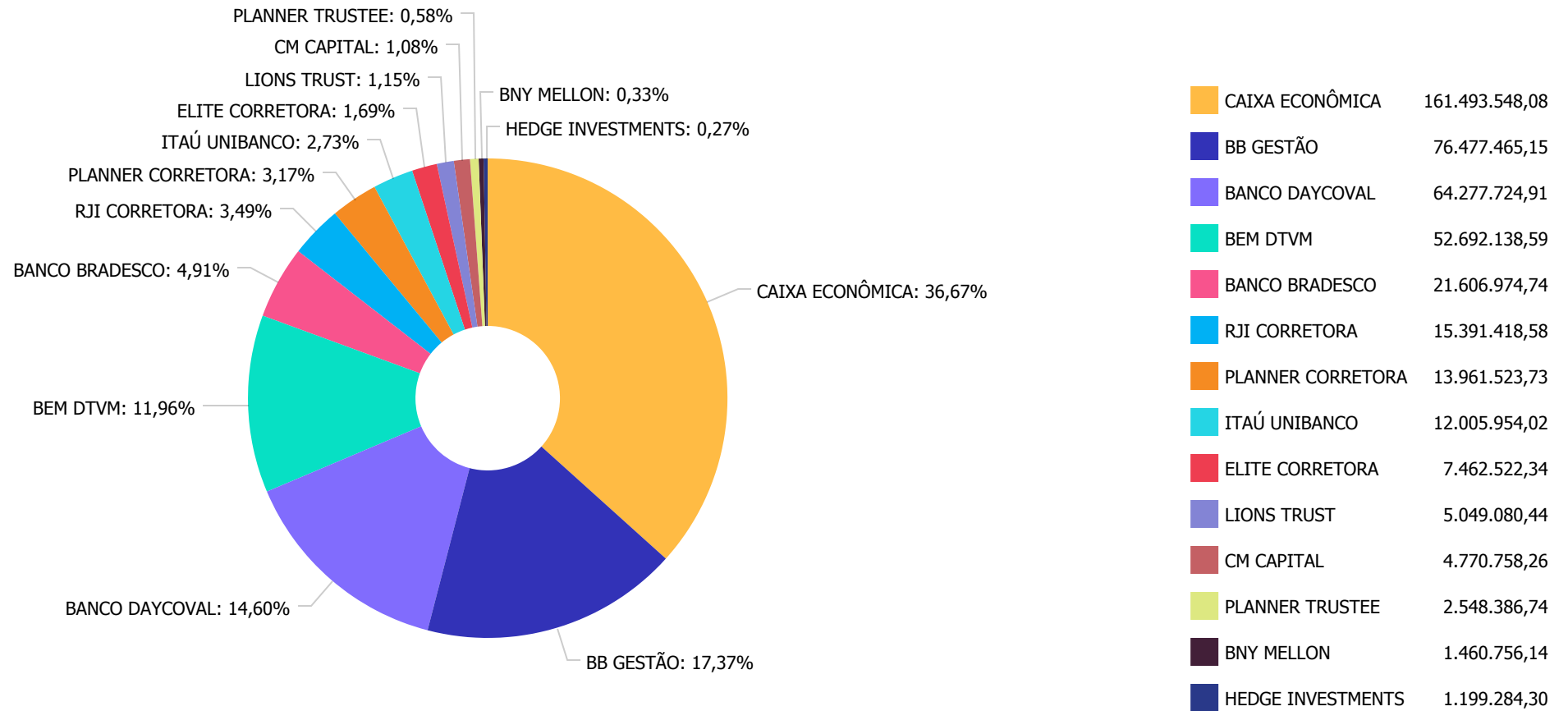
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,11%	0,18%	-0,37%	0,08%	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-0,13%	-0,71%	-0,71%	-2,75%	-3,49%	-	0,00%	0,00%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-1,69%	-7,26%	-4,50%	-4,18%	-1,01%	-22,90%	5,29%	0,11%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	5,33%	12,86%	19,70%	0,00%	14,49%	-46,98%	50,63%	0,61%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,39%	13,10%	10,32%	16,56%	37,34%	52,31%	7,04%	0,15%

