



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

29/09/2021 – Comitê de Investimentos

Ata da Reunião do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU, realizada aos vinte e nove dias do mês de setembro de dois mil e vinte e um, às oito horas. Reunião realizada de forma híbrida, por videoconferência, através do aplicativo Zoom (ID 889 2808 7477/ Senha 284345), devido à pandemia do Covid-19 e às orientações da Organização Mundial de Saúde e dos Governos Federal e Estadual e presencial na sede no IPMU. Participantes: Comitê de Investimentos (Fernando Augusto Matsumoto, Flavio Bellard Gomes, Lucas Gustavo Ferreira Castanho, Marcelo da Cruz Lima e Sirleide da Silva) e Controlador Interno (Wellington Diniz). Aberta a reunião os membros do Comitê de Investimentos passaram a analisar o **Relatório Financeiro** referente ao mês de **agosto/2021**, conforme processo **IPMU/142/2021**. Análise conjuntural de mercado econômico, mercado financeiro e monitoramento das variáveis macroeconômicas. Avaliação mensal de risco de mercado da carteira de Investimentos. Análise de relatório de rentabilidade dos fundos de investimentos e acompanhamento da Política Anual de Investimentos – 2021. Informações dos acontecimentos políticos e econômicos e seus impactos na carteira de investimentos do IPMU. Visão de curto, médio e longo prazo. Balancete de Receita e Despesa que contém os dados atualizados da previsão e da execução orçamentária. Relatório de Execução Orçamentária com os fluxos de caixa das receitas e despesas para avaliação da situação financeira e orçamentária. Cenário **Macroeconômico**. Apesar do surgimento de novas cepas da covid-19 (como a variante Delta), os países com processo de vacinação adiantado têm apresentado um quadro de declínio no número de internações e óbitos. No Brasil o cenário não é diferente e o ritmo de vacinação tem acelerado por aqui. Em que pese o quadro mais positivo no que se refere à pandemia, que por sua vez leva a abertura dos mercados, mantêm-se as preocupações com relação ao contexto político e fiscal e inflação mais pressionada, o que trouxe volatilidade para o mercado no mês de agosto. A incerteza gerada pelas preocupações com o Covid-19, abertura dos mercados e o cenário de eleições no próximo ano, fizeram com que tivéssemos um mês difícil, com impacto nas curvas de juros e bolsa local principalmente. O aceno do governo sobre um possível aumento nos gastos trazem incertezas para o cenário fiscal, impactando fortemente as curvas de juros apesar das expectativas mais positivas no que se refere à Dívida Bruta para 2021. Na renda variável local as incertezas sobre inflação, crise hídrica e cenário político conturbado continuam trazendo impactos negativos, resultando em mais um mês de variação negativa no Ibovespa. Na política monetária, o Banco Central deve continuar subindo os juros. Dado o contexto macroeconômico e as aberturas ainda maiores nas curvas de juros, o mês de agosto foi ruim para a estratégia em renda fixa, aumentando ainda mais os prêmios em toda curva, em especial nos vértices mais longos atrelados ao IMA-B, mantendo-se cenário de bastante volatilidade no curto prazo. No cenário externo, apesar dos riscos inflacionários globais e um



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

menor crescimento na China, o PIB Global deve apresentar um bom crescimento em 2021, face aos estímulos e maior abertura dos mercados nas principais economias do mundo. **Carteira de Investimentos.** No oitavo mês de 2021, os investimentos do IPMU apresentaram desvalorização, refletindo a instabilidade dos mercados financeiros no período. A carteira de investimentos encerrou em R\$ 418.376.432,74 (quatrocentos e dezoito milhões trezentos e setenta e seis mil quatrocentos e trinta e dois reais e setenta e quatro centavos). **Composição dos Investimentos.** A Carteira de Investimentos do IPMU no encerramento do mês é composta por 17 fundos de investimentos e Carteira de Títulos Públicos com vencimento para 2024. Está segregada entre os segmentos de renda fixa (82,74%), renda variável (8,67%) e alocação no exterior (8,59%), dentro dos limites permitidos pela Resolução CMN nº 3922/2010 e suas alterações, compatível com os requisitos estabelecidos na Política de Investimentos – PAI 2021. **Enquadramento.** Todos os investimentos do IPMU estão aderentes com relação à Resolução CMN 3922/2010 e suas alterações e com a Política de Investimentos para o exercício de 2021. **Meta Atuarial.** A rentabilidade consolidada no fechamento do período de janeiro/agosto foi negativa em (-0,48%) muito distante da meta atuarial (INPC + 5,41% a.a.) que encerrou o período em 9,70%. **Relatório de Risco:** Na análise do relatório de risco do mês, a demonstração apresentou os seguintes resultados: Renda Fixa (1,884%/VaR), Fundos de Renda Variável (10,173%/VaR), Fundos no Exterior (5,9583%/VaR) e Total da Carteira (1,935%/VaR). As planilhas de correlação, junto aos riscos apresentados por segmentos e o risco total da carteira do IPMU, estão em conformidade a nossa Política de Investimentos 2021. **Deliberação do Comitê de Investimentos.** A postura conservadora nos investimentos do IPMU não tem gerado resultados satisfatórios nos últimos meses. O atual cenário ainda é incerto e com volatilidade. Com base nos dados técnicos, análises financeiras e propostas de investimentos e desinvestimentos foram aprovadas por unanimidade as estratégias de investimentos, para alteração pontual da carteira de investimentos, em especial a continuidade da estratégia de aplicação em fundos de renda variável em bolsa local considerando que os investimentos no exterior (boa perspectiva para os investimentos no exterior pelo potencial retorno, menor volatilidade e, principalmente, pelo equilíbrio que esses investimentos trazem para a carteira dos RPPS) está no limite prudencial de aplicação para atendimento à legislação. **1) Fundos de renda variável:** acompanhamento do mercado e aplicação, quando favorável e de forma gradativa, dos repasses das contribuições previdenciárias, compensação previdenciária e parcelamento da dívida previdenciária, nos fundos credenciados. **2) Fundos de renda fixa:** acompanhamento do mercado e aplicação, quando favorável e de forma gradativa, dos repasses das contribuições previdenciárias, compensação previdenciária e parcelamento da dívida previdenciária, nos fundos credenciados em especial nos fundos híbridos do Itaú e do Banco Santander que já fazem parte da Carteira de Investimentos. **3) Folha de Pagamento:** para cobertura da folha de pagamento, realizar resgate



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

do fundo de investimentos Santander Renda Fixa Ativa (CNPJ 26.507.132/0001-06). **4) Fundo IMA-B:** acompanhamento do mercado e resgatar, quando favorável e de forma gradativa, para aplicação nos fundos credenciados em especial nos fundos híbridos do Itaú e do Banco Santander que já fazem parte da Carteira de Investimentos. **5) Reunião com Gestores:** agendar reuniões virtuais com os gestores da Carteira de Investimentos. **6) Manutenção das aplicações,** sem realizar realocação de recursos. Nada mais havendo a tratar, foi encerrada a reunião e para que conste, eu, Fernando Augusto Matsumoto, que secretariei os trabalhos, lavrei a presente ata que após lida e aprovada, vai por mim assinada, e pelos demais.

Fernando Augusto Matsumoto
Diretor Financeiro IPMU
Certificação - Anbima CPA 10

Flávio Bellard Gomes
Membro Comitê de Investimentos
Certificação - Anbima CPA 10

Lucas Gustavo Ferreira Castanho
Membro Comitê de Investimentos
Certificação – CGRPPS

Marcelo da Cruz Lima
Membro do Comitê de Investimentos
Certificação - Anbima CPA 10

Sirleide da Silva
Presidente do IPMU
Certificação - Anbima CPA 10

Wellington Diniz
Controlador Interno

Comitê de Investimentos

Reunião Ordinária

29/09/2021



Processo IPMU/142/2021

Agosto foi um mês positivo para as bolsas da maioria dos mercados mundiais. A bolsa brasileira foi uma exceção negativa.

- O país passa por uma discussão fiscal relevante, envolvendo o pagamento de precatórios bilionários, o surgimento de fundos sociais, novos auxílios emergenciais e o novo Bolsa Família.
- Ao mesmo tempo, pressões inflacionárias vêm se mostrando mais persistentes.



Relatório Financeiro
Agosto/2021
IPMU/142/2021



CENÁRIO MACROECONÔMICO

A queda do Ibovespa foi liderada por empresas de varejo e transportes (por exemplo, locadoras de veículos e distribuidoras de combustíveis). Do lado positivo, empresas dos setores de telecomunicações e eletricidade fecharam o mês em alta, junto com as empresas de papel e celulose.

Apesar da alta de aproximadamente 2% das bolsas de países desenvolvidos, o Ibovespa fechou em queda, influenciado principalmente por ruídos políticos e incerteza fiscal.



CENÁRIO MACROECONÔMICO

- O atual **problema nas cadeias de suprimento causado pelo coronavírus se somou à crise hídrica** que se intensificou nos últimos meses.

- Com o Banco Central menos tolerante à alta da inflação, **a curva de juros brasileira sofreu uma grande correção** afetando também a bolsa local.



CENÁRIO MACROECONÔMICO

As preocupações dos agentes de mercado com o compromisso fiscal do governo acabaram impactando negativamente o mercado de renda fixa local ao longo do mês de agosto. A tese de que os elevados riscos fiscais geram uma assimetria de alta no balanço de riscos para a inflação, de forma a exigir que a política monetária se torne ainda mais restritiva, fez com que as taxas de juros de longo prazo voltassem a romper a barreira dos dois dígitos novamente.

O cenário inflacionário permanece bastante desafiador. O país está passando pela pior crise hídrica dos últimos anos e o impacto decorrente do aumento dos preços de energia coloca ainda mais pressão na política monetária. As expectativas de inflação continuam sendo revisadas para cima neste ano e, por enquanto, o cenário inflacionário para o horizonte relevante da política monetária permanece dentro do intervalo da meta a ser perseguido pelo Banco Central.



CENÁRIO MACROECONÔMICO

Cautela no cenário econômico marcada por uma queda do Ibovespa, acompanhando também os acontecimentos do cenário exterior.

- No mercado local, os investidores seguem em alerta acompanhando o cenário político que vem sendo um tema recorrente principalmente quando se trata do desenrolar da reforma tributária.
- No dia 16/09 foi anunciado pelo governo o aumento temporário do Imposto sobre Operações Financeiras (IOF), essa medida começou a valer a partir do dia 20/09 e a tendência é que permaneça até o final do ano, a intenção do governo é levantar recursos para financiar o Auxílio Brasil (versão nova do Bolsa Família).



CENÁRIO MACROECONÔMICO

Nos Estados Unidos destaque para o ritmo de desaceleração, em contrapartida os investidores não consideram mudança quanto a expectativa do FED, que deve anunciar a redução dos estímulos ainda esse ano.

Na China também houve a divulgação dos dados de produção industrial da China, que subiu 5,3% em agosto. O dado ficou abaixo do esperado pelos analistas que esperava alta de 5,6%, destacando a desaceleração do período.

Em ambos os casos, Estados Unidos e China, a visão dos investidores é de que a queda no ritmo das economias em se dado devido a disseminação da variante Delta e consequente fechamento do mercado.



CENÁRIO MACROECONÔMICO

Historicamente, o mercado de ações apresenta uma alta forte nos primeiros doze meses após o fim de uma recessão e altas bem mais modestas nos anos seguintes.

A bolsa brasileira também foi afetada pelas discussões no âmbito fiscal, chegando a recuar mais de 4% no mês, mas recuperando parcialmente as perdas, fechando agosto com perdas de 2,5%.



CENÁRIO MACROECONÔMICO



Para os próximos meses o principal ponto de atenção ainda segue sendo as preocupações com relação a política monetária, principalmente a norte-americana



Além dos pontos recorrentes em relação a pandemia, onde a vacinação segue sendo fundamental para retomada das economias e a variante Delta o principal motivador que pode atrasar a retomada econômica



Ponto de atenção com relação a crise hídrica no Brasil, principalmente a sua contribuição para a aceleração da inflação, uma vez que os reservatórios estão em baixa, e devido ao seu peso não está sendo contabilizado nas previsões do PIB – Produto Interno Bruto, podendo ter surpresas nas próximas divulgações



RELATÓRIO FOCUS

Para o IPCA (Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo), a projeção subiu, de 8,00% para 8,35% em 2021. Para 2022, a previsão para o IPCA também subiu, de 4,03% para 4,10%. Para 2023, as estimativas ficaram em 3,25%. Para 2024, as projeções ficaram em 3,00%.

A projeção para o PIB (Produto Interno Bruto) se manteve em 5,04% em 2021. Para 2022, a estimativa caiu, de 1,72% para 1,63%. Para 2023 e 2024, as projeções ficaram em 2,30%.

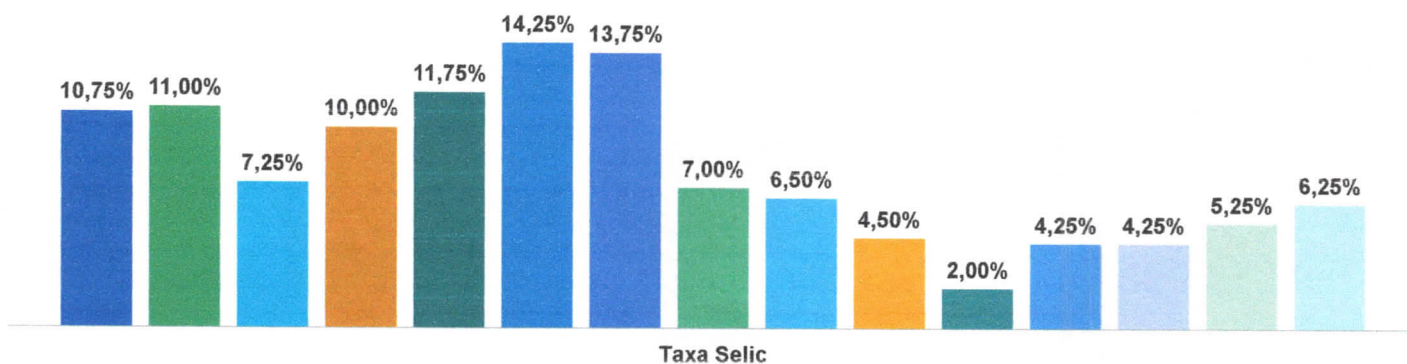
Para a taxa de câmbio, a estimativa foi mantida em R\$5,20 em 2021. Para 2022, o valor ficou em R\$5,20. Para 2023, a projeção saiu de R\$5,07 para R\$5,10. No ano seguinte, o valor ficou em R\$5,10.

Para a taxa Selic, os analistas elevaram de 8,00% para 8,25% em 2021. Para 2022, a taxa ficou em 8,50%. No ano seguinte, a projeção foi mantida em 6,75% e 6,50% para 2024.



