

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2021)

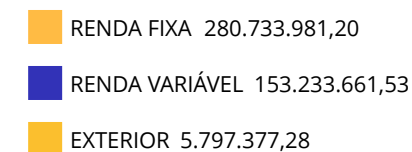
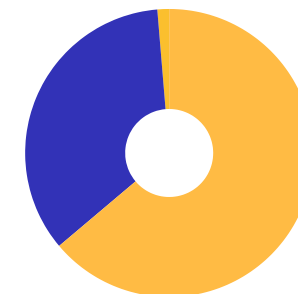
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	30.387.278,07	6,91%	992	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.931.708,00	3,85%	745	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	13.373.037,45	3,04%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	88.827.071,32	20,20%	974	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	70.139.285,06	15,95%	1.044	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.059.700,91	0,24%	883	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	137.275,60	0,03%	1.309	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.686.540,49	3,57%	265	1,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	21.678.481,33	4,93%	196	1,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.679.674,86	0,84%	44	5,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.492.998,16	0,34%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.798.808,45	0,41%	31	1,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	Não há	2.909.717,30	0,66%		18,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.481.671,20	0,56%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	11.112.232,22	2,53%	835	4,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	11.376.866,40	2,59%	5.678	0,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	11.278.002,36	2,56%	901	6,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	14.673.685,55	3,34%	227	10,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	21.482.774,84	4,89%	259	6,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	13.484.864,40	3,07%	284	12,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 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	7.617.138,43	1,73%	2.680	0,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	8.290.373,76	1,89%	2.499	1,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	18.996.762,36	4,32%	18	2,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	1.441.637,06	0,33%		0,00%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.159.867,09	1,40%	1.255	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.040.921,52	1,15%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	11.012.144,20	2,50%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.452.852,88	1,69%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	2.612.902,86	0,59%		0,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.200.635,60	0,27%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+5 du	Não há	5.797.377,28	1,32%	177	1,46%	Artigo 9º, Inciso II
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	4.183.070,27	0,95%	8	10,46%	Desenquadrado - RF
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.967.662,73	1,36%	5	28,95%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			439.765.020,01				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 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%	220.855.356,41	50,22%	9,96%	49,81%	62,26%	52.942.345,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	44.336.503,29	10,08%	3,86%	9,29%	40,00%	131.569.504,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	5.391.388,50	1,23%	0,00%	2,28%	2,28%	4.635.253,96
Desenquadrado - RF	0,00%	10.150.733,00	2,31%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.150.733,00
Total Renda Fixa	100,00%	280.733.981,20	63,84%	13,82%	61,38%	104,54%	