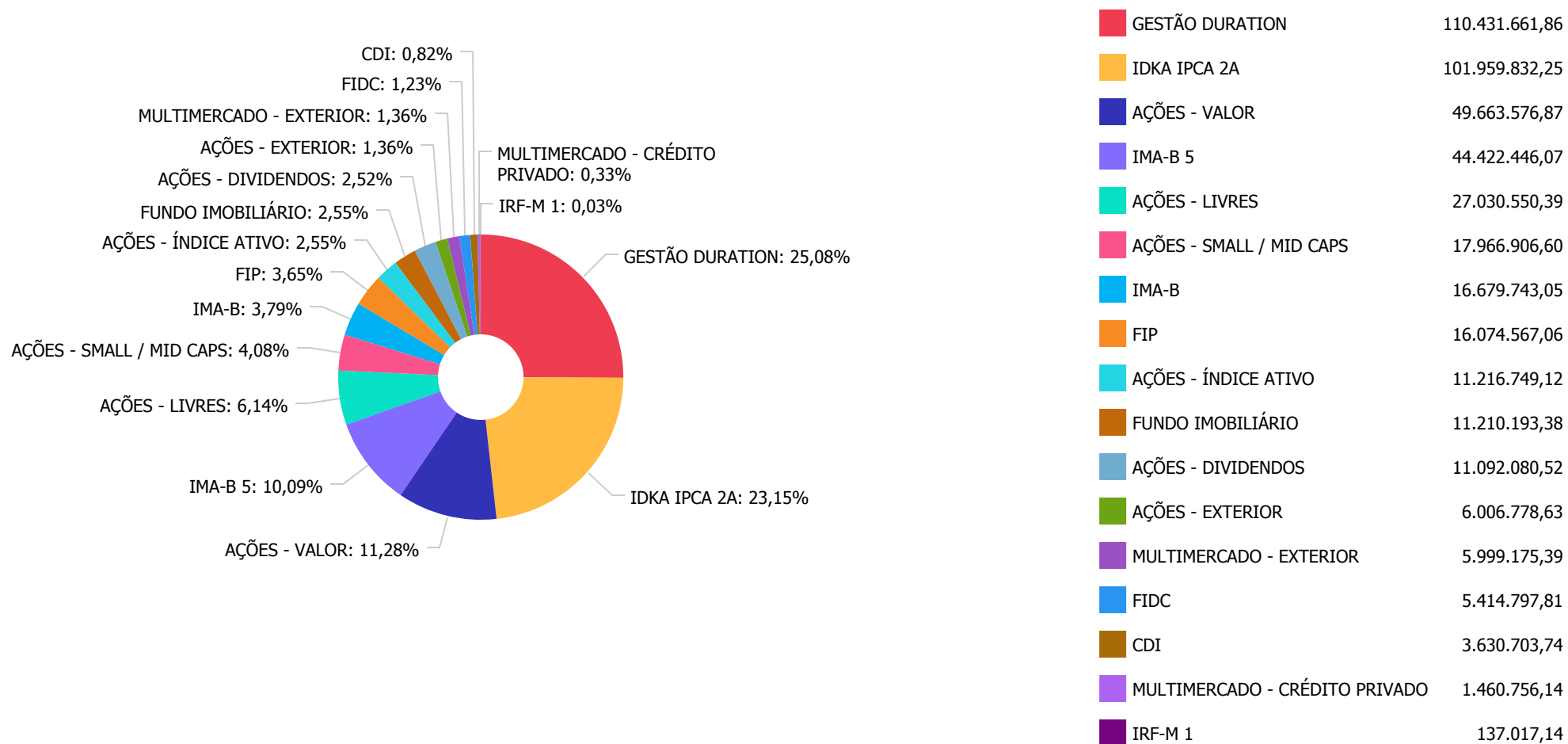
## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-1,85%	12,72%	2,34%	13,98%	37,36%	98,06%	6,16%	0,13%