Taxa Básica de Juros

■ 2010 ■ 2011 ■ 2012 ■ 2013 ■ 2014 ■ 2015 ■ 2016 ■ 2017 ■ 2018 ■ 2019 ■ 2020 ■ jun/21 ■ jul/21 ■ ago/21 ■ set/21

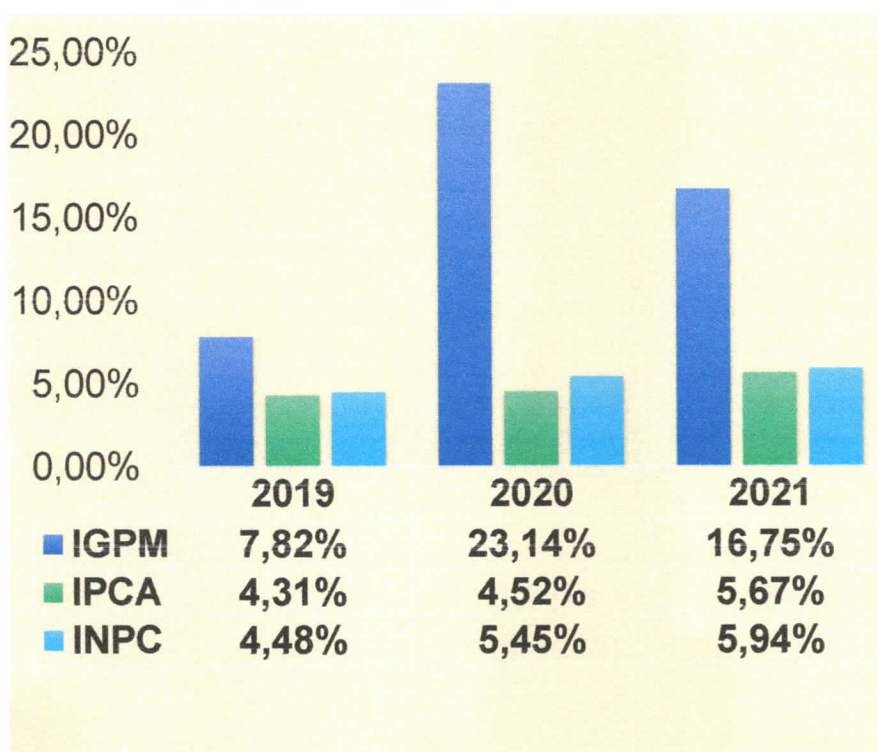
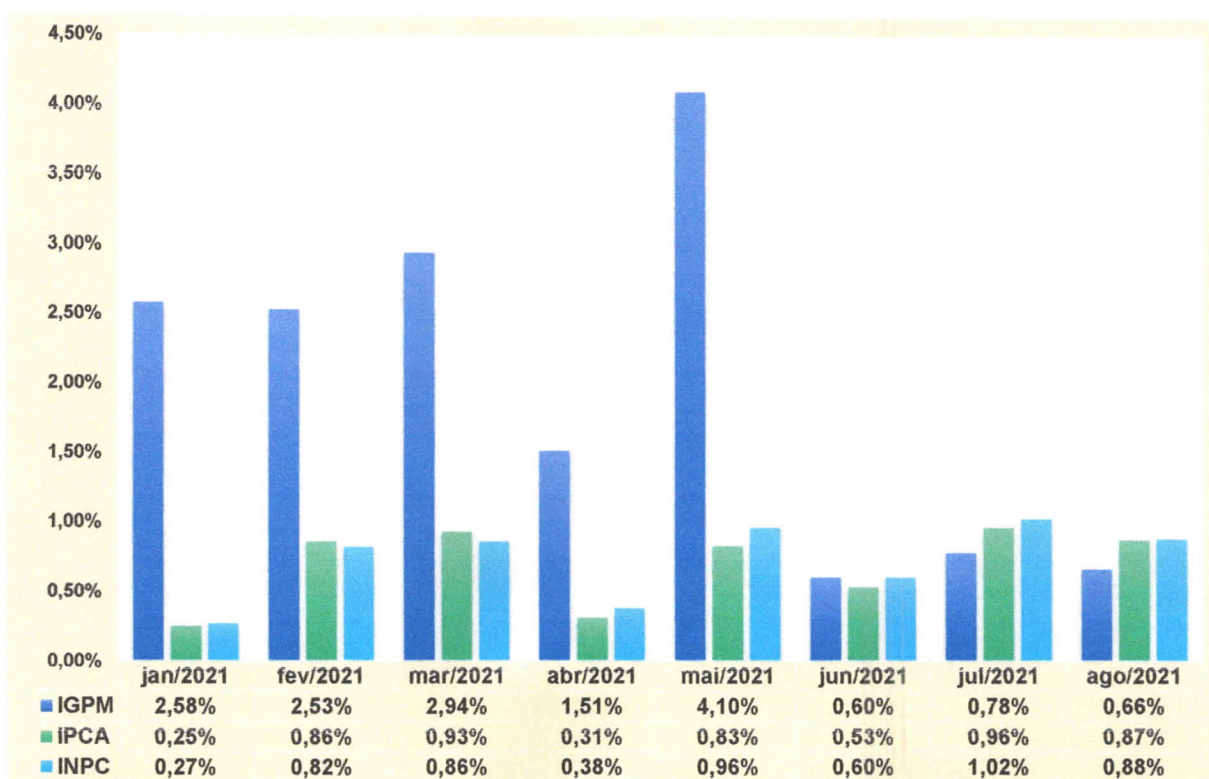


| Data da reunião do Copom | Taxa Selic fixada em |
|--------------------------|----------------------|
| 20 de janeiro | 2% |
| 17 de março | 2,75% |
| 5 de maio | 3,5% |
| 16 de junho | 4,25% |
| 4 de agosto | 5,25% |
| 22 de setembro | 6,25% |
| 27 de outubro | — |
| 8 de dezembro | — |

A Taxa Selic é definida a cada 45 dias pelo Copom. Por isso, a tabela abaixo será atualizada logo após as reuniões do Comitê de Política Monetária.



Inflação



Inflação Consolidada Jan/Ago 2021



Bolsa apresenta grande volatilidade com crise política: o que fazer com seus investimentos agora?

Para alguns analistas quem está na Bolsa não deve sair

Não recomendam a fuga da Bolsa, principalmente de quem perdeu dinheiro nos últimos meses. Sugestão de aguardar para não realizar uma perda [ter prejuízo] que pode ser mitigada ou até mesmo zerada no médio prazo. Avaliam que o recuo da Bolsa reflete mais uma volatilidade do que a aproximação de uma tragédia, e que o sobe e desce forte da Bolsa deve continuar até o próximo ano. Depois disso, esses ativos devem voltar (a se valorizarem). Esse é a melhor maneira de encarar a Bolsa hoje.



Bolsa apresenta grande volatilidade com crise política: o que fazer com seus investimentos agora?

Quem quer entrar, esse é o momento

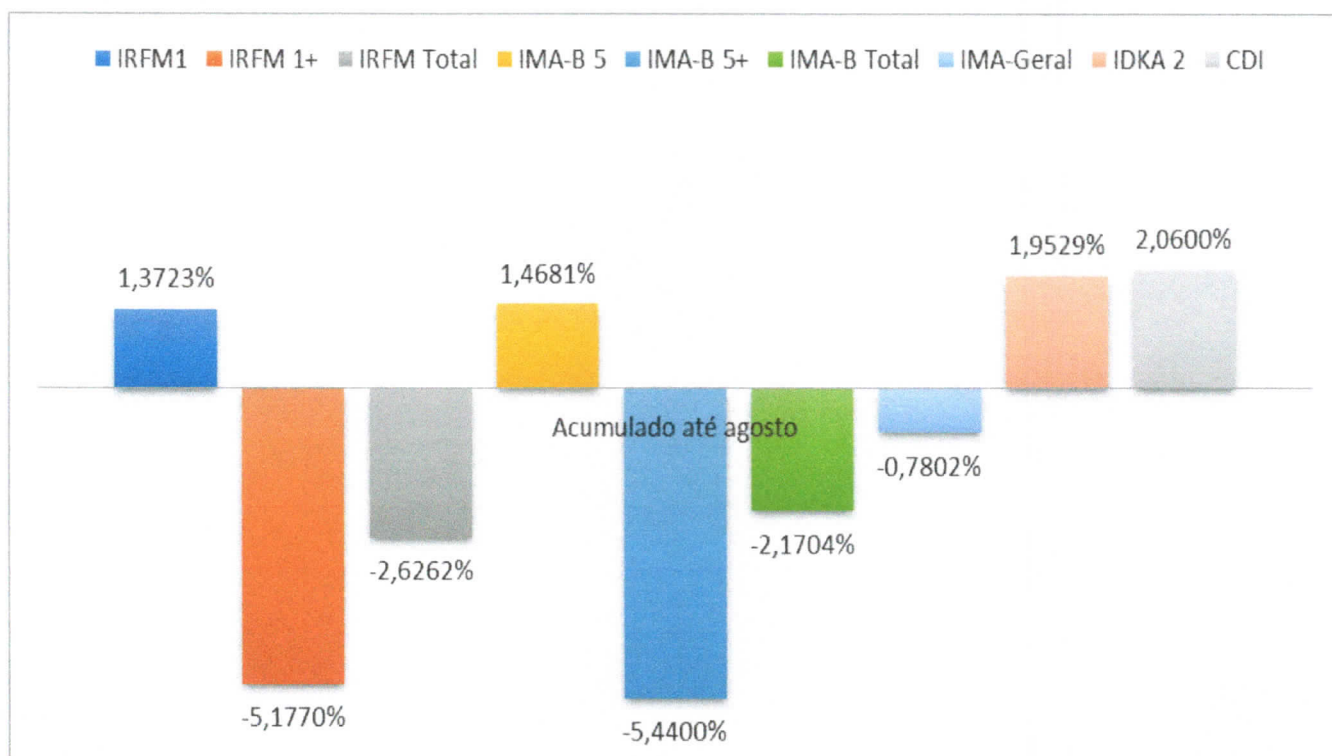
Para quem deseja entrar na Bolsa, os analistas dizem que sempre é momento, mas isso depende da tolerância ao risco e do tipo de ativo que você vai buscar. A recomendação é de papéis relacionados à alimentação e ao petróleo. Por outro lado, o investidor deve manter distância de setores como o automotivo e o de serviços, "que vão sofrer mais pesadamente até que o país entenda a direção que deve seguir. O cenário pode ser de boas oportunidades de compra, mas só para quem está disposto a enfrentar oscilações frequentes. Uma estratégia bastante utilizada é ir fazendo compras, caso o investidor enxergue alguma oportunidade, para ir ajustando seu preço médio caso a ação caia mais.

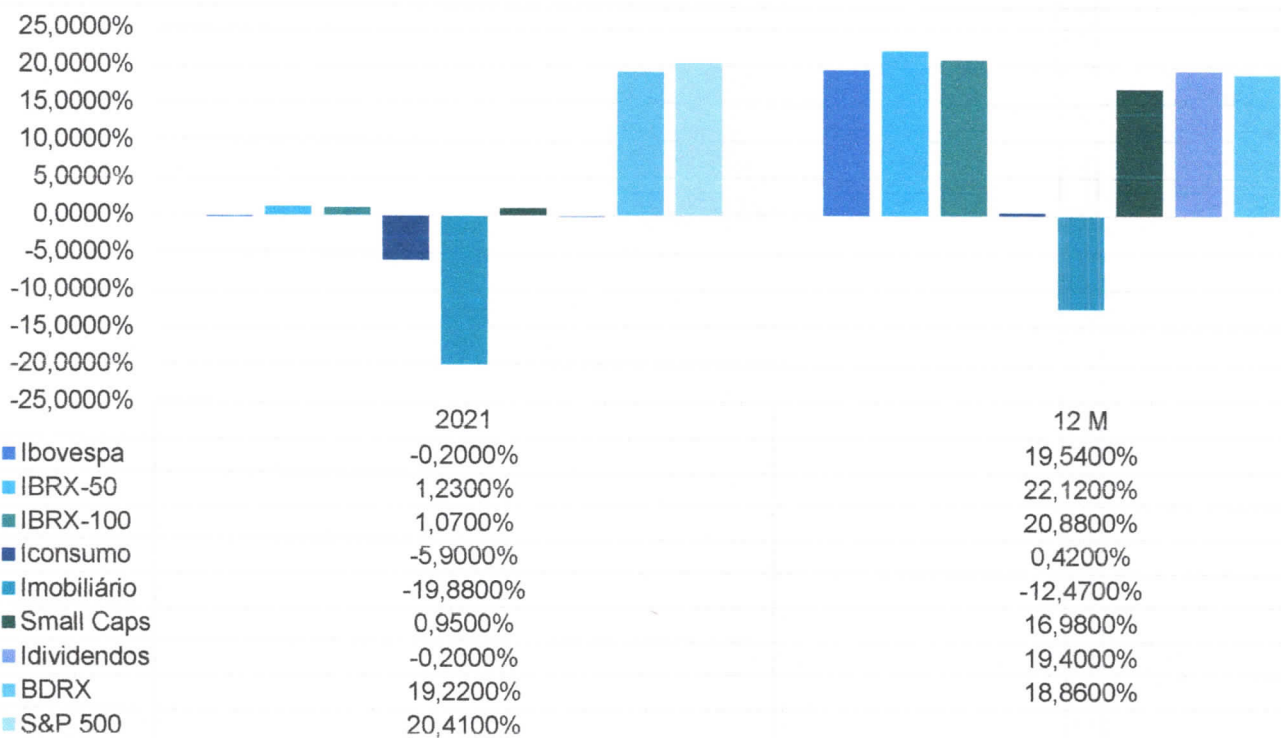
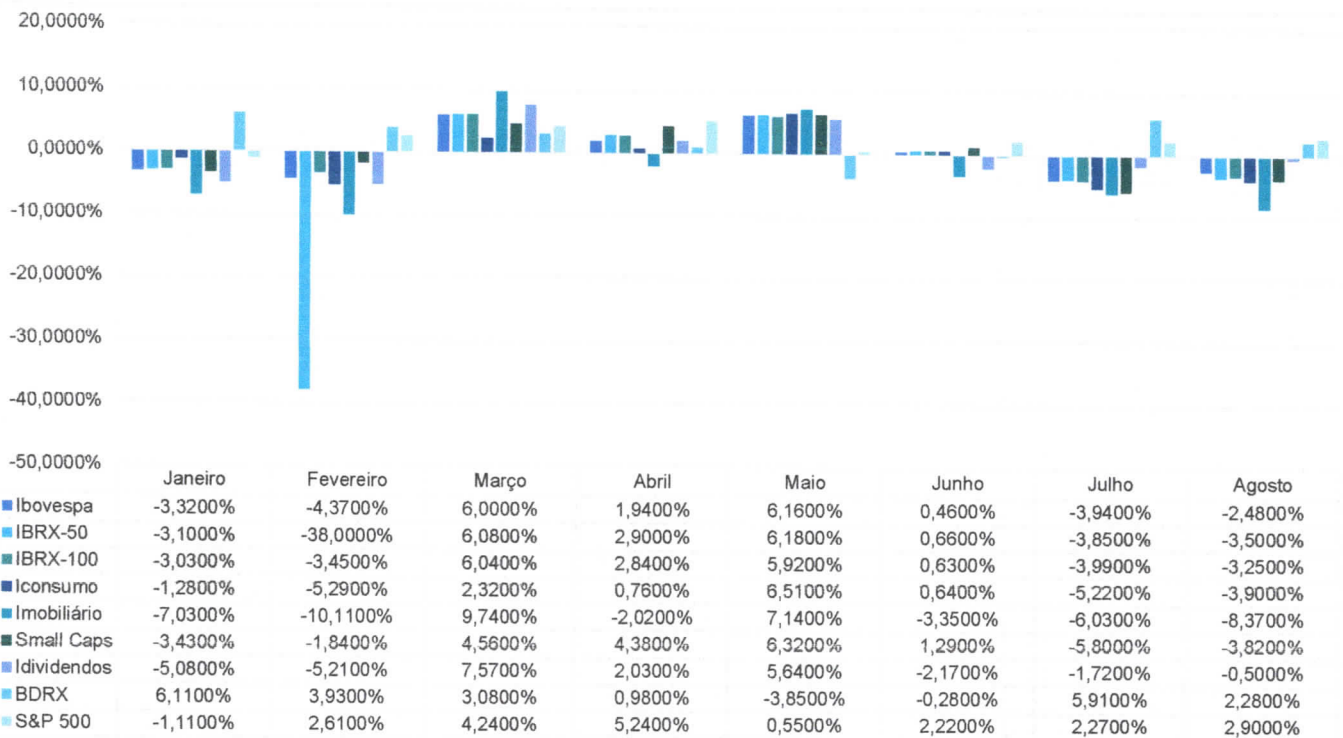
Renda fixa pode ficar mais atraente