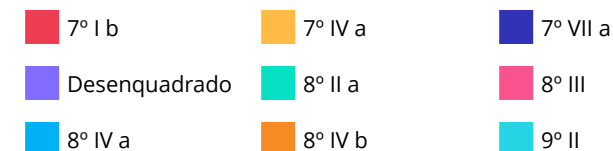
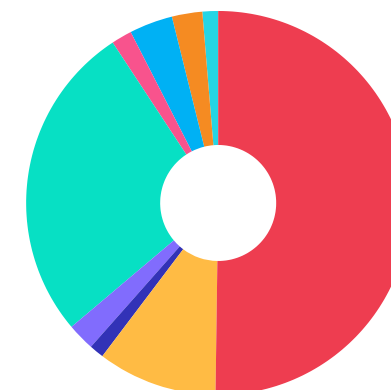
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 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%	118.312.700,32	26,90%	3,58%	17,91%	25,00%	-8.371.445,32
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.601.504,15	1,73%	3,14%	3,14%	10,00%	36.374.997,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	16.053.065,72	3,65%	0,00%	3,91%	5,00%	5.935.185,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	11.266.391,34	2,56%	0,00%	2,80%	5,00%	10.721.859,66
Total Renda Variável	35,00%	153.233.661,53	34,84%	6,72%	27,76%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	5.797.377,28	1,32%	0,00%	0,43%	5,00%	16.190.873,72
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,43%	5,00%	21.988.251,00
Total Exterior	10,00%	5.797.377,28	1,32%	0,00%	0,86%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	160.163.332,89	36,42	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	76.378.564,01	17,37	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	21.678.481,33	4,93	0,00
META ASSET MANAGEMENT	21.482.774,84	4,89	6,22
MULTINVEST CAPITAL	19.452.527,13	4,42	2,10
TRÍGONO CAPITAL	18.996.762,36	4,32	0,72
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	14.673.685,55	3,34	3,10
GRAPHEN INVESTIMENTOS	12.844.241,38	2,92	12,36
ITAÚ UNIBANCO	11.957.244,37	2,72	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	11.376.866,40	2,59	0,56
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	11.278.002,36	2,56	0,18
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	11.112.232,22	2,53	0,32
KPTL	11.012.144,20	2,50	2,10
PERFIN INVESTIMENTOS	8.290.373,76	1,89	0,09
NAVI CAPITAL	7.617.138,43	1,73	0,43
KINEA INVESTIMENTOS	5.040.921,52	1,15	0,00
AURORA CAPITAL	4.183.070,27	0,95	1,04
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.679.674,86	0,84	1,02
ZION INVEST	2.612.902,86	0,59	0,32
PLURAL	1.798.808,45	0,41	0,03
RJI CORRETORA DE VALORES	1.492.998,16	0,34	0,00
CAPITÂNIA	1.441.637,06	0,33	0,01
HEDGE INVESTMENTS	1.200.635,60	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 '	220.855.356,41	50,22	9,96	62,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	44.336.503,29	10,08	3,86	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5.391.388,50	1,23	0,00	2,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	118.312.700,32	26,90	3,58	25,00
Artigo 8º, Inciso III	7.601.504,15	1,73	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	16.053.065,72	3,65	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	11.266.391,34	2,56	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	5.797.377,28	1,32	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,18%	7,74%	3,62%	7,74%	16,98%	29,07%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-	-	-	-	-	-	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,32%	1,87%	1,91%	1,87%	7,06%	16,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,28%	1,56%	1,59%	1,56%	6,40%	15,12%	1,53%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,10%	7,25%	3,39%	7,25%	15,90%	26,69%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,12%	-2,10%	0,50%	-2,10%	-3,88%	-7,96%	-	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,21%	0,81%	0,68%	0,81%	2,04%	8,17%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,19%	0,70%	0,64%	0,70%	1,82%	7,71%	0,16%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,13%	1,29%	1,44%	1,29%	6,07%	15,42%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,15%	-23,56%	-16,90%	-23,56%	-66,87%	-75,85%	0,21%	0,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,19%	1,17%	1,37%	1,17%	5,78%	14,87%	1,55%	0,02%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-12,32%	-3,55%	-12,11%	-3,55%	1,03%	7,34%	20,12%	0,17%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,45%	-0,75%	-0,10%	-0,75%	-23,82%	-36,67%	0,72%	0,22%
IMA-B (Benchmark)	0,42%	-0,72%	2,14%	-0,72%	7,42%	12,74%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	-0,83%	2,12%	-0,83%	7,12%	11,94%	2,44%	0,08%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,40%	-0,84%	2,09%	-0,84%	7,19%	12,04%	2,43%	0,08%
IRF-M (Benchmark)	0,21%	-1,58%	1,26%	-1,58%	0,14%	9,97%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,08%	1,50%	0,77%	1,50%	3,76%	2,13%	0,70%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,35%	5,81%	3,30%	5,81%	12,46%	16,94%	0,26%	0,12%
IPCA (Benchmark)	0,53%	3,77%	1,68%	3,77%	8,35%	10,66%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,25%	1,43%	1,62%	1,43%	5,94%	16,72%	1,46%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,00%	0,72%	0,90%	0,72%	2,68%	12,77%	0,97%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,33%	-0,80%	1,29%	-0,80%	2,01%	8,38%	1,16%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	1,42%	1,42%	1,42%	6,38%	15,08%	1,36%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,37%	8,95%	4,21%	8,95%	19,68%	35,11%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,12%	2,59%	-1,65%	2,59%	1,65%	-	-	-