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



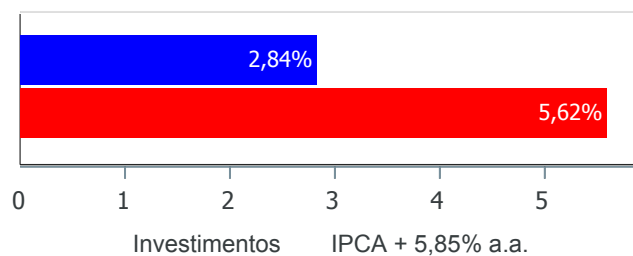
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2021)



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	437.049.080,79	413.240,53	8.625.466,75	425.617.909,15	-3.218.945,42	-3.218.945,42	-0,74%	-0,74%	0,70%	0,70%	-104,71%	3,83%
Fevereiro	425.617.909,15	21.458.736,18	18.714.783,26	423.897.098,89	-4.464.763,18	-7.683.708,60	-1,04%	-1,77%	1,27%	1,98%	-89,33%	3,59%
Março	423.897.098,89	5.504.014,17	6.606.144,52	428.837.352,85	6.042.384,31	-1.641.324,29	1,43%	-0,37%	1,46%	3,47%	-10,70%	4,02%
Abril	428.837.352,85	31.058.143,66	32.109.520,27	434.552.678,39	6.766.702,15	5.125.377,86	1,58%	1,20%	0,76%	4,26%	28,22%	2,61%
Maio	434.552.678,39	26.363.579,13	27.568.157,51	440.397.536,02	7.049.436,01	12.174.813,87	1,62%	2,84%	1,31%	5,62%	50,57%	3,44%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



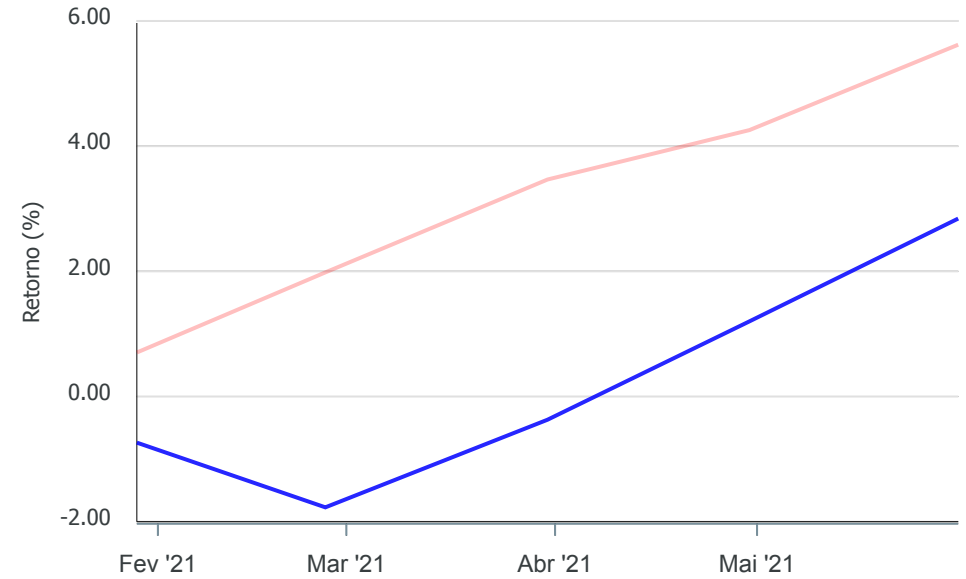
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	3.591.684,69	0,00	0,00	3.630.703,74	39.019,05	1,09%	1,09%	0,15%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.461.200,26	0,00	0,00	15.624.278,40	163.078,14	1,05%	1,05%	2,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.044.573,71	0,00	0,00	1.055.464,65	10.890,94	1,04%	1,04%	2,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.637.833,18	0,00	351.047,93	13.406.501,05	119.715,80	0,88%	0,89%	1,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	67.231.641,38	13.992.529,13	10.359.835,43	71.476.379,17	612.044,09	0,75%	0,84%	1,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.847.794,37	0,00	0,00	16.963.232,62	115.438,25	0,69%	0,69%	1,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	29.998.366,23	351.047,93	68.876,54	30.483.453,08	202.915,46	0,67%	0,67%	0,98%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.935.979,79	0,00	0,00	5.962.881,69	26.901,90	0,45%	0,45%	0,55%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.515.742,36	0,00	0,00	21.606.974,74	91.232,38	0,42%	0,42%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	88.593.160,53	20.002,07	0,00	88.824.687,12	211.524,52	0,24%	0,24%	1,14%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.496.932,06	0,00	0,00	1.499.728,76	2.796,70	0,19%	0,19%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	136.784,29	0,00	0,00	137.017,14	232,85	0,17%	0,17%	0,14%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.477.214,78	0,00	0,00	2.478.760,70	1.545,92	0,06%	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.769.327,97	0,00	0,00	4.770.758,26	1.430,29	0,03%	0,03%	1,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.389.684,00	0,00	3.390.343,15	0,00	659,15	0,02%	0,27%	0,03%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	10.720.261,02	0,00	10.698.085,37	0,00	-22.175,65	-0,21%	0,84%	0,71%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.097.207,81	0,00	0,00	2.936.037,11	-161.170,70	-5,20%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.159.712,29	0,00	0,00	1.819.343,69	-340.368,60	-15,76%	-16,58%	26,55%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>292.105.100,72</b>	<b>14.363.579,13</b>	<b>24.868.188,42</b>	<b>282.676.201,92</b>	<b>1.075.710,49</b>	<b>0,35%</b>		<b>1,33%</b>