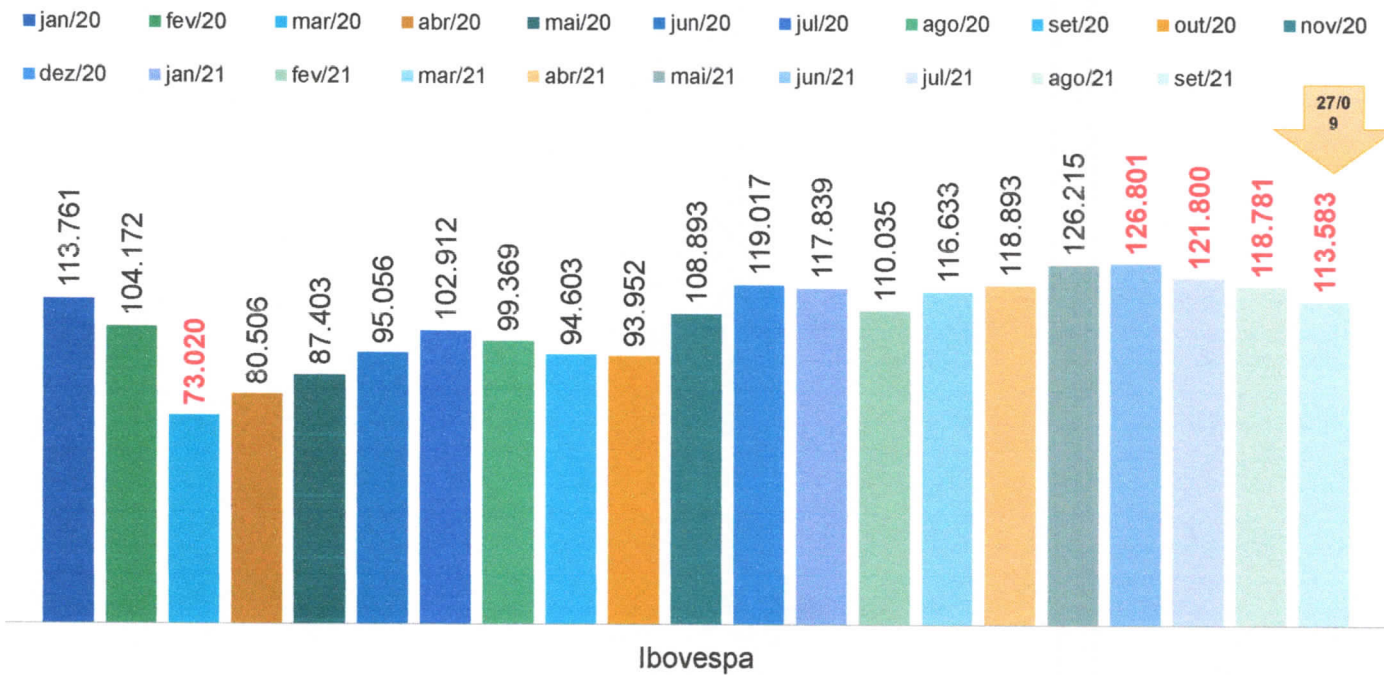
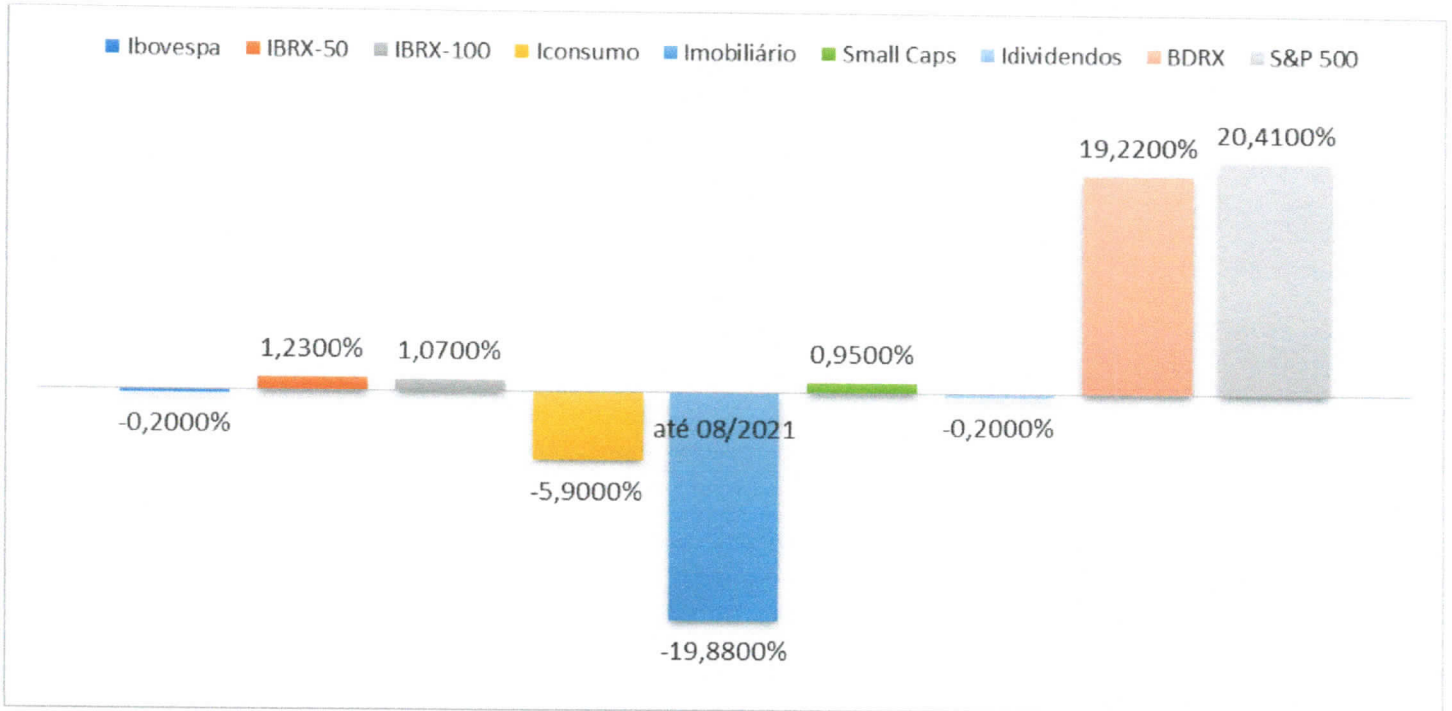
Outro movimento a ser observado, segundo os analistas, é o dos juros, que podem subir ainda mais diante da perspectiva de novas altas da inflação. Novos avanços nos juros devem causar deslocamentos de investimentos da Bolsa para a renda fixa. Destaque para o risco de debandada de investidores de curto prazo, o que pode piorar os índices da Bolsa nos próximos meses. Parte dos investidores já está exigindo um retorno maior, faz posições defensivas, com proteção maiores e exige ganhos maiores. Esses investidores de curto prazo já não colocam o Brasil como um emergente estável —o que é problemático para o país.

Desempenho dos Principais Indicadores de Renda Fixa e Renda Variável









27/09
9



Notícias do Mercado Financeiro

Discurso autoritário de Bolsonaro pode travar economia e estender escalada da inflação até 2022

Para alguns economistas, solução via impeachment pode trazer mais volatilidade.
8 set. 2021 às 08:23

Temperatura política sobe após manifestações, Ibovespa e dólar reagem: 2022 já começou para o mercado financeiro?

Analistas destacam pontos a serem monitorados após elevação das tensões e subida de tom de Bolsonaro, que já é um prenúncio do que está por vir ano que vem

Por [Lara Rizério](#), [Ricardo Bomfim](#)
8 set 2021 | 18:05 - Atualizado: 13 horas atrás

Dólar salta 2,8% e tem maior alta em mais de 1 ano sob risco-Bolsonaro

Uma onda de "stop loss" fez o dólar de uma só vez deixar para trás todas as suas principais médias móveis

Por [Reuters](#)
8 set 2021 | 18:21 - Atualizado: 12 horas atrás

Ibovespa fecha em queda de 3,8%, a maior desde março, e vai aos 113 mil pontos; dólar dispara a R\$ 5,32

Investidores mostraram muita preocupação com o recrudescimento do conflito entre os Três Poderes

Por [Ricardo Bomfim](#)
8 set 2021 | 17:23

Bolsonaro apazigua ânimos com o STF e impulsiona mercado: e agora, o que esperar para a Bolsa?

Reviravolta desta quinta pode indicar uma redução na tensão política, mas problemas reais da economia como a inflação ainda irão assombrar investidores

Por [Ricardo Bomfim](#)
9 set 2021 | 20:31 - Atualizado: 11 horas atrás



NOTÍCIAS DO MERCADO FINANCEIRO

Dados do Banco Central

À espera de alta de 1 ponto na Selic nesta semana, mercado eleva projeção para juros em 2021 e 2022

Economistas consultados pelo Focus também revisaram para cima suas projeções para a inflação, pela 24ª semana, para alta de 8,35% em 2021

Por [Mariana Zonta d'Ávila](#)
20 set 2021 | 08:57

27/09/2021 08:14 Ibovespa fecha em queda nesta sexta, mas sobe 1,7% em semana marcada por imbróglio da China, dólar sobe a R\$ 5,34

Ibovespa fecha em queda nesta sexta, mas sobe 1,7% em semana marcada por imbróglio da China; dólar sobe a R\$ 5,34

Bolsa manteve os 113 mil pontos apesar da decepção com o prosseguimento do caso Evergrande

Por [Ricardo Bomfim](#)
24 set 2021 | 17:25

Ibovespa cai aos 107 mil pontos e analistas veem oportunidades de compra, mas gráficos apontam até para perda dos 100 mil

Índice entrou em queda livre por fatores domésticos e internacionais, porém já há quem enxergue a Bolsa barata

Por [Ricardo Bomfim](#)
23 set 2021 | 18:48



NOTÍCIAS DO MERCADO FINANCEIRO

ENFOQUE MACRO

24 de setembro de 2021

INFORME SEMANAL E PERSPECTIVAS

Brasil

Copom eleva a Selic para 6,25% e afirma que cenário prescreve juro em território contracionista

Mundo

Fed sinaliza que em breve deverá reduzir o programa de compra de ativos

A semana em revista

sexta-feira, 24 de setembro de 2021



Copom eleva Selic em 1,0 p.p.

- ▶ Copom eleva Selic em 1,0 p.p. e sinaliza outro aumento de mesma magnitude em outubro.
- ▶ IPCA-15 sobe 1,14% em setembro e atinge 10,05% em 12 meses.
- ▶ Macro Visão – Crise hídrica: o que esperar em 2022 em um cenário de racionamento.
- ▶ Conta corrente superavitária em agosto.
- ▶ Confiança do consumidor recua em setembro.
- ▶ Crise no conglomerado Evergrande impacta mercados internacionais.
- ▶ Fed deve reduzir o ritmo de compra de ativos (tapering) em breve.



NOTÍCIAS DO MERCADO FINANCEIRO

28/09/2021 07:49

Hoje na Economia - 27/09/2021 - SulAmérica RI

Hoje na Economia – 27/09/2021

Os investidores permanecem atentos aos sinais emitidos por importantes bancos centrais, preocupados com a aproximação do momento em que os principais bancos comecem a abandonar o afrouxamento monetário. O efeito imediato é a vendas de títulos, resultando na elevação dos yields de longo prazo das principais economias avançadas. A crise da imobiliária chinesa Evergrande continua no radar, com monitoramento das informações provenientes da China sobre esse imbróglio.

No mercado doméstico, o Ibovespa deve seguir fragilizado diante das incertezas políticas domésticas, ampliando os riscos fiscais, e perspectivas de juros locais mais elevados. Os DIs futuros devem continuar pressionados: os vértices curtos ficarão à espera da ata do Copom amanhã, enquanto os longos atentos às questões fiscais e as treasuries. No câmbio, o BC inicia hoje os leilões extraordinários de swap cambial, buscando atenuar a volatilidade do dólar. A tendência é que a taxa de câmbio fique entre de R\$ 5,30/US\$ e R\$ 5,40/US\$, no curto prazo.



NOTÍCIAS DO MERCADO FINANCEIRO

Confiança do consumidor recua em setembro

De acordo com a pesquisa mensal da FGV, a confiança do consumidor recuou 6,5 p.p., em setembro, para 75,3, seu menor nível desde abril de 2021. O resultado foi puxado por quedas tanto no componente situação atual (recoiu de 1,0 p.p., para 68,8), quanto no índice de expectativa (recoiu de 9,8 p.p., para 81,1). De acordo com a nota divulgada pela FGV, a queda na confiança do consumidor é resultado de uma combinação de diversos fatores, entre eles a alta da inflação e do desemprego, o risco da crise energética e o aumento das incertezas econômicas e políticas. Na próxima semana, os indicadores de confiança da construção, indústria, serviços e comércio serão publicados.

Fed deve reduzir o ritmo de compra de ativos (tapering) em breve

O banco central dos EUA manteve inalterada a taxa básica de juros, no intervalo entre zero e 0,25%. No comunicado que acompanhou a decisão, as autoridades indicaram pela primeira vez que devem começar a reduzir ritmo de compra de ativos (*tapering*) em breve, de acordo com as expectativas. As projeções de inflação ao consumidor foram revisadas para cima para este ano e o próximo, enquanto as estimativas para 2023 permaneceram inalteradas. Segundo Jerome Powell, presidente do Fed, as expectativas mais altas de inflação são explicadas pelos gargalos de oferta, que devem durar até o fim do ano. Além disso, as projeções de taxa de juros indicam que os membros do comitê, ainda que divididos, agora antevêm maior probabilidade de alta em 2022, em comparação às expectativas em junho.

Crise no conglomerado Evergrande impacta mercados internacionais

Na China, o risco de colapso da Evergrande, gigante do mercado imobiliário com dívidas avaliadas em US\$ 300 bi, assustou investidores e provocou uma onda de desvalorizações em bolsas de todo o mundo, incluindo o Brasil. Entretanto, a percepção de risco sistêmico para a economia chinesa e consequente contágio para os demais países parece estar diminuindo, em partes devido à atuação do banco central local. Até o momento, o governo indicou que busca limitar os impactos para outros setores da economia. Ainda assim, o receio que a quebra do grupo cause um relevante contágio para outras empresas do setor permanece.

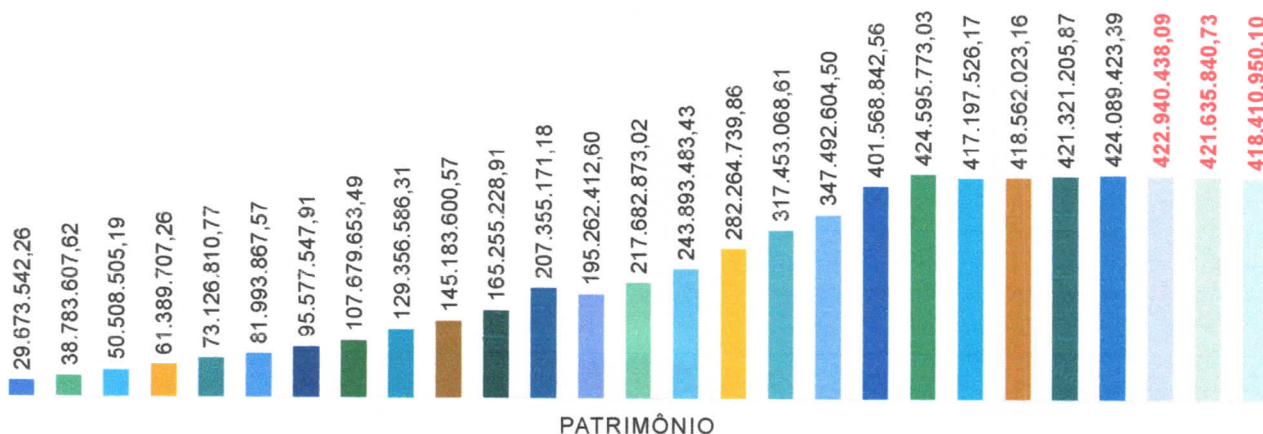


CARTEIRA DE INVESTIMENTOS





Evolução Patrimônio



PATRIMÔNIO



Resultado dos Investimentos

| | Valorização | Desvalorização | Consolidado |
|--------|---------------|----------------|---------------|
| 2019 | 54.216.306,30 | -6.115.160,51 | 48.101.145,79 |
| 2020 | 47.585.857,19 | -22.385.279,76 | 25.200.577,43 |
| jan/21 | 927.887,29 | -2.609.270,22 | -1.681.382,93 |
| fev/21 | 620.916,18 | -4.470.738,02 | -3.849.821,84 |
| mar/21 | 2.725.727,51 | -954.230,52 | 1.771.496,99 |
| abr/21 | 3.257.112,12 | -396.209,16 | 2.860.902,96 |
| mai/21 | 3.951.999,58 | -1.022.782,06 | 2.929.217,52 |
| jun/21 | 968.142,69 | -854.127,99 | 114.014,70 |
| jul/21 | 1.729.286,64 | -2.848.884,00 | -1.119.597,36 |
| ago/21 | 989.029,08 | -3.877.188,73 | -2.888.159,65 |



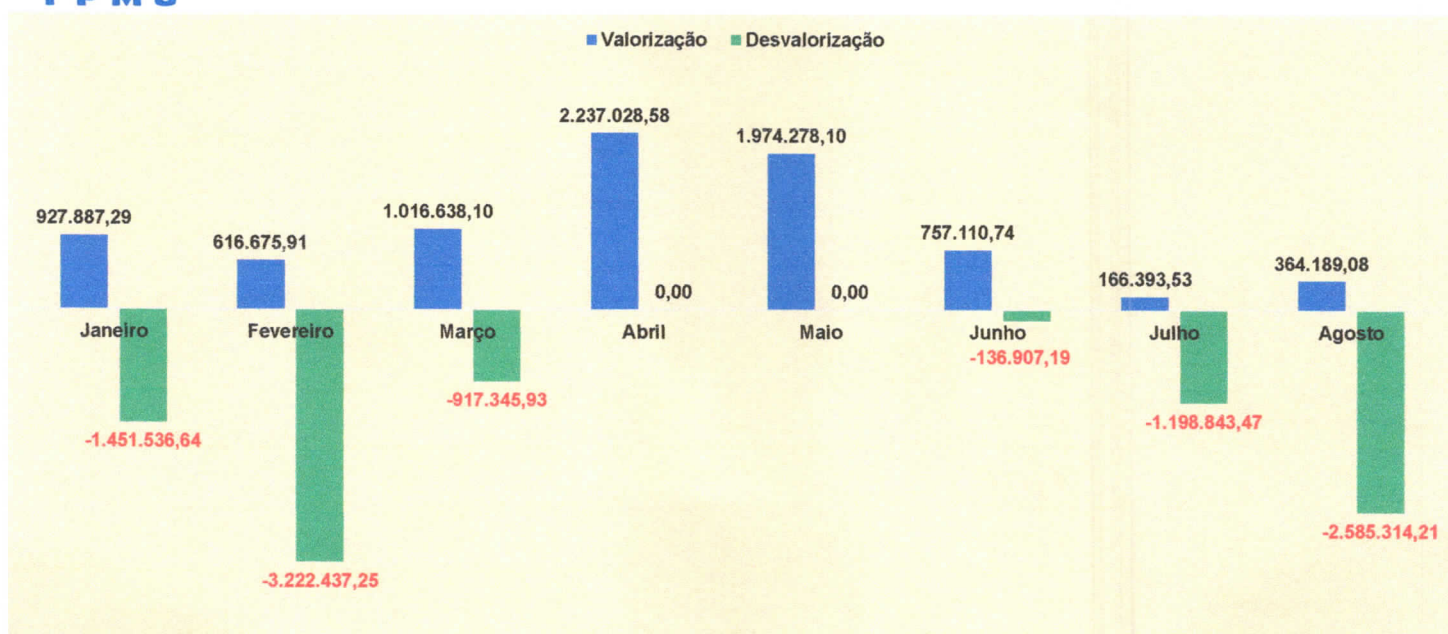
Resultado dos Investimentos

| Investimentos | Enquadramento | ago/21 | % PL |
|-----------------------|-----------------|-----------------------|----------------|
| Renda Fixa | Artigo 7º I A | 42.507.190,03 | 10,16% |
| Renda Fixa | Artigo 7º I B | 204.332.101,29 | 48,84% |
| Renda Fixa | Artigo 7º IV | 99.320.037,40 | 23,74% |
| Renda Variável | Artigo 8º II A | 36.291.989,66 | 8,67% |
| Investimento Exterior | Artigo 9º II A | 14.975.675,65 | 3,58% |
| Investimento Exterior | Artigo 9º III A | 20.949.438,71 | 5,01% |
| Total | | 418.376.432,74 | 100,00% |

| Investimentos | Valorização | Desvalorização | Consolidado |
|-----------------------|-------------------|----------------------|----------------------|
| Renda Fixa | 0,00 | -8.845,96 | -8.845,96 |
| Renda Fixa | 177.303,35 | -2.319.672,64 | -2.142.369,29 |
| Renda Fixa | 186.885,73 | -256.795,61 | -69.909,88 |
| Renda Variável | 0,00 | -1.291.874,52 | -1.291.874,52 |
| Investimento Exterior | 159.637,00 | 0,00 | 159.637,00 |
| Investimento Exterior | 465.203,00 | 0,00 | 465.203,00 |
| Total | 989.029,08 | -3.877.188,73 | -2.888.159,65 |