IBX (Benchmark)	0,63%	8,82%	9,61%	8,82%	36,33%	29,97%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-1,63%	-0,72%	4,25%	-0,72%	19,22%	27,17%	5,83%	0,22%

Ibovespa (Benchmark)	0,46%	6,54%	8,72%	6,54%	33,40%	25,59%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,18%	6,72%	7,43%	6,72%	24,15%	20,41%	5,94%	0,20%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,52%	7,27%	8,80%	7,27%	13,69%	18,25%	4,88%	0,15%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,55%	5,97%	9,13%	5,97%	31,77%	24,11%	4,21%	0,20%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,72%	10,50%	9,61%	10,50%	38,76%	46,37%	6,40%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-0,26%	11,75%	9,57%	11,75%	28,69%	33,70%	5,76%	0,22%
MULTINVEST FI AÇÕES	1,74%	9,29%	10,01%	9,29%	30,47%	33,41%	4,67%	0,21%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,15%	11,12%	13,64%	11,12%	33,53%	38,55%	5,45%	0,23%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,73%	54,50%	30,58%	54,50%	89,65%	-	8,75%	0,21%

CDI (Benchmark)	0,31%	1,28%	0,79%	1,28%	2,28%	6,98%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-	-	-	-	-	-

IFIX (Benchmark)	-2,19%	-4,02%	-3,23%	-4,02%	-1,83%	4,90%	-	-
-------------------------	--------	--------	--------	--------	--------	-------	---	---

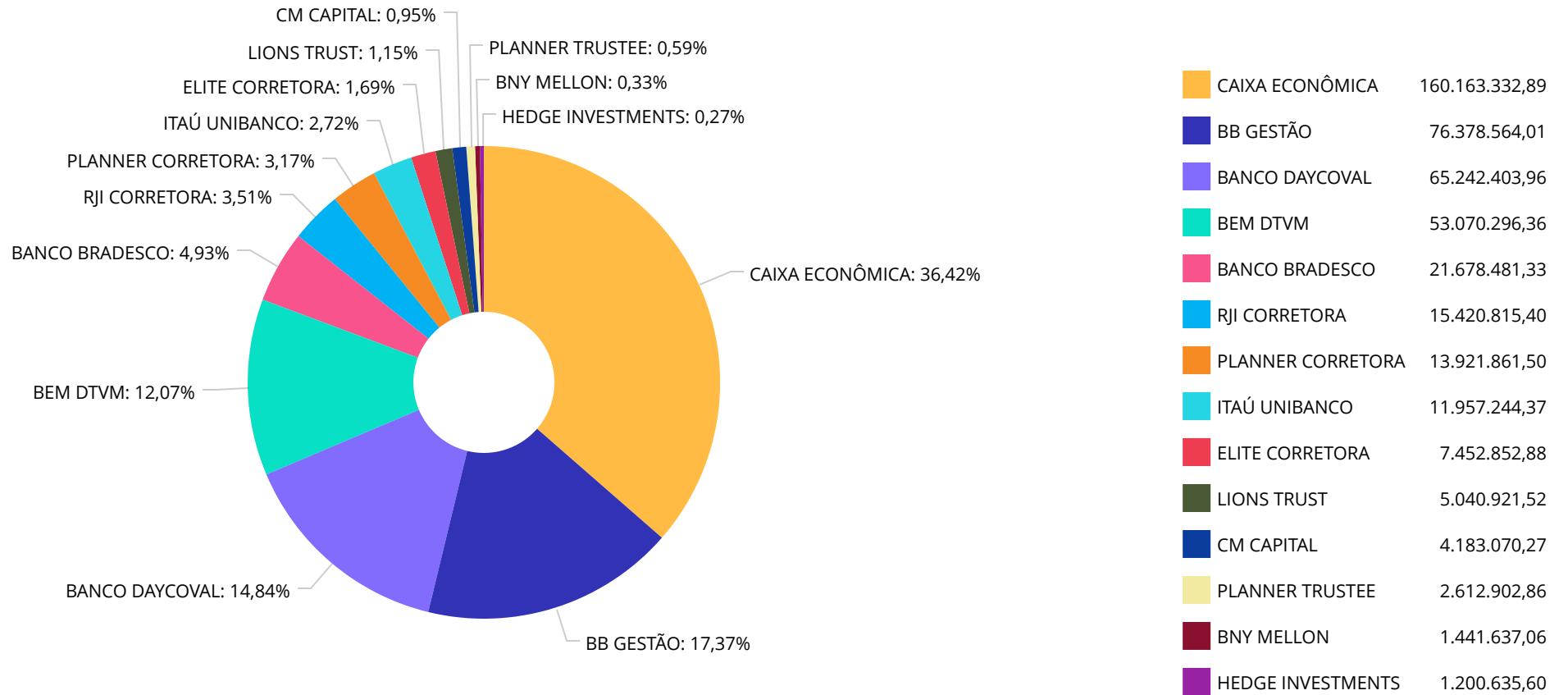
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	0,20%	-7,07%	-1,06%	-7,07%	-6,37%	-22,12%	6,10%	0,09%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,53%	15,71%	50,00%	15,71%	14,09%	-54,75%	30,23%	0,61%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,16%	0,01%	-0,40%	0,01%	-13,68%	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-0,13%	-0,83%	-0,40%	-0,83%	-3,50%	-	0,00%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2,68%	16,13%	8,75%	16,13%	39,42%	45,94%	4,67%	0,15%