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
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.922.075,36	0,00	0,00	7.457.200,55	535.125,19	7,73%	7,73%	7,46%
MULTINVEST FI AÇÕES	12.446.077,67	0,00	0,00	13.254.788,92	808.711,25	6,50%	6,50%	7,38%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	16.969.536,02	0,00	0,00	17.966.906,60	997.370,58	5,88%	5,88%	7,93%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.419.354,50	0,00	5.409,67	2.548.386,74	134.441,91	5,56%	5,33%	50,63%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	10.664.632,27	0,00	0,00	11.216.749,12	552.116,85	5,18%	5,18%	8,73%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.774.365,64	0,00	0,00	8.166.580,02	392.214,38	5,04%	5,04%	6,86%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.569.490,68	0,00	0,00	11.092.080,52	522.589,84	4,94%	4,94%	5,41%
META VALOR FI AÇÕES	20.854.671,31	0,00	0,00	21.839.280,27	984.608,96	4,72%	4,72%	8,18%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.937.413,33	0,00	0,00	14.569.507,68	632.094,35	4,54%	4,54%	6,15%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.929.916,15	0,00	0,00	11.406.769,82	476.853,67	4,36%	4,36%	6,61%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	6.000.000,00	0,00	5.999.175,39	-824,61	-0,01%	0,39%	7,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	2.548.590,96	0,00	2.548.139,26	0,00	-451,70	-0,02%	0,26%	0,15%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.054.805,92	0,00	0,00	5.049.080,44	-5.725,48	-0,11%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	11.182.934,66	0,00	144.024,16	11.025.486,62	-13.423,88	-0,12%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.472.174,80	0,00	0,00	7.462.522,34	-9.652,46	-0,13%	-0,13%	0,00%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.480.297,20	0,00	0,00	1.460.756,14	-19.541,06	-1,32%	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.221.241,20	0,00	2.396,00	1.199.284,30	-19.560,90	-1,60%	-1,69%	5,29%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>142.447.577,67</b>	<b>6.000.000,00</b>	<b>2.699.969,09</b>	<b>151.714.555,47</b>	<b>5.966.946,89</b>	<b>4,09%</b>		<b>7,68%</b>

## 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
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	0,00	6.000.000,00	0,00	6.006.778,63	6.778,63	0,11%	-1,85%	6,16%
<b>Total Exterior</b>	<b>0,00</b>	<b>6.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6.006.778,63</b>	<b>6.778,63</b>	<b>0,11%</b>		<b>6,16%</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.