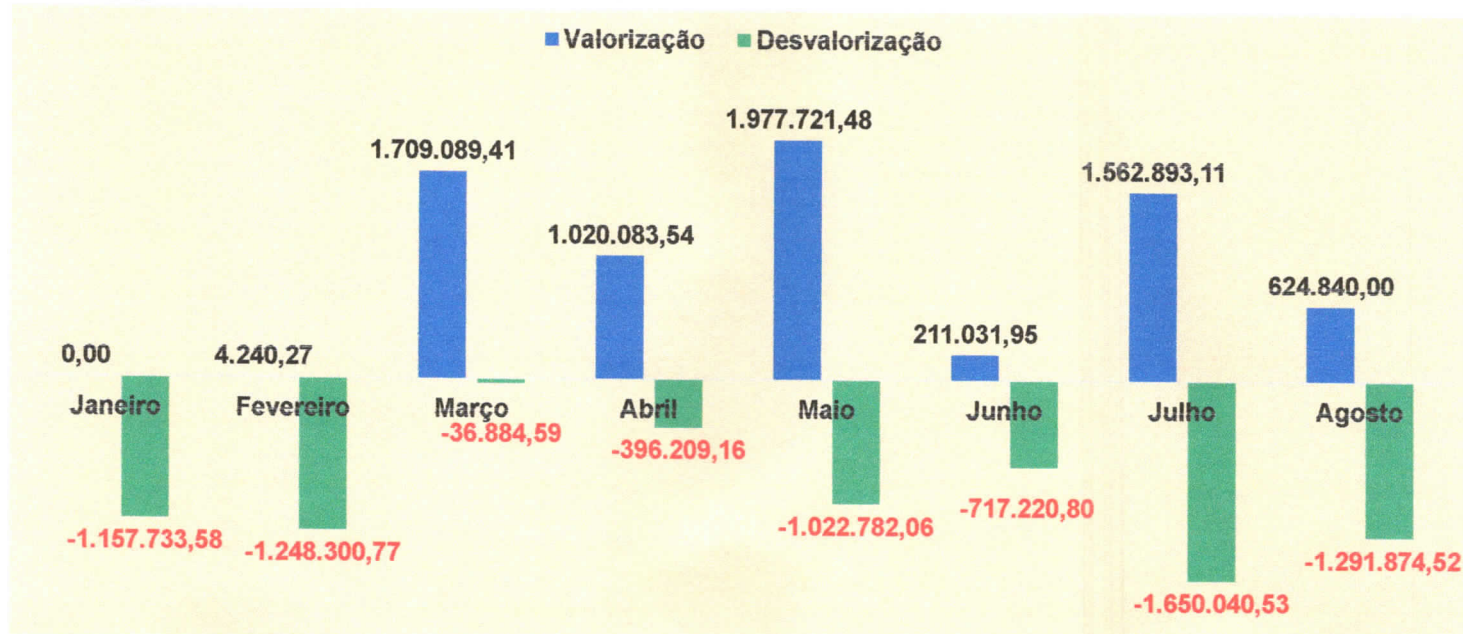


Resultado dos Investimentos - Renda Fixa

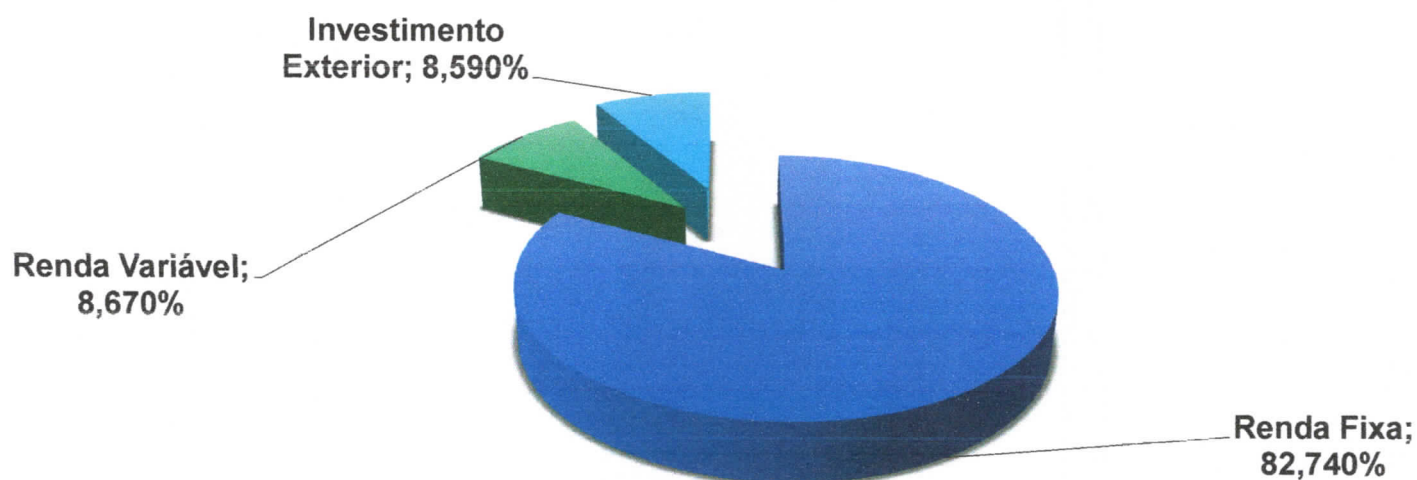




Resultado dos Investimentos - Renda Variável

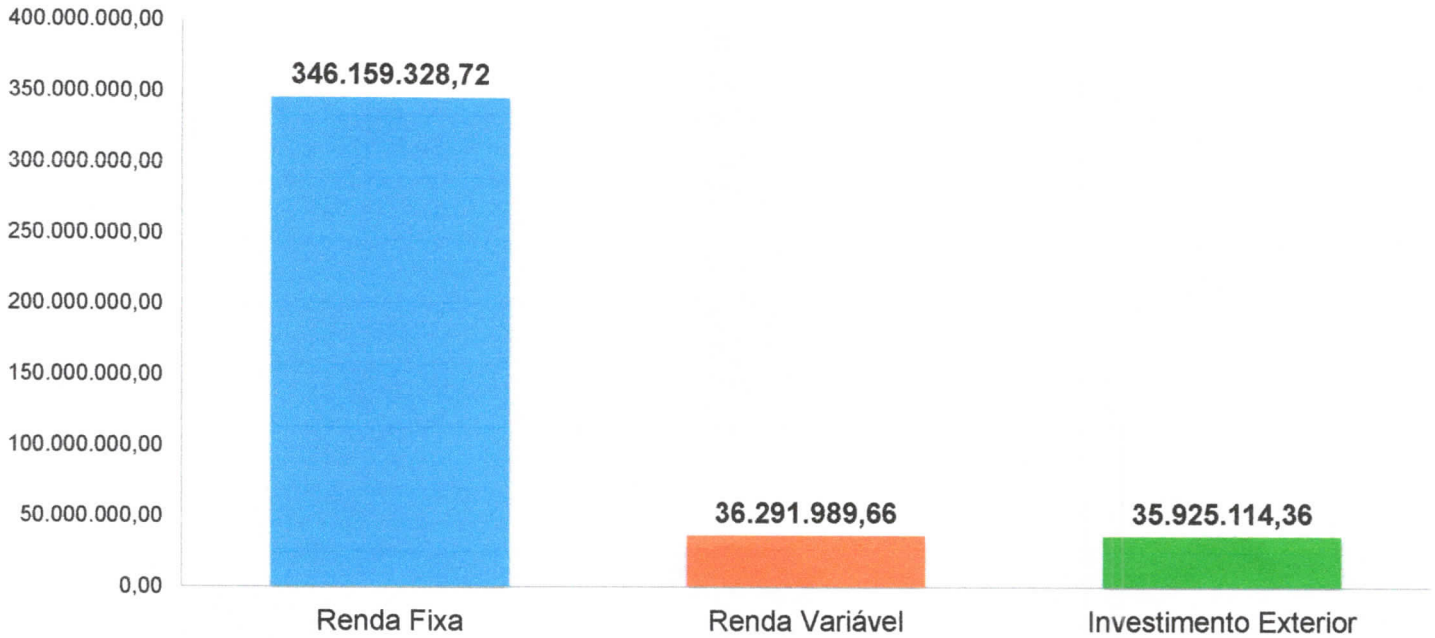


Composição da carteira de investimentos



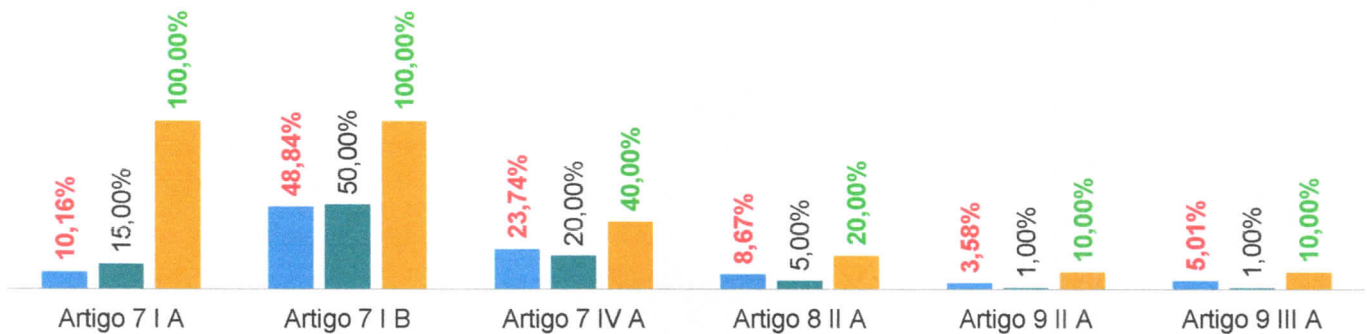


Composição da carteira de investimentos



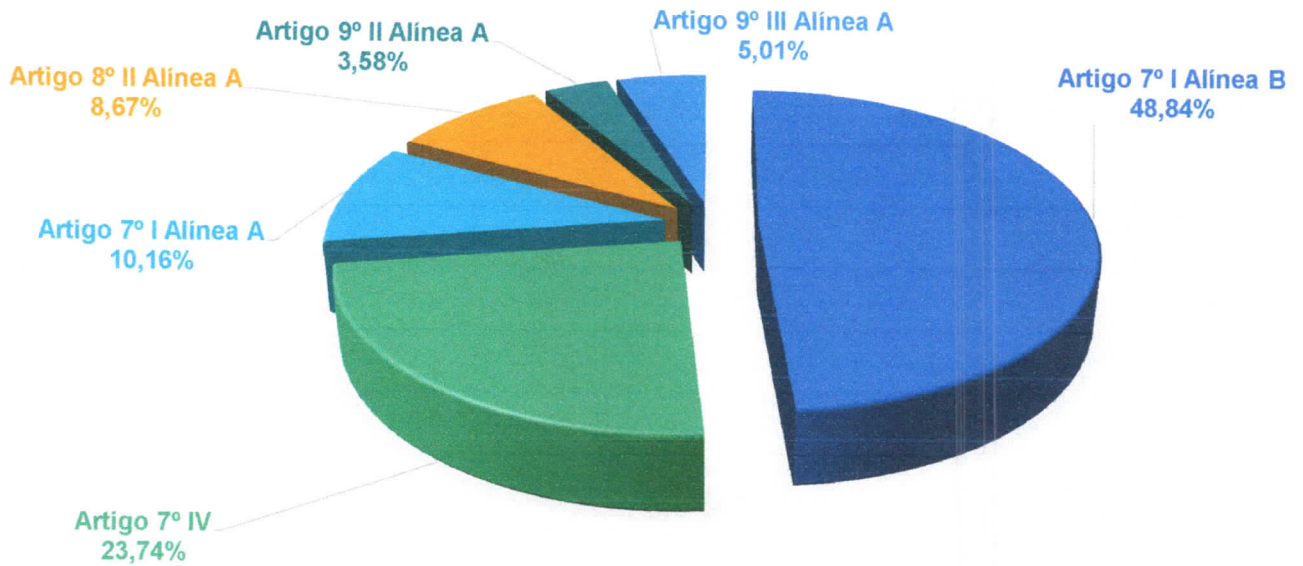
Aplicação por enquadramento

■ Aplicação ■ Objetivo ■ Máximo

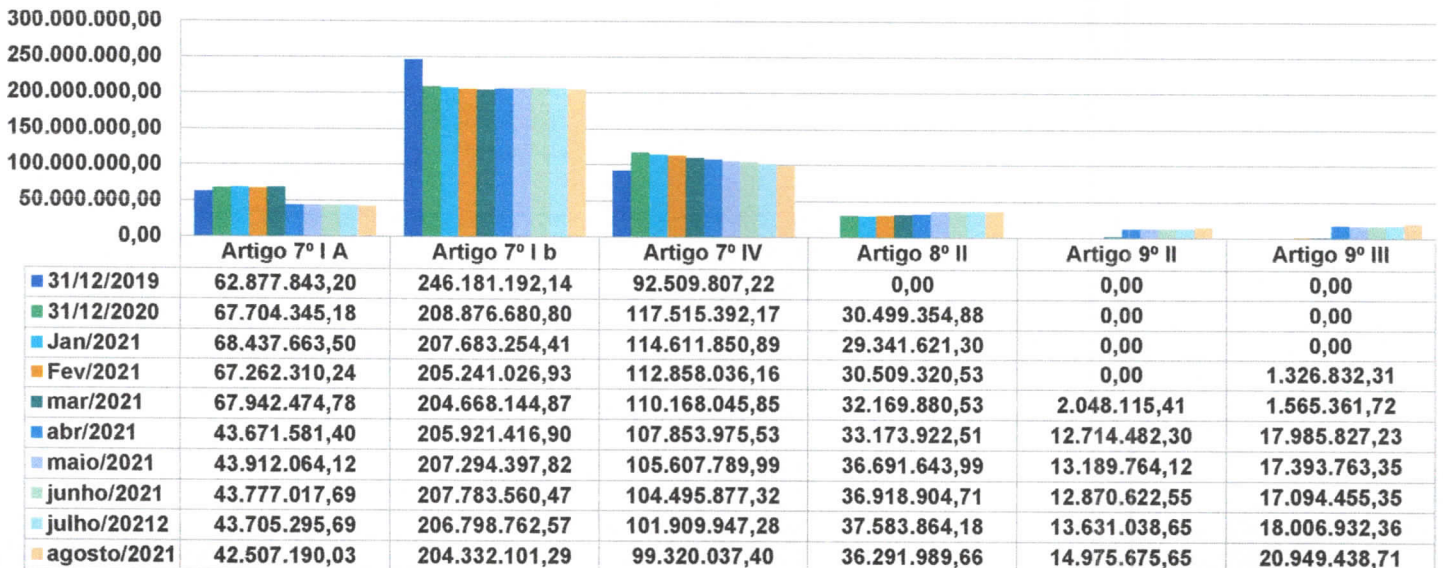




Aplicação por enquadramento

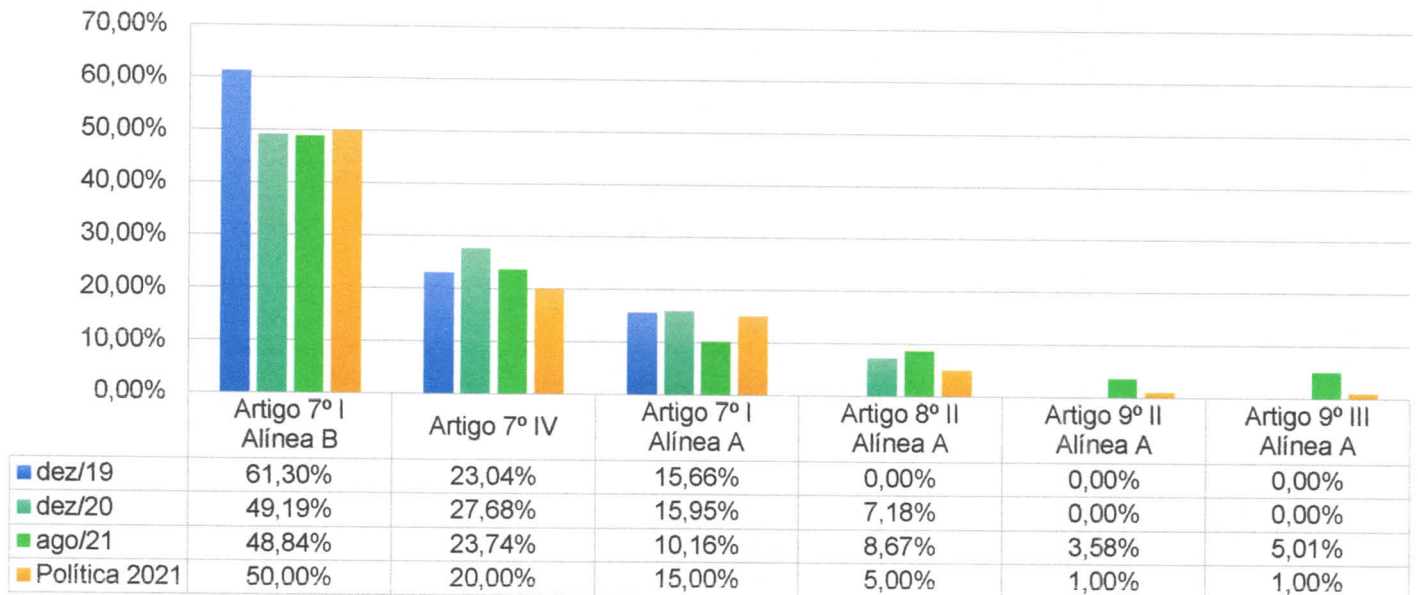


Aplicação por enquadramento

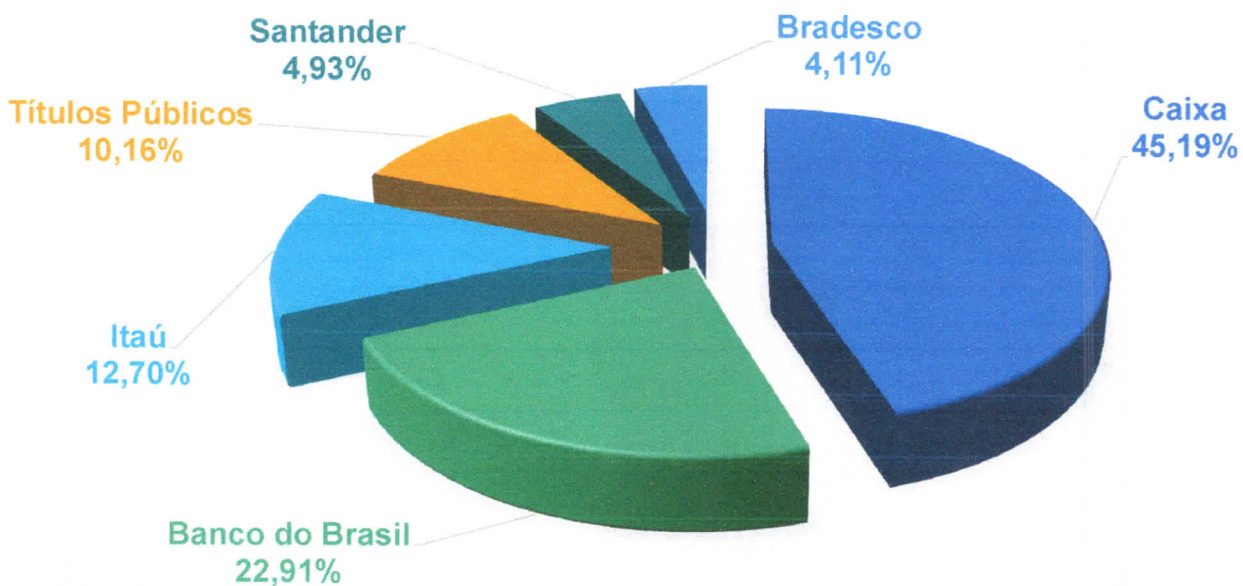




Diversificação por classe de ativos



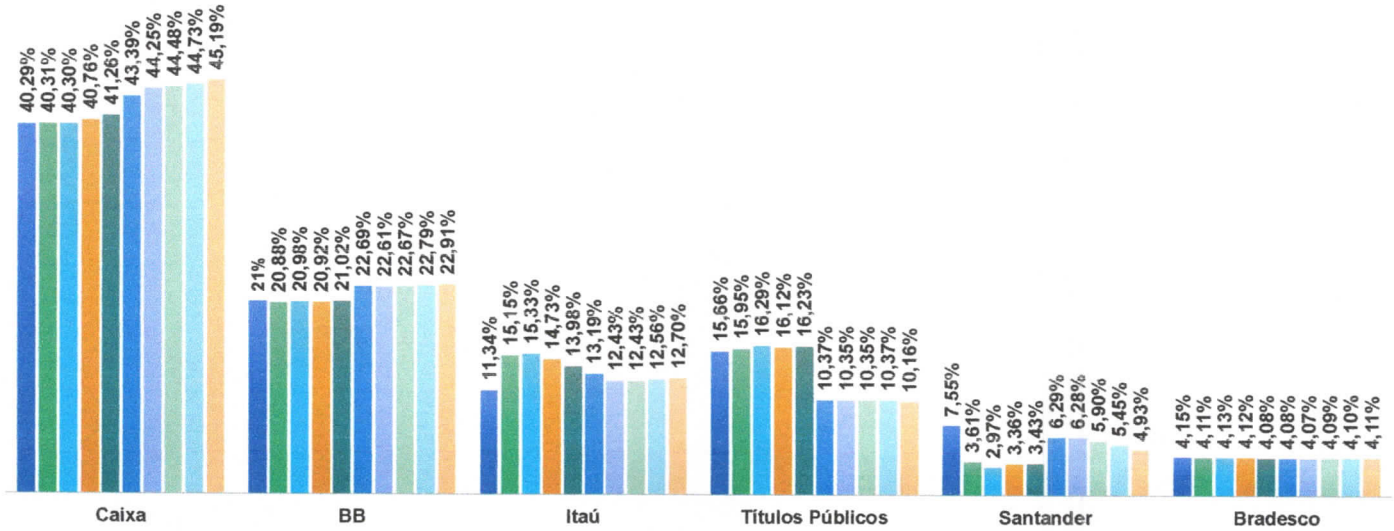