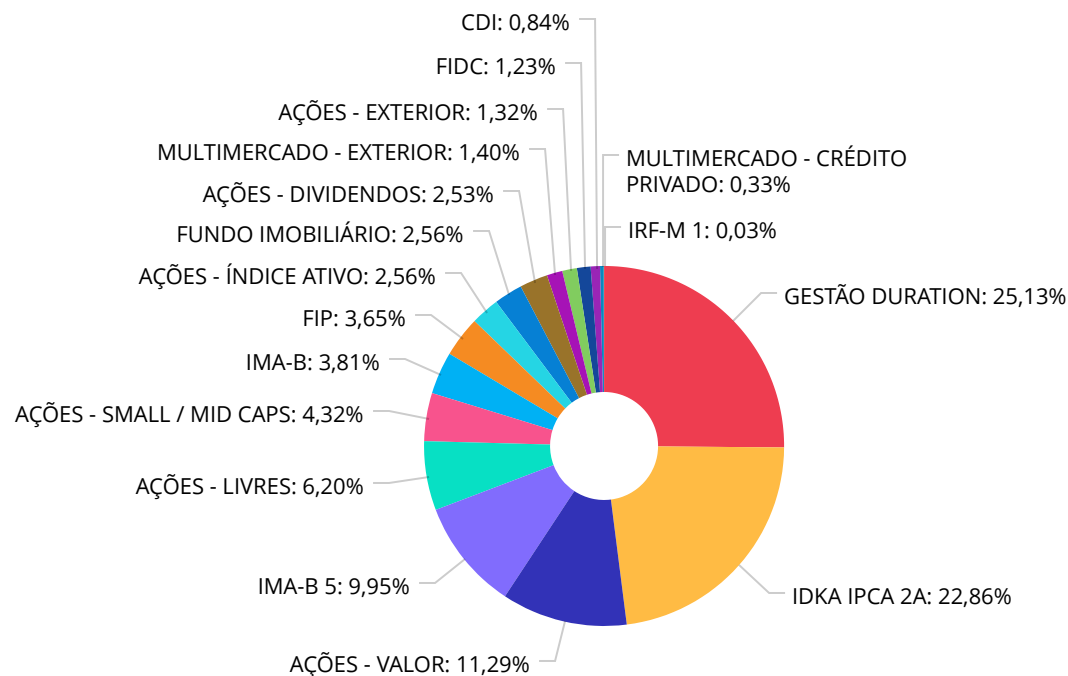
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	-3,06%	7,96%	-5,78%	7,96%	25,18%	80,80%	-	-
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-3,49%	8,79%	-5,07%	8,79%	27,79%	84,26%	5,91%	0,15%