Alocação por gestor





Alocação por gestor

2019 2020 jan/21 fev/21 mar/21 abr/21 mai/21 jun/21 jul/21 ago/21



Meta Atuarial

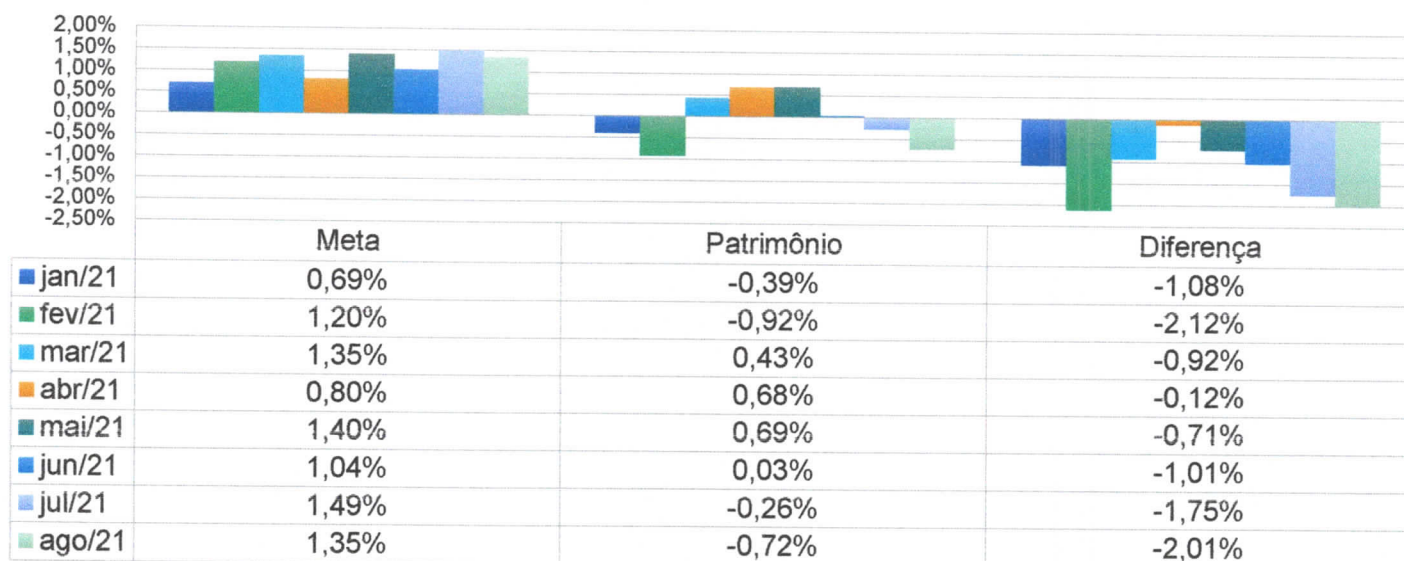
Para o **exercício de 2021**, considerando o resultado da duração o passivo do IPMU a taxa de juros definida é de **5,41% + INPC**.

O desempenho da carteira no início de 2021 não foi positivo, refletindo a instabilidade do mercado financeiro em consequência da pandemia do Covid 19.

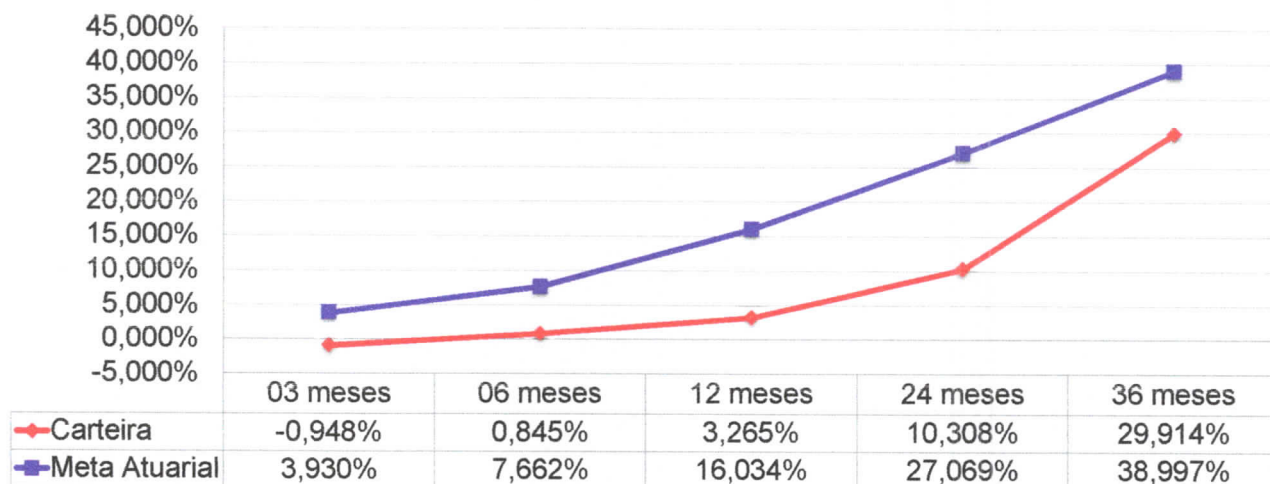
Mesmo com os avanços nos cenários econômicos e financeiros após março/2020, observa-se ainda volatilidade nos mercados, que reflete no resultado dos investimentos, principalmente pela elevação da inflação no cenário doméstico nos últimos meses.