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



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

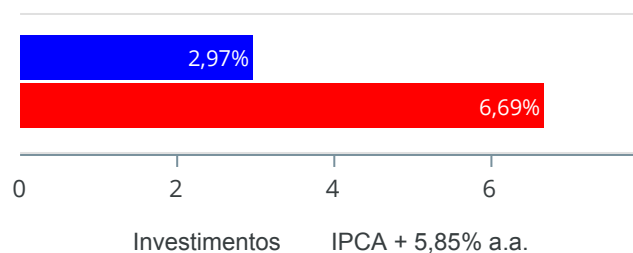


GESTÃO DURATION	110.505.552,65
IDKA IPCA 2A	100.526.563,13
AÇÕES - VALOR	49.641.324,79
IMA-B 5	43.747.285,06
AÇÕES - LIVRES	27.284.378,59
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	18.996.762,36
IMA-B	16.746.241,40
FIP	16.053.065,72
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.278.002,36
FUNDO IMOBILIÁRIO	11.266.391,34
AÇÕES - DIVIDENDOS	11.112.232,22
MULTIMERCADO - EXTERIOR	6.159.867,09
AÇÕES - EXTERIOR	5.797.377,28
FIDC	5.391.388,50
CDI	3.679.674,86
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	1.441.637,06
IRF-M 1	137.275,60

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%
Mai	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%
Junho	440.397.536,02	3.238.163,55	4.433.483,91	439.765.020,01	562.804,35	12.737.618,22	0,13%	2,97%	1,01%	6,69%	44,49%	3,11%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