Meta Atuarial

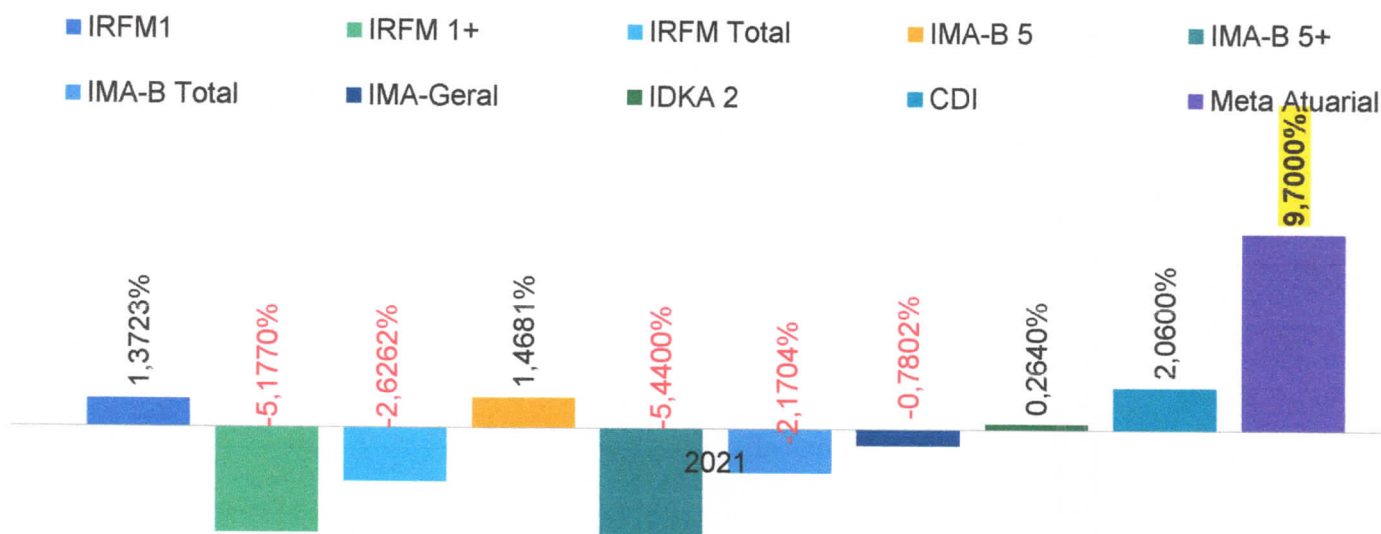


Meta Atuarial

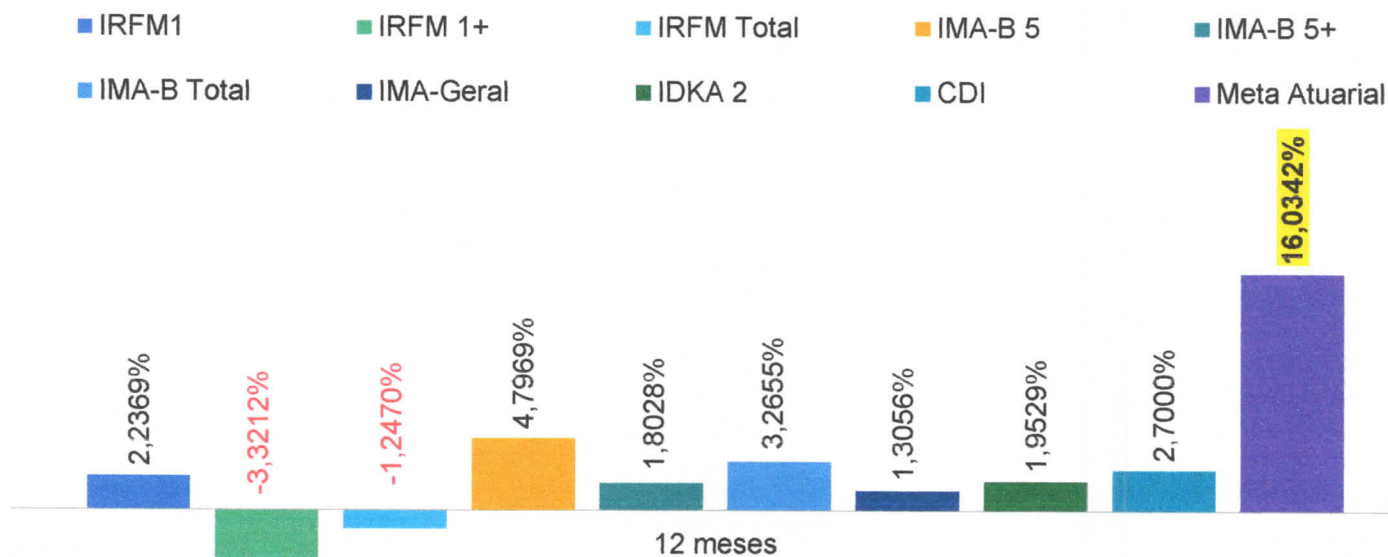




Meta Atuarial x Renda Fixa



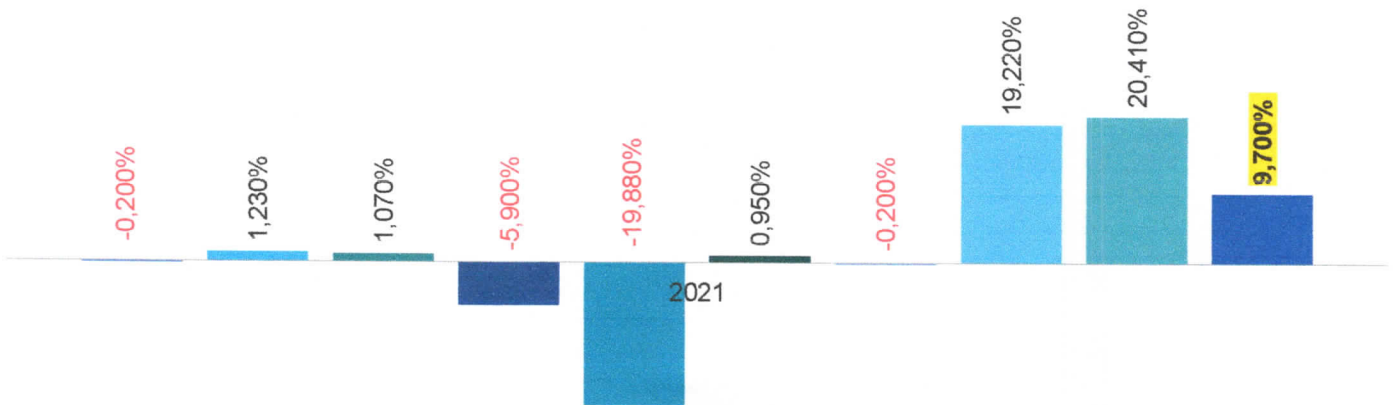
Meta Atuarial x Renda Fixa





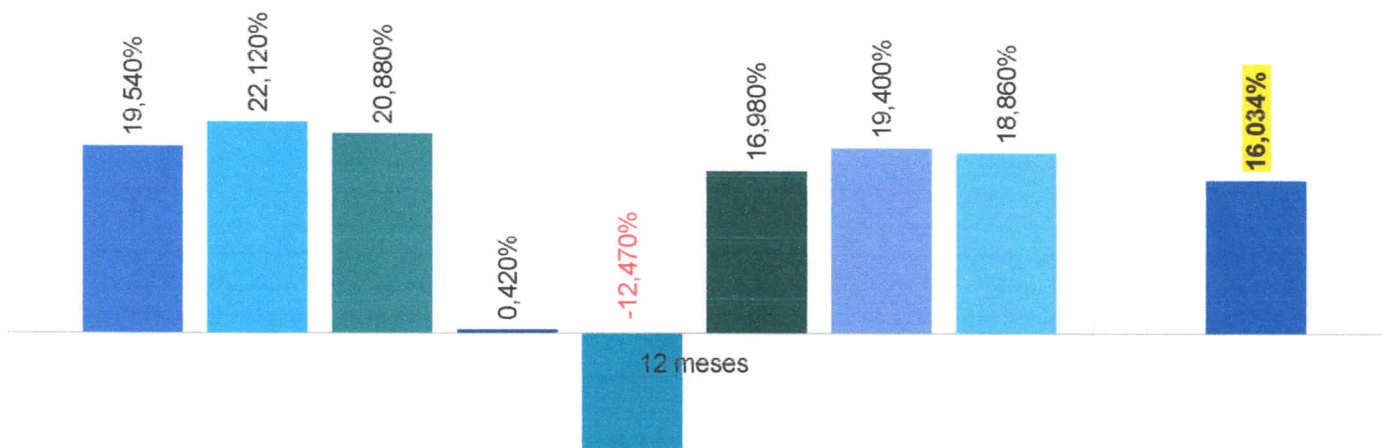
Meta Atuarial x Renda Variável

- Ibovespa
- IBRX-50
- IBRX-100
- Iconsumo
- Imobiliário
- Small Caps
- Idividendos
- BDRX
- S&P 500
- Meta Atuarial



Meta Atuarial x Renda Variável

- Ibovespa
- IBRX-50
- IBRX-100
- Iconsumo
- Imobiliário
- Small Caps
- Idividendos
- BDRX
- S&P 500
- Meta Atuarial





Value at Risk (VaR)

O VaR, ou Value at Risk, é um indicador de risco que estima a perda potencial máxima de um investimento para um período de tempo, com um determinado intervalo de confiança.

Através de um cálculo estatístico, o VaR mostra a exposição ao risco financeiro que um ou mais ativos possuem em determinado dia, semana ou mês.

Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal.



Value at Risk (VaR)

| Carteira IPMU | | | | |
|---------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| Janeiro | 390.732.768,80 | 29.341.621,30 | - | 420.074.390,10 |
| Fevereiro | 385.361.373,33 | 31.836.152,84 | - | 417.197.526,17 |
| Março | 382.778.665,50 | 32.169.880,53 | 3.613.477,13 | 418.562.023,16 |
| Abril | 357.446.973,83 | 33.173.922,51 | 30.700.309,53 | 421.321.205,87 |
| Maio | 356.813.530,93 | 36.691.643,99 | 30.583.527,47 | 424.088.702,39 |
| Junho | 356.056.455,48 | 36.918.904,71 | 29.965.077,90 | 422.940.438,09 |
| Julho | 352.414.005,54 | 37.583.864,18 | 31.637.971,01 | 421.635.840,73 |
| Agosto | 346.159.328,72 | 35.925.114,36 | 36.291.989,66 | 418.376.432,74 |



Value at Risk (VaR)

| VaR - % | | | | |
|-----------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| | 5,00% | 20,00% | | |
| Janeiro | 1,263% | 11,585% | | 1,685% |
| Fevereiro | 1,125% | 12,218% | | 1,778% |
| Março | 1,650% | 14,135% | 10,757% | 2,284% |
| Abril | 1,417% | 5,163% | 8,545% | 1,244% |
| Maio | 1,234% | 8,409% | 5,582% | 1,581% |
| Junho | 1,294% | 6,009% | 4,935% | 1,278% |
| Julho | 1,340% | 8,773% | 7,213% | 1,642% |
| Agosto | 1,884% | 10,173% | 5,958% | 1,935% |



Value at Risk (VaR)

| VaR - R\$ | | | | |
|-----------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| Janeiro | 4.933.366,25 | 3.399.365,74 | - | 7.077.447,66 |
| Fevereiro | 4.335.023,00 | 3.889.668,02 | - | 7.417.711,99 |
| Março | 6.317.220,22 | 4.547.346,60 | 388.693,83 | 9.558.906,25 |
| Abril | 5.066.803,10 | 1.712.721,20 | 2.623.423,74 | 5.242.769,76 |
| Maio | 4.403.836,45 | 3.085.375,08 | 1.707.311,56 | 6.703.777,09 |
| Junho | 4.606.562,76 | 2.218.605,21 | 1.478.699,64 | 5.405.875,15 |
| Julho | 4.721.215,76 | 3.297.120,56 | 2.282.081,76 | 6.924.323,13 |
| Agosto | 6.521.432,27 | 3.654.497,65 | 2.162.108,99 | 8.096.742,11 |



Value at Risk - Carteira IPMU 31/8/2021

| Ativo | VaR no Mês | VaR no Ano | Saldo |
|--|------------|------------|---------------|
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,874% | 8,400% | 8.779.569,02 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,384% | 1,310% | 59.279.915,30 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,338% | 1,434% | 12.191.063,34 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5,566% | 4,007% | 8.944.331,81 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,465% | 0,769% | 6.657.361,20 |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1,575% | 1,338% | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 1,510% | 1,179% | 8.022.801,51 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 1,866% | 1,282% | 60.330.793,73 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 5,579% | 4,022% | 13.051.368,25 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3,398% | 2,618% | 56.068.331,00 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 9,714% | 10,205% | 17.825.673,59 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 6,204% | 8,382% | 12.169.869,69 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 4,853% | 8,656% | 3.136.800,05 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 10,991% | 10,054% | 18.466.316,07 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,795% | 0,321% | 53.128.737,70 |
| NTN-B 760199 20240815 | 1,655% | 1,900% | 42.507.190,03 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,361% | 0,265% | 8.797.170,33 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 5,879% | 7,894% | 11.838.875,60 |

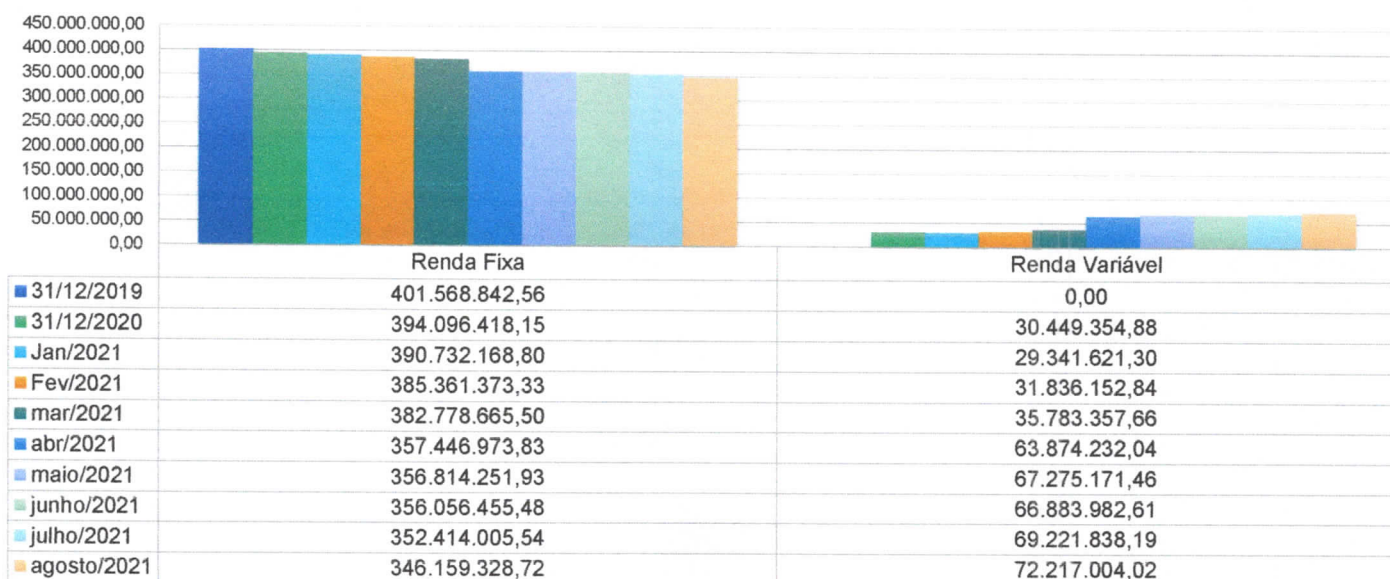


Volatilidade Carteira IPMU 31/8/2021

| Ativo | Volatilidade - Mês | Volatilidade - Ano | Saldo |
|--|--------------------|--------------------|-----------------------|
| Ações | 23,147% | 21,492% | 36.291.989,66 |
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | 23,147% | 21,492% | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 20,458% | 21,492% | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 23,147% | 21,174% | 18.466.316,07 |
| Renda Fixa | | | 346.159.328,72 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | | | 204.332.101,29 |
| IMA-B | | | 56.068.331,00 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7,156% | 5,513% | 56.068.331,00 |
| IMA-B 5+ | | | 21.995.700,06 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 11,721% | 8,439% | 8.944.331,81 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 11,749% | 8,470% | 13.051.368,25 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,915% | 2,759% | 59.279.915,30 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,979% | 1,620% | 6.657.361,20 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 3,930% | 2,700% | 60.330.793,73 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | | | 99.320.037,40 |
| IPCA | | | 37.394.129,37 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2,818% | 3,020% | 12.191.063,34 |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 3,316% | 2,818% | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 3,180% | 2,482% | 8.022.801,51 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1,675% | 0,675% | 53.128.737,70 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,761% | 0,559% | 8.797.170,33 |
| Art. 7º, I, a | | | 42.507.190,03 |
| NTN-B 760199 20240815 | 3,487% | 4,001% | 42.507.190,03 |
| Exterior | | | 35.925.114,36 |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | | | 20.949.438,71 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 14,477% | 17,691% | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 13,065% | 17,652% | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | | | 14.975.675,65 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 10,221% | 18,231% | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 12,382% | 16,626% | 11.838.875,60 |
| Total Geral | | | 418.376.432,74 |



Diversificação por classe de ativos fatores de risco



Análise de liquidez

| Período | Valor (R\$) | (%) |
|-------------------|----------------|---------|
| de 0 a 30 dias | 371.126.195,20 | 88,021% |
| de 31 a 364 dias | 0,00 | 0,000% |
| acima de 365 dias | 50.509.645,53 | 11,979% |



CARTEIRA SUGERIDA

Agosto de 2021

Banco do Brasil
Diretoria de Governo
Gerência de Fundos de Investimentos Governo e Negócios Previdenciários

| | CONSERVADOR | MODERADO | ARROJADO |
|--------------------------|--|--|--|
| R E N D A F I X A | ALOCADO 40% ✓ ATIVA FIC ✓ ATIVA Retorno Total | ALOCADO 40% ✓ ATIVA FIC ✓ ATIVA Retorno Total | ALOCADO 40% ✓ ATIVA FIC ✓ ATIVA Retorno Total |
| | CURTO 25% ✓ IDVA 2 TP FIC ✓ IMA-B5 FIC ✓ IRF-M1 TP FIC | CURTO 20% ✓ IDVA 2 TP FIC ✓ IMA-B5 FIC ✓ IRF-M1 TP FIC | CURTO 13% ✓ IDVA 2 TP FIC ✓ IMA-B5 FIC ✓ IRF-M1 TP FIC |
| | LONGO 15% ✓ IMA-B TP FIC | LONGO 13% ✓ IMA-B TP FIC | LONGO 10% ✓ IMA-B TP FIC |
| | REFERENCIADO 5% ✓ PERFIL FIC DI | REFERENCIADO 5% ✓ PERFIL FIC DI | REFERENCIADO 3% ✓ PERFIL FIC DI |
| V A R I Á V E L | MULTIMERCADO 8% ✓ Previdenciário LP ✓ Alocado FI ✓ Juros e Moedas | MULTIMERCADO 6% ✓ Previdenciário LP ✓ Alocado FI ✓ Juros e Moedas | MULTIMERCADO 6% ✓ Previdenciário LP ✓ Alocado FI ✓ Juros e Moedas |
| | AÇÕES 7% ✓ ALOCAÇÃO VALOR FIC ✓ DIVIDENDOS QUANTITATIVO ✓ GOVERNANÇA ✓ BOLSA AMERICANA ✓ AÇÕES AGRO ✓ ASO BRASIL | AÇÕES 11% ✓ ALOCAÇÃO VALOR FIC ✓ DIVIDENDOS QUANTITATIVO ✓ GOVERNANÇA ✓ BOLSA AMERICANA ✓ RETORNO TOTAL ✓ AÇÕES AGRO ✓ ASO BRASIL | AÇÕES 20% ✓ ALOCAÇÃO VALOR FIC ✓ DIVIDENDOS QUANTITATIVO ✓ GOVERNANÇA ✓ BOLSA AMERICANA ✓ RETORNO TOTAL ✓ AÇÕES AGRO ✓ ASO BRASIL |
| | INVESTIMENTO NO EXTERIOR 5% ✓ ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR ✓ BDR NÍVEL I ✓ BOLSAS GLOBAIS ✓ ETF | INVESTIMENTO NO EXTERIOR 5% ✓ ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR ✓ BDR NÍVEL I ✓ BOLSAS GLOBAIS ✓ ETF | INVESTIMENTO NO EXTERIOR 8% ✓ ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR ✓ BDR NÍVEL I ✓ BOLSAS GLOBAIS ✓ ETF ✓ BOLSAS EUROPEIAS |



Carteira Sugerida RPPS



baseadas a metodologia CNR nº 072/2016 e estratégias posteriores, respeitando inclusive, seus limites.

| Fundo | Benchmark | Limite 3.922 | Carteira | |
|---|-----------|--------------|--------------|-----------|
| | | | Mês anterior | Mês atual |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | IRF-M 1 | 100% | 17% | 7% |
| CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LP | IMA-B 5 | 100% | 8% | 8% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | IRF-M 1+ | 100% | 6% | 5% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | IMA-B 5+ | 100% | 5% | 5% |
| CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | IPCA | 100% | 18% | 15% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | CDI | 40% | 5% | 0% |
| CAIXA FI BRASIL MATRIZ RF | CDI | 40% | 0% | 7% |
| CAIXA FI BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | CDI | 40% | 0% | 6% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | IPCA | 40% | 5% | 7% |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | IPCA+6% | 5% | 4% | 4% |
| CAIXA FIC AÇÕES MULTIGESTOR AÇÕES | IBOV | 20% | 2% | 3% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | IBOV | 20% | 2% | 3% |
| CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES | IBOV | 20% | 3% | 3% |
| CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES | IBOV | 20% | 4% | 3% |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES | ICON | 20% | 4% | 3% |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | S&P500 | 10% | 7% | 6% |
| CAIXA FIC BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE MULTIMERCADO | CDI | 10% | 2% | 4% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INV EXT FIC FIM | - | 10% | 2% | 4% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | BDR | 10% | 6% | 6% |