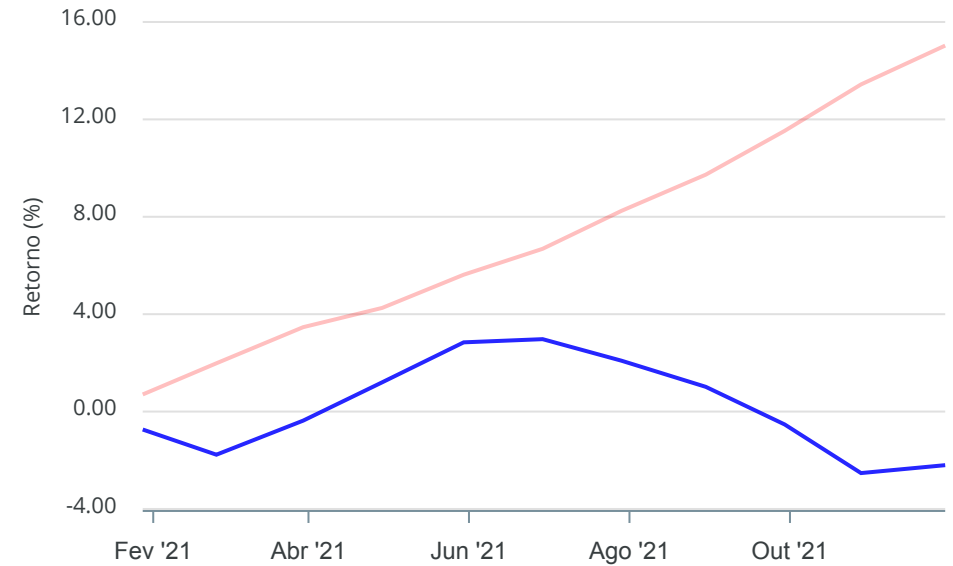
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Junho/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	3.630.703,74	0,00	0,00	3.679.674,86	48.971,12	1,35%	1,35%	0,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.055.464,65	0,00	0,00	1.059.700,91	4.236,26	0,40%	0,40%	2,43%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.624.278,40	0,00	0,00	15.686.540,49	62.262,09	0,40%	0,40%	2,44%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.606.974,74	0,00	0,00	21.678.481,33	71.506,59	0,33%	0,33%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	137.017,14	0,00	0,00	137.275,60	258,46	0,19%	0,19%	0,16%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.478.760,70	0,00	0,00	2.481.671,20	2.910,50	0,12%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.962.881,69	0,00	0,00	5.967.662,73	4.781,04	0,08%	0,08%	0,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	88.824.687,12	5.065,97	0,00	88.827.071,32	-2.681,77	0,00%	0,00%	0,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	30.483.453,08	0,00	67.670,39	30.387.278,07	-28.504,62	-0,09%	-0,09%	1,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.963.232,62	0,00	0,00	16.931.708,00	-31.524,62	-0,19%	-0,19%	1,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.406.501,05	0,00	0,00	13.373.037,45	-33.463,60	-0,25%	-0,25%	1,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	71.476.379,17	3.233.097,58	4.363.717,02	70.139.285,06	-206.474,67	-0,28%	-0,28%	1,53%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.499.728,76	0,00	0,00	1.492.998,16	-6.730,60	-0,45%	-0,45%	0,72%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.936.037,11	0,00	0,00	2.909.717,30	-26.319,81	-0,90%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.819.343,69	0,00	0,00	1.798.808,45	-20.535,24	-1,13%	-0,15%	0,21%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.770.758,26	0,00	0,00	4.183.070,27	-587.687,99	-12,32%	-12,32%	20,12%
Total Renda Fixa	282.676.201,92	3.238.163,55	4.431.387,41	280.733.981,20	-748.996,86	-0,26%		1,59%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	17.966.906,60	0,00	0,00	18.996.762,36	1.029.855,76	5,73%	5,73%	8,75%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5.999.175,39	0,00	0,00	6.159.867,09	160.691,70	2,68%	2,68%	4,67%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.548.386,74	0,00	0,00	2.612.902,86	64.516,12	2,53%	2,53%	30,23%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.457.200,55	0,00	0,00	7.617.138,43	159.937,88	2,14%	2,14%	5,45%
MULTINVEST FI AÇÕES	13.254.788,92	0,00	0,00	13.484.864,40	230.075,48	1,74%	1,74%	4,67%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.166.580,02	0,00	0,00	8.290.373,76	123.793,74	1,52%	1,52%	4,88%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	14.569.507,68	0,00	0,00	14.673.685,55	104.177,87	0,72%	0,72%	6,40%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	11.216.749,12	0,00	0,00	11.278.002,36	61.253,24	0,55%	0,55%	4,21%
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.199.284,30	0,00	2.096,50	1.200.635,60	3.447,80	0,29%	0,19%	6,10%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	11.092.080,52	0,00	0,00	11.112.232,22	20.151,70	0,18%	0,18%	5,94%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	11.025.486,62	0,00	0,00	11.012.144,20	-13.342,42	-0,12%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.462.522,34	0,00	0,00	7.452.852,88	-9.669,46	-0,13%	-0,13%	0,00%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.049.080,44	0,00	0,00	5.040.921,52	-8.158,92	-0,16%	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	11.406.769,82	0,00	0,00	11.376.866,40	-29.903,42	-0,26%	-0,26%	5,76%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.460.756,14	0,00	0,00	1.441.637,06	-19.119,08	-1,31%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	21.839.280,27	0,00	0,00	21.482.774,84	-356.505,43	-1,63%	-1,63%	5,83%
Total Renda Variável	151.714.555,47	0,00	2.096,50	153.233.661,53	1.521.202,56	1,00%		6,08%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Junho / 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...	6.006.778,63	0,00	0,00	5.797.377,28	-209.401,35	-3,49%	-3,49%	5,91%
Total Exterior	6.006.778,63	0,00	0,00	5.797.377,28	-209.401,35	-3,49%		5,91%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	39.997.510,62	48.283.770,37	18.981.352,57	70.139.285,06	839.356,64	0,95%	1,59%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	88.008.320,52	25.068,04	0,00	88.827.071,32	793.682,76	0,90%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	29.816.918,57	351.047,93	205.525,77	30.387.278,07	424.837,34	1,41%	1,42%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.360.778,51	0,00	0,00	15.686.540,49	325.761,98	2,12%	2,12%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.401.681,11	0,00	0,00	21.678.481,33	276.800,22	1,29%	1,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.702.895,67	0,00	0,00	16.931.708,00	228.812,33	1,37%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.506.730,95	0,00	351.047,93	13.373.037,45	217.354,43	1,61%	1,62%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	17.767.283,24	0,00	14.303.907,60	3.679.674,86	216.299,22	1,22%	3,30%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.391.176,80	0,00	13.466.701,11	1.059.700,91	135.225,22	0,94%	2,09%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	10.608.318,94	0,00	10.698.085,37	0,00	89.766,43	0,85%	3,46%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.921.863,22	0,00	0,00	5.967.662,73	45.799,51	0,77%	0,77%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.469.430,56	0,00	0,00	2.481.671,20	12.240,64	0,50%	0,50%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.386.046,18	0,00	3.390.343,15	0,00	4.296,97	0,13%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	136.399,05	0,00	0,00	137.275,60	876,55	0,64%	0,64%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.494.509,14	0,00	0,00	1.492.998,16	-1.510,98	-0,10%	-0,10%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.164.729,34	0,00	0,00	1.798.808,45	-365.920,89	-16,90%	-16,90%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.759.332,45	0,00	0,00	4.183.070,27	-576.262,18	-12,11%	-12,11%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	4.056.818,60	0,00	0,00	2.909.717,30	-1.147.101,30	-28,28%	-100,00%
Total Renda Fixa					1.520.314,89	0,45%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.548.515,32	0,00	0,00	18.996.762,36	4.448.247,04	30,58%	30,58%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.386.741,46	0,00	0,00	14.673.685,55	1.286.944,09	9,61%	9,61%
MULTINVEST FI AÇÕES	12.257.492,80	0,00	0,00	13.484.864,40	1.227.371,60	10,01%	10,01%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.382.829,30	0,00	0,00	11.376.866,40	994.037,10	9,57%	9,57%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	10.334.479,51	0,00	0,00	11.278.002,36	943.522,85	9,13%	9,13%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.702.997,38	0,00	0,00	7.617.138,43	914.141,05	13,64%	13,64%
META VALOR FI AÇÕES	20.606.119,70	0,00	0,00	21.482.774,84	876.655,14	4,25%	4,25%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.741.935,24	0,00	5.409,67	2.612.902,86	876.377,29	50,31%	50,00%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.344.149,42	0,00	0,00	11.112.232,22	768.082,80	7,43%	7,43%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.619.619,70	0,00	0,00	8.290.373,76	670.754,06	8,80%	8,80%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	6.000.000,00	0,00	6.159.867,09	159.867,09	2,66%	8,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	2.543.473,09	0,00	2.548.139,26	0,00	4.666,17	0,18%	0,85%
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.215.670,50	0,00	6.888,50	1.200.635,60	-8.146,40	-0,67%	-1,06%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.461.374,40	0,00	9.736,60	1.441.637,06	-10.000,74	-0,68%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.061.268,40	0,00	0,00	5.040.921,52	-20.346,88	-0,40%	-0,40%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.483.013,12	0,00	0,00	7.452.852,88	-30.160,24	-0,40%	-0,40%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	11.196.930,04	0,00	144.024,16	11.012.144,20	-40.761,68	-0,36%	-1,65%
				Total Renda Variável	13.061.250,34	9,32%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	0,00	6.000.000,00	0,00	5.797.377,28	-202.622,72	-3,38%	-5,07%