▲ Aumento ■ Manutenção ▼ Redução

Acesse o portfólio completo de fundos da CAIXA clicando [aqui](#).



| Variações | Dezembro/2020 | Valorização | Desvalorização | Acumulado | Agosto/2021 |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| Fundos 100% Títulos Públicos | 208.876.680,80 | 3.583.392,07 | -7.631.087,55 | -4.047.695,48 | 204.332.101,29 |
| BB Previdenciário Alocação | 60.105.619,51 | 718.346,94 | -1.544.051,15 | -825.704,21 | 59.279.915,30 |
| BB Previdenciário Títulos 2022 | 6.786.833,43 | 367.569,40 | -157,60 | 367.411,80 | 6.657.361,20 |
| BB Previdenciário IMA-B 5+ | 9.470.364,98 | 235.191,26 | -761.224,43 | -526.033,17 | 8.944.331,81 |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | 13.836.751,59 | 345.676,93 | -1.131.060,27 | -785.383,34 | 13.051.368,25 |
| Caixa Brasil Gestão Estratégica | 61.257.318,74 | 752.263,05 | -1.678.788,06 | -926.525,01 | 60.330.793,73 |
| Caixa Brasil IMA-B | 57.419.792,55 | 1.164.344,49 | -2.515.806,04 | -1.351.461,55 | 56.068.331,00 |



| Varições | Dezembro/2020 | Valorização | Desvalorização | Acumulado | Agosto/2021 |
|---------------------------------|-----------------------|---------------------|--------------------|-------------------|----------------------|
| Fundo Renda Fixa DI | 117.515.392,17 | 1.501.818,38 | -985.173,15 | 516.645,23 | 99.320.037,40 |
| Bradesco FIC FI Alocação | 17.441.174,91 | 220.917,87 | -481.828,26 | -260.910,39 | 17.180.264,52 |
| BB Previdenciário Retorno Total | 12.308.791,34 | 164.575,08 | -282.303,08 | -117.728,00 | 12.191.063,34 |
| Caixa Brasil RF Ativa | 8.128.183,61 | 100.579,33 | -205.961,43 | -105.382,10 | 8.022.801,51 |
| Itaú Institucional Alocação | 64.309.650,37 | 819.087,33 | 0,00 | 819.087,33 | 53.128.737,70 |
| Santander RF Ativo (350) | 1.802.732,12 | 26.537,27 | -2.104,49 | 24.432,78 | 1.882.164,90 |
| Santander RF Ativo (150) | 13.524.859,82 | 170.121,50 | -12.975,89 | 157.145,61 | 6.915.005,43 |



| Varições | Dezembro/2020 | Valorização | Desvalorização | Acumulado | Agosto/2021 |
|-----------------------------|----------------------|---------------------|----------------------|--------------------|----------------------|
| Fundo Renda Variável | 30.499.354,88 | 4.849.697,74 | -5.443.062,96 | -593.365,22 | 36.291.989,66 |
| Caixa Small Cap Ativo | 15.384.565,17 | 2.834.619,32 | -2.945.868,42 | -111.249,10 | 18.466.316,07 |
| Caixa Infraestrutura | 15.114.789,71 | 2.015.078,42 | -2.497.194,54 | -482.116,12 | 17.825.673,59 |
| Fundo Renda Variável | 0,00 | 829.752,33 | -957.076,68 | -127.324,35 | 14.975.675,65 |
| Caixa Multigestor Equities | 0,00 | 99.257,69 | -47.457,64 | 51.800,05 | 3.136.800,05 |
| Santander Global Equities | 0,00 | 730.494,64 | -909.619,04 | -179.124,40 | 11.838.875,60 |
| Fundo Renda Variável | 0,00 | 1.430.449,69 | -1.120.906,37 | 309.543,32 | 20.949.438,71 |
| BB Ações ESG Globais | 0,00 | 671.093,86 | -541.420,23 | 129.673,63 | 8.779.569,02 |
| Caixa Ações BDR Nível I | 0,00 | 759.355,83 | -579.486,14 | 179.869,69 | 12.169.869,69 |



| Agosto | Saldo | % PL IPMU | Mês | Ano |
|-------------------------------|---------------|-----------|----------|----------|
| Caixa Gestão Estratégica | 60.330.793,73 | 14,420% | -1,4500% | -1,5130% |
| BB RF Alocação Ativa | 59.279.915,30 | 14,169% | -0,4490% | -1,3740% |
| Caixa Brasil IMA-B | 56.068.331,00 | 13,401% | -1,1370% | -2,3540% |
| Itaú Alocação Dinâmica | 53.128.737,70 | 12,699% | 0,3100% | 1,4700% |
| Títulos Públicos 2024 | 42.507.190,03 | 10,160% | -0,8500% | -1,7600% |
| Caixa FI Ações Small Caps | 18.466.316,07 | 4,414% | -5,0140% | 0,3040% |
| Caixa Infraestrutura | 17.825.673,59 | 4,261% | -1,7480% | -2,3930% |
| Bradesco Alocação | 17.180.264,52 | 4,106% | -0,5000% | -1,5000% |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | 13.051.368,25 | 3,120% | -2,3570% | -5,6760% |
| BB Alocação Retorno Total | 12.191.063,34 | 2,914% | -0,4550% | -0,9560% |
| Caixa Ações BDR Nível I | 12.169.869,69 | 2,909% | 2,4400% | 17,0100% |
| Santander Global Equities IE | 11.838.875,60 | 2,830% | 1,6700% | 14,8500% |
| BB IMA-B 5+ | 8.944.331,81 | 2,138% | -2,4100% | -5,5550% |
| BB Ações ESG Globais | 8.779.569,02 | 2,098% | 3,0000% | 17,0480% |
| Caixa Brasil RF Ativo | 8.022.801,51 | 1,918% | -1,4020% | -1,2970% |
| Santander Ativo (150) | 6.915.005,43 | 1,653% | 0,2300% | 1,3200% |
| BB P RF TP 2022 | 6.657.361,20 | 1,591% | 0,4520% | 3,3210% |
| Caixa Multigestor Equities IE | 3.136.800,05 | 0,750% | 0,8070% | 8,0680% |
| Santander Ativo (350) | 1.882.164,90 | 0,450% | 0,2300% | 1,3200% |

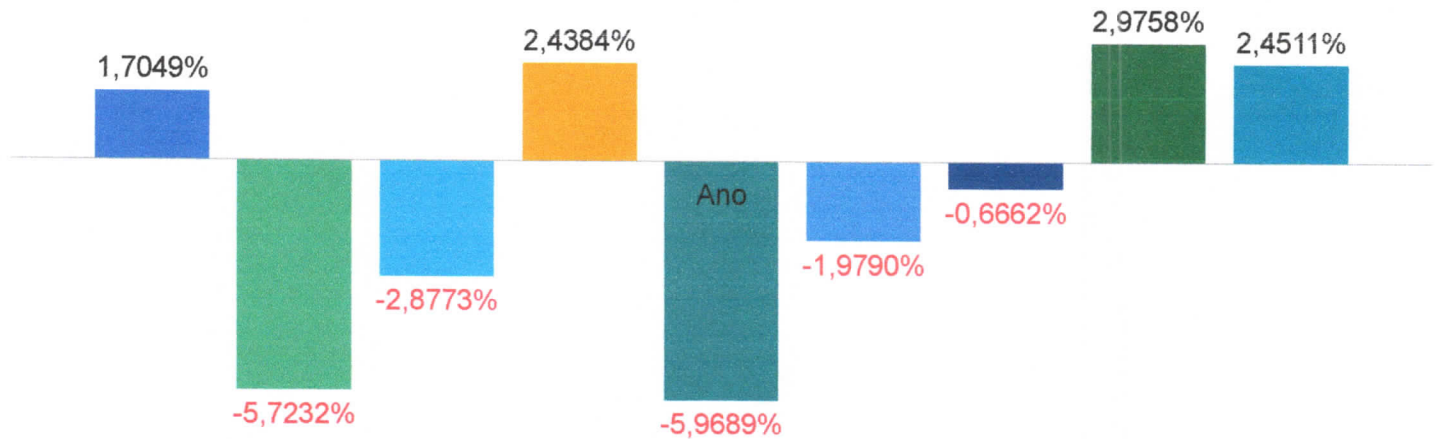


| RPPS | UF | Patrimônio | Renda Fixa | Renda Variável | Exterior | Meta Atuarial % | Meta Atuarial | Carteira | Mês |
|-----------------------|----|------------------|------------------|----------------|----------------|-----------------|---------------|----------|--------|
| Bertioga | SP | 643.149.587,69 | 428.636.822,21 | 178.009.284,84 | 36.503.480,64 | IPCA+5,46% | 9,46% | -0,93% | ago/21 |
| Caçador | SC | 144.722.449,57 | 74.529.311,36 | 55.289.060,28 | 14.904.077,93 | INPC+5,47% | 6,69% | 3,15% | jun/21 |
| Doutor Severiano | RN | 15.482.675,46 | 14.225.044,34 | 1.257.631,12 | 0 | IPCA+5,16% | - | - | jul/21 |
| Foz do Iguaçu | PR | 451.021.014,27 | 331.379.825,94 | 103.422.193,78 | 16.218.994,55 | - | 8,23% | 1,59% | jul/21 |
| Guarujá | SP | | | | | | | | |
| Guarulhos | SP | 610.415.547,13 | 365.317.599,21 | 184.480.563,14 | 60.617.384,78 | INPC+5,45% | 9,73% | 1,95% | ago/21 |
| Ilhabela | SP | 388.174.952,13 | 259.611.407,98 | 105.816.491,95 | 22.747.052,19 | IPCA+5,42% | 6,47% | 2,43% | jun/21 |
| Ipojuca | PE | 328.568.770,44 | 206.676.421,20 | 90.712.279,99 | 31.180.069,25 | IPCA+5,42% | 9,43% | 0,39% | ago/21 |
| Iraucuba | CE | 43.393.973,91 | 34.671.570,48 | 8.722.403,43 | 0,00 | IPCA+5,43% | 9,44% | -0,15% | ago/21 |
| João Pessoa | PB | 363.642.948,37 | 247.430.475,99 | 87.392.419,13 | 28.820.053,25 | IPCA+4,42% | 5,98% | 2,12% | jun/21 |
| Lucas do Rio Verde | MT | 198.750.045,32 | 155.559.442,54 | 42.687.450,51 | 503.152,27 | - | 8,28% | 0,16% | jul/21 |
| Manaus | AM | 1.232.055.619,80 | 594.874.723,94 | 516.152.584,66 | 121.028.311,20 | IPCA+5,44% | 8,00% | 2,45% | jul/21 |
| Navegantes | SC | 256.095.256,14 | 133.373.211,24 | 95.612.236,69 | 27.109.808,21 | IPCA+5,47% | 8,07% | 2,88% | jul/21 |
| Nilópolis | RJ | 8.177.745,96 | 6.519.346,93 | 1.335.367,04 | 323.031,99 | IPCA+5,42% | 7,99% | 0,12% | jul/21 |
| Piracaia | SP | 113.463.392,22 | 75.584.530,74 | 27.427.768,68 | 10.451.092,80 | IPCA+5,42% | 9,43% | 4,58% | ago/21 |
| Quatro Barras | PR | 70.994.823,75 | 59.187.913,14 | 11.806.910,61 | 0 | INPC+5,38% | 8,27% | -0,61% | ago/21 |
| São José do Rio Preto | SP | 397.596.140,62 | 252.053.173,74 | 109.203.369,22 | 36.339.597,66 | IPCA+5,41% | 9,43% | 1,71% | ago/21 |
| São José dos Campos | SP | 2.110.603.633,28 | 1.199.348.847,10 | 697.194.209,23 | 214.060.576,95 | IPCA+4,8% | 7,65% | 2,51% | jul/21 |
| Ubatuba | SP | 421.635.840,73 | 352.414.005,54 | 37.583.864,18 | 31.637.971,01 | INPC+5,41% | 8,24% | 0,25% | jul/21 |



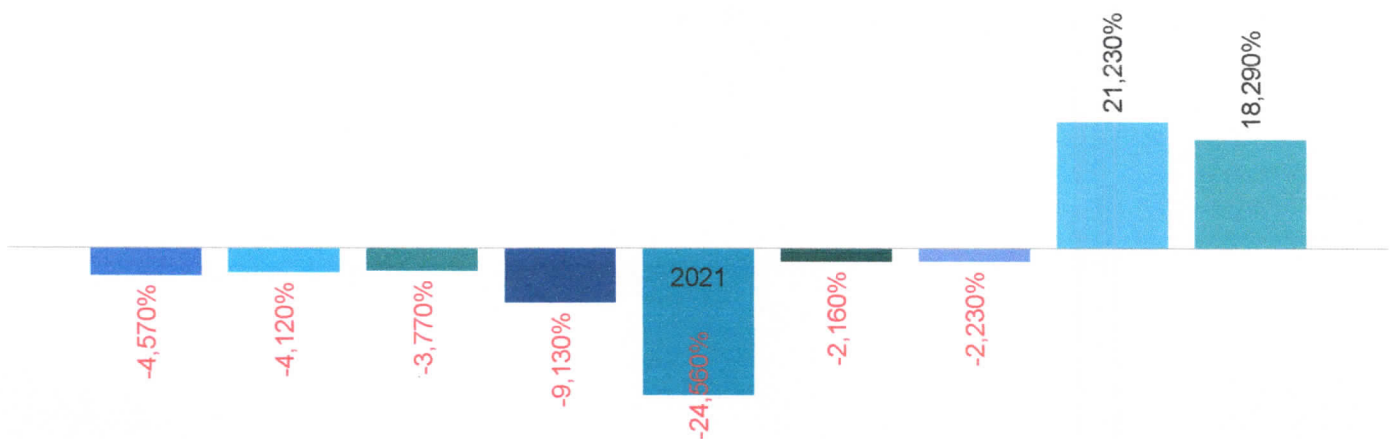
Principais indicadores de Renda Fixa 28/09/21

■ IRFM1 ■ IRFM 1+ ■ IRFM Total ■ IMA-B 5 ■ IMA-B 5+ ■ IMA-B Total ■ IMA-Geral ■ IDKA 2 ■ CDI



Principais indicadores de Renda Variável 28/09/2021

■ Ibovespa ■ IBRX-50 ■ IBRX-100 ■ Iconsumo ■ Imobiliário ■ Small Caps ■ Idividendos ■ BDRX ■ S&P 500





O mais recomendado para o atual momento é a cautela ao assumir posições mais arriscadas no curto prazo, a volatilidade nos mercados deve se manter sem ainda a desenhar um horizonte claro, em razão principalmente pelo nosso cenário político.

Alguns analistas financeiros mantem a recomendação de adotar cautela nos investimentos e acompanhamento dos mercados e estratégias.

- sugestão para que os recursos necessários para fazer frente às despesas correntes sejam resgatados dos investimentos menos voláteis (CDI, IRF-M1, IDkA IPCA 2A).
- para o IMA-B que é formado por títulos públicos indexados à inflação medida pelo IPCA, não recomendação de aporte no segmento, com a estratégia de alocação em 5%, sendo indicado para os RPPS que possuem porcentagem igual ou maior, aos que possuem porcentagem inferior a 5%, recomendação de não movimentação no segmento.
- para os RPPS que enxergam uma oportunidade de investir recursos a preços mais baratos, importante informações necessárias para subsidiar a tomada da decisão.

| | | | | |
|--------------------|---------------|---------|----------|----------|
| Caixa Brasil IMA-B | 56.068.331,00 | 13,401% | -1,1370% | -2,3540% |
|--------------------|---------------|---------|----------|----------|



Proposta para Estratégia de Investimentos

1) Fundos de renda variável: acompanhamento do mercado e aplicação, quando favorável e de forma gradativa, os repasses das contribuições previdenciárias, compensação previdenciária e parcelamento da dívida previdenciária, preferencialmente nos fundos enquadrados no Artigo 9º (investimento no exterior), por ser produto de investimento descorrelacionado do cenário local.

2) Fundos de renda fixa: acompanhamento do mercado e aplicação, quando favorável os repasses das contribuições previdenciárias, compensação previdenciária e parcelamento da dívida previdenciária, preferencialmente nos fundos híbridos do Banco Santander e do Banco Itaú.

3) Folha de Pagamento: para cobertura da folha de pagamento, realizar resgate do fundo de investimentos **Santander Renda Fixa Ativa** (CNPJ 26.507.132/001-06).

| | | | | |
|------------------------|---------------|---------|---------|---------|
| Santander Ativo (150) | 6.915.005,43 | 1,653% | 0,2300% | 1,3200% |
| Itaú Alocação Dinâmica | 53.128.737,70 | 12,699% | 0,3100% | 1,4700% |



Estratégia de Investimentos

4) Fundo IMA-B: acompanhamento do mercado e regate, quando favorável e de forma gradativa, para aplicação preferencialmente nos fundos híbridos do Banco Santander e do Banco Itaú.

5) Manutenção das aplicações, até a próxima reunião que deverá contar com análise de possíveis realocações de fundos com melhor desempenho no cenário de alta de juros e volatilidade nos mercados.

| Agosto | Saldo | % PL IPMU | Mês | Ano |
|---------------------------|---------------|-----------|----------|----------|
| Caixa Gestão Estratégica | 60.330.793,73 | 14,420% | -1,4500% | -1,5130% |
| BB RF Alocação Ativa | 59.279.915,30 | 14,169% | -0,4490% | -1,3740% |
| Caixa Brasil IMA-B | 56.068.331,00 | 13,401% | -1,1370% | -2,3540% |
| Itaú Alocação Dinâmica | 53.128.737,70 | 12,699% | 0,3100% | 1,4700% |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | 13.051.368,25 | 3,120% | -2,3570% | -5,6760% |
| BB Alocação Retorno Total | 12.191.063,34 | 2,914% | -0,4550% | -0,9560% |
| BB IMA-B 5+ | 8.944.331,81 | 2,138% | -2,4100% | -5,5550% |
| Caixa Brasil RF Ativo | 8.022.801,51 | 1,918% | -1,4020% | -1,2970% |
| Santander Ativo (150) | 6.915.005,43 | 1,653% | 0,2300% | 1,3200% |



Outubro 2021

| Domingo | Segunda-feira | Terça-feira | Quarta-feira | Quinta-feira | Sexta-feira | Sábado |
|---------|---------------|-------------|--------------|--------------|-------------|--------|
| | | | | | 1 | 2 |
| 3 | 4 | 5 | 6 | 7 | 8 | 9 |
| 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | 16 |
| 17 | 18 | 19 | 20 | 21 | 22 | 23 |
| 24 | 25 | 26 | 27 | 28 | 29 | 30 |
| 31 | | | | | | |

©MichelZbinden.com

Calendários Michel Zbinden / 489S

15/10 – Reunião Ordinária

Agendar Reuniões com os Gestores:

- Itaú
- Santander
- Caixa
- Bradesco

Agendar Reunião sobre títulos públicos

- XP Investimentos



Reunião Comitê de Investimentos 29/09/2021

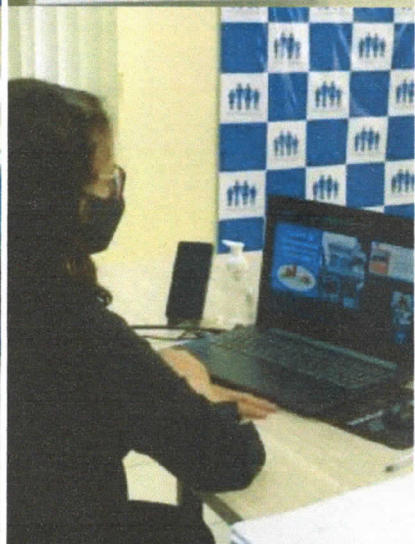
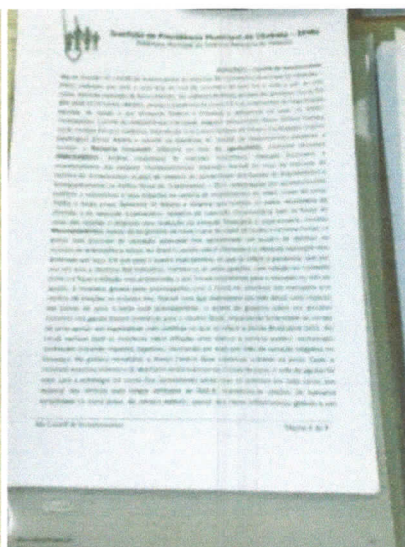
IPMU > Boas Práticas > Reunião Comitê de Investimentos 29/09/2021

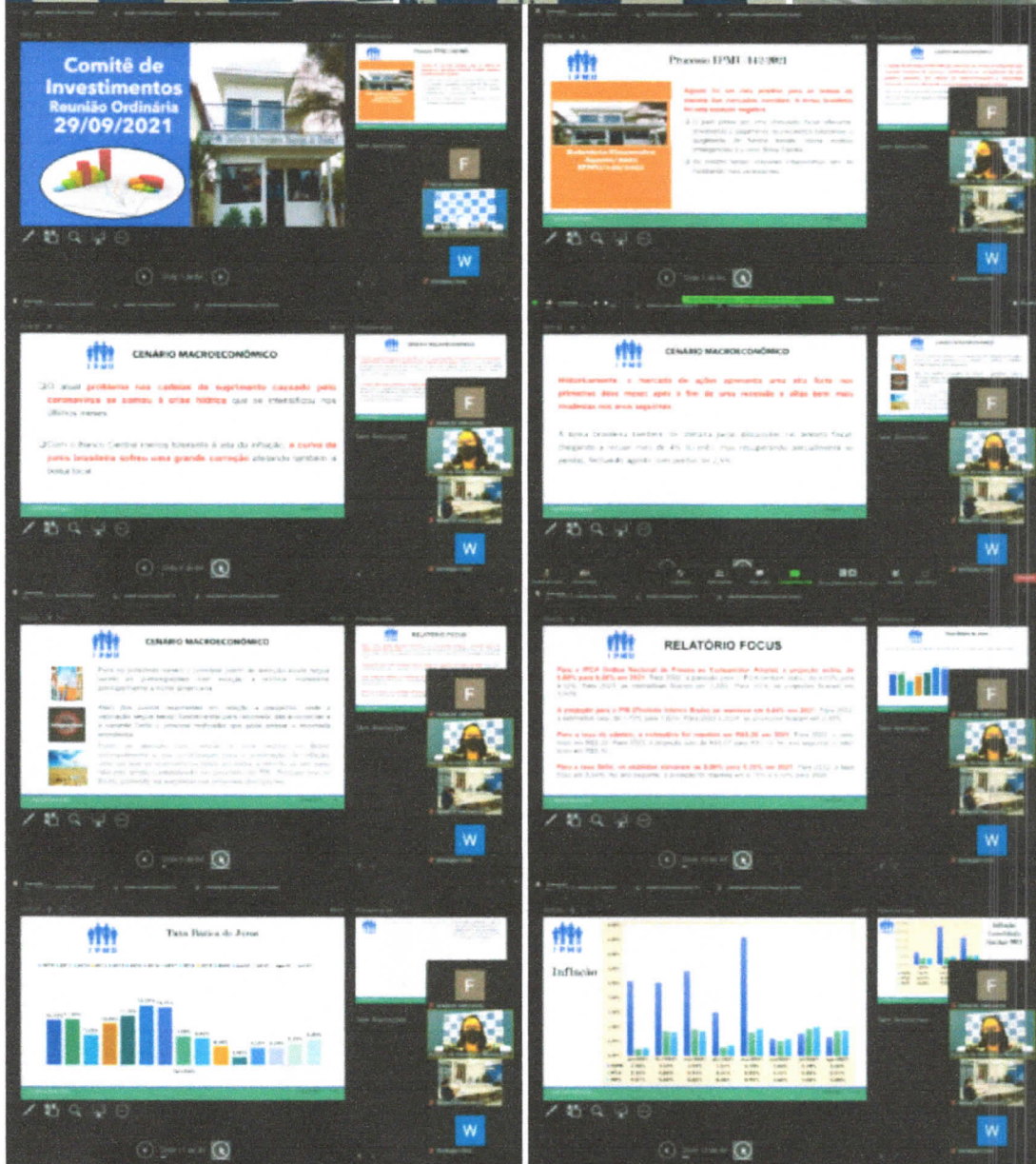
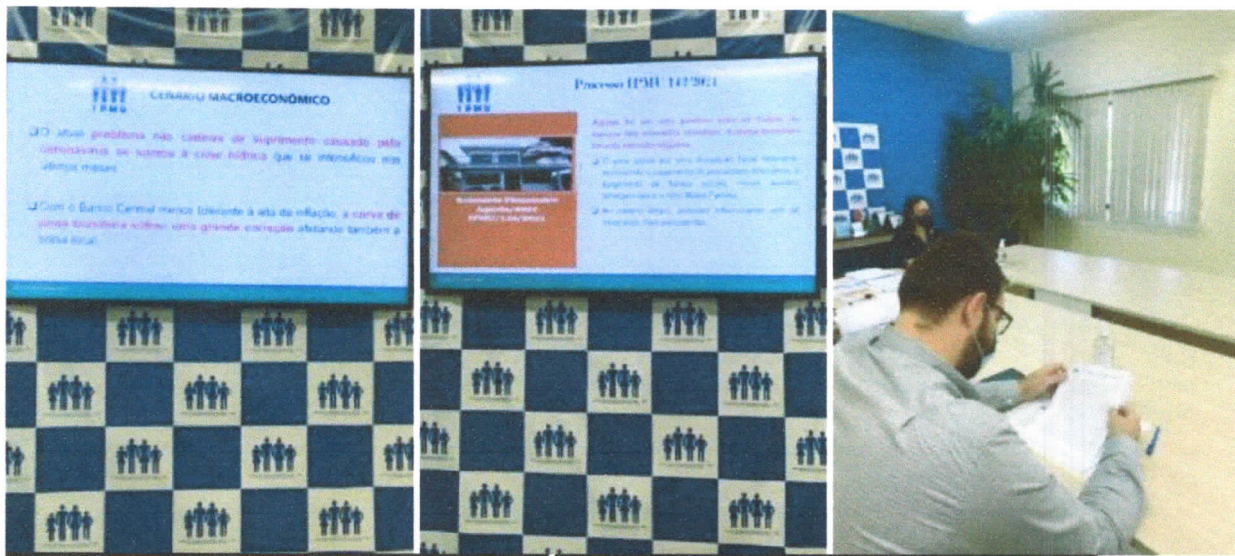
Postado em [Boas Práticas](#), [Notícias](#)Reunião Conselho de Administração –
24/09/2021

Reunião do Comitê de Investimentos do Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU, realizada aos vinte e nove dias do mês de setembro de dois mil e vinte e um, às oito horas. Reunião realizada de forma híbrida, por videoconferência, através do aplicativo Zoom (ID 889 2808 7477/ Senha 284345), devido à pandemia do Covid-19 e às orientações da Organização Mundial de Saúde e dos Governos Federal e Estadual e presencial na sede no IPMU. Participantes: Comitê de Investimentos (Fernando Augusto Matsumoto, Flavio Bellard Gomes, Lucas Gustavo Ferreira Castanho, Marcelo da Cruz Lima e Sirleide da Silva) e Controlador Interno (Wellington Diniz). Aberta a reunião os membros do Comitê de Investimentos passaram a analisar o Relatório Financeiro referente ao mês de agosto/2021, conforme processo IPMU/142/2021. Análise conjuntural de mercado econômico, mercado financeiro e monitoramento das variáveis macroeconômicas. Avaliação mensal de risco de mercado da carteira de Investimentos. Análise de relatório de rentabilidade dos fundos de investimentos e acompanhamento da Política Anual de Investimentos – 2021. Informações dos acontecimentos políticos e econômicos e seus impactos na carteira de investimentos do IPMU. Visão de curto, médio e longo prazo. Balancete de Receita e

Despesa que contém os dados atualizados da previsão e da execução orçamentária. Relatório de Execução Orçamentária com os fluxos de caixa das receitas e despesas para avaliação da situação financeira e orçamentária. Cenário Macroeconômico. Apesar do surgimento de novas cepas da covid-19 (como a variante Delta), os países com processo de vacinação adiantado têm apresentado um quadro de declínio no número de internações e óbitos. No Brasil o cenário não é diferente e o ritmo de vacinação tem acelerado por aqui. Em que pese o quadro mais positivo no que se refere à pandemia, que por sua vez leva a abertura dos mercados, mantêm-se as preocupações com relação ao contexto político e fiscal e inflação mais pressionada, o que trouxe volatilidade para o mercado no mês de agosto. A incerteza gerada pelas preocupações com o Covid-19, abertura dos mercados e o cenário de eleições no próximo ano, fizeram com que tivéssemos um mês difícil, com impacto nas curvas de juros e bolsa local principalmente. O aceno do governo sobre um possível aumento nos gastos trazem incertezas para o cenário fiscal, impactando fortemente as curvas de juros apesar das expectativas mais positivas no que se refere à Dívida Bruta para 2021. Na renda variável local as incertezas sobre inflação, crise hídrica e cenário político conturbado continuam trazendo impactos negativos, resultando em mais um mês de variação negativa no Ibovespa. Na política monetária, o Banco Central deve continuar subindo os juros. Dado o contexto macroeconômico e as aberturas ainda maiores nas curvas de juros, o mês de agosto foi ruim para a estratégia em renda fixa, aumentando ainda mais os prêmios em toda curva, em especial nos vértices mais longos atrelados ao IMA-B, mantendo-se cenário de bastante volatilidade no curto prazo. No cenário externo, apesar dos riscos inflacionários globais e um menor crescimento na China, o PIB Global deve apresentar um bom crescimento em 2021, face aos estímulos e maior abertura dos mercados nas principais economias do mundo. Carteira de Investimentos. No oitavo mês de 2021, os investimentos do IPMU apresentaram desvalorização, refletindo a instabilidade dos mercados financeiros no período. A carteira de investimentos encerrou em R\$ 418.376.432,74 (quatrocentos e dezoito milhões trezentos e setenta e seis mil quatrocentos e trinta e dois reais e setenta e quatro centavos). Composição dos Investimentos. A Carteira de Investimentos do IPMU no encerramento do mês é composta por 17 fundos de investimentos e Carteira de Títulos Públicos com vencimento para 2024. Está segregada entre os segmentos de renda fixa (82,74%), renda variável (8,67%) e alocação no exterior (8,59%), dentro dos limites permitidos pela Resolução CMN nº 3922/2010 e suas alterações, compatível com os requisitos estabelecidos na Política de Investimentos – PAI 2021. Enquadramento. Todos os investimentos do IPMU estão aderentes com relação à Resolução CMN 3922/2010 e suas alterações e com a Política de Investimentos para o exercício de 2021. Meta Atuarial. A rentabilidade consolidada no fechamento do período de janeiro/agosto foi negativa em (-0,48%) muito distante da meta atuarial (INPC + 5,41% a.a.) que encerrou o período em 9,70%. Relatório de Risco: Na análise do relatório de risco do mês, a demonstração apresentou os seguintes resultados: Renda Fixa (1,884%/VaR), Fundos de Renda Variável (10,173%/VaR), Fundos no Exterior (5,9583%/VaR) e Total da Carteira (1,935%/VaR). As planilhas de correlação, junto aos riscos apresentados por segmentos e o risco total da carteira do IPMU, estão em conformidade a nossa Política de Investimentos 2021. Deliberação do Comitê de Investimentos. A postura conservadora nos investimentos do IPMU não tem gerado resultados satisfatórios nos últimos meses. O atual cenário ainda é incerto e com volatilidade. Com base nos dados técnicos, análises financeiras e propostas de investimentos e desinvestimentos foram aprovadas por unanimidade as estratégias de investimentos, para alteração pontual da carteira de investimentos, em especial a continuidade da estratégia de aplicação em fundos de renda variável em bolsa local considerando que os investimentos no exterior (boa perspectiva para os investimentos no exterior pelo potencial retorno, menor volatilidade e, principalmente, pelo equilíbrio que esses investimentos trazem para a carteira dos RPPS) está no limite prudencial de aplicação para atendimento à legislação. 1) Fundos de renda variável: acompanhamento do mercado e aplicação, quando favorável e de forma gradativa, dos repasses das contribuições previdenciárias, compensação previdenciária e parcelamento da dívida previdenciária, nos fundos credenciados. 2) Fundos de renda fixa: acompanhamento do mercado e aplicação, quando favorável e de forma gradativa, dos

repasse das contribuições previdenciárias, compensação previdenciária e parcelamento da dívida previdenciária, nos fundos credenciados em especial nos fundos híbridos do Itaú e do Banco Santander que já fazem parte da Carteira de Investimentos. 3) Folha de Pagamento: para cobertura da folha de pagamento, realizar resgate do fundo de investimentos Santander Renda Fixa Ativa (CNPJ 26.507.132/0001-06). 4) Fundo IMA-B: acompanhamento do mercado e resgatar, quando favorável e de forma gradativa, para aplicação nos fundos credenciados em especial nos fundos híbridos do Itaú e do Banco Santander que já fazem parte da Carteira de Investimentos. 5) Reunião com Gestores: agendar reuniões virtuais com os gestores da Carteira de Investimentos. 6) Manutenção das aplicações, sem realizar realocação de recursos.





The image displays a grid of Zoom meeting windows. Each window shows a different slide from a presentation. The slides contain various financial data and text:

- Inflação Consolidada Jan. Ago. 2021:** A bar chart comparing inflation rates for IPMU, IPCA, and INPC across 2019, 2020, and 2021.

| Índice | 2019 | 2020 | 2021 |
|--------|-------|--------|--------|
| IPMU | 7,82% | 23,14% | 18,73% |
| IPCA | 4,21% | 4,32% | 5,47% |
| INPC | 4,48% | 5,43% | 5,94% |
- Para alguns analistas quem está na Bolsa não deve sair:** Text slide discussing market exit strategies and analyst opinions.
- Quem quer entrar, mas é o momento:** Text slide discussing market entry timing and investment opportunities.
- Desempenho dos Principais Indicadores de Renda Fixa