				Total Exterior	-202.622,72	-3,38%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	32.638.133,89	64.534.254,59	27.833.250,57	70.139.285,06	800.147,15	0,82%	1,56%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	17.345.922,03	0,00	14.303.907,60	3.679.674,86	637.660,43	3,68%	5,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	82.657.100,96	11.048.662,93	5.505.127,85	88.827.071,32	626.435,28	0,67%	0,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	32.152.038,24	351.047,93	2.543.208,13	30.387.278,07	427.400,03	1,31%	1,42%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	10.398.069,91	0,00	10.698.085,37	0,00	300.015,46	2,89%	5,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.736.162,61	0,00	0,00	16.931.708,00	195.545,39	1,17%	1,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.532.003,27	0,00	351.047,93	13.373.037,45	192.082,11	1,42%	1,43%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.879.677,65	0,00	0,00	5.967.662,73	87.985,08	1,50%	1,50%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2.255.564,51	0,00	2.299.491,34	0,00	43.926,83	1,95%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.374.618,31	0,00	3.390.343,15	0,00	15.724,84	0,47%	1,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	136.327,52	0,00	0,00	137.275,60	948,08	0,70%	0,70%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.504.281,11	0,00	0,00	1.492.998,16	-11.282,95	-0,75%	-0,75%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.534.963,18	0,00	0,00	2.481.671,20	-53.291,98	-2,10%	-2,10%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.817.903,28	0,00	0,00	15.686.540,49	-131.362,79	-0,83%	-0,83%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.336.908,86	0,00	0,00	4.183.070,27	-153.838,59	-3,55%	-3,55%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.595.170,21	0,00	9.433.490,14	0,00	-161.680,07	-1,69%	-0,86%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	25.884.925,62	0,00	4.000.000,00	21.678.481,33	-206.444,29	-0,80%	-0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.815.337,53	0,00	13.466.701,11	1.059.700,91	-288.935,51	-1,95%	-0,84%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.353.345,81	0,00	196.833,60	1.798.808,45	-357.703,76	-15,20%	-23,56%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	5.105.118,29	0,00	0,00	2.909.717,30	-2.195.400,99	-43,00%	-100,00%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Fixa	-232.070,25	-0,06%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.295.775,72	0,00	0,00	18.996.762,36	6.700.986,64	54,50%	54,50%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.279.644,53	0,00	0,00	14.673.685,55	1.394.041,02	10,50%	10,50%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.180.707,48	0,00	0,00	11.376.866,40	1.196.158,92	11,75%	11,75%
MULTINVEST FI AÇÕES	12.338.276,31	0,00	0,00	13.484.864,40	1.146.588,09	9,29%	9,29%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.854.952,86	0,00	0,00	7.617.138,43	762.185,57	11,12%	11,12%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.412.081,55	0,00	0,00	11.112.232,22	700.150,67	6,72%	6,72%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	10.642.848,84	0,00	0,00	11.278.002,36	635.153,52	5,97%	5,97%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.728.770,78	0,00	0,00	8.290.373,76	561.602,98	7,27%	7,27%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.258.064,20	0,00	5.409,67	2.612.902,86	360.248,33	15,95%	15,71%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	6.000.000,00	0,00	6.159.867,09	159.867,09	2,66%	16,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.840.491,66	0,00	3.856.472,50	0,00	15.980,84	0,42%	1,23%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.489.844,20	0,00	9.736,60	1.441.637,06	-38.470,54	-2,58%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	4.982.385,10	101.911,77	0,00	5.040.921,52	-43.375,35	-0,85%	0,01%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.515.471,54	0,00	0,00	7.452.852,88	-62.618,66	-0,83%	-0,83%
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.299.470,60	0,00	20.426,50	1.200.635,60	-78.408,50	-6,03%	-7,07%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	11.237.325,46	0,00	144.024,16	11.012.144,20	-81.157,10	-0,72%	2,59%
META VALOR FI AÇÕES	21.639.397,17	0,00	0,00	21.482.774,84	-156.622,33	-0,72%	-0,72%
Total Renda Variável					13.172.311,19	9,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	0,00	6.000.000,00	0,00	5.797.377,28	-202.622,72	-3,38%	8,79%
				Total Exterior	-202.622,72	-3,38%	

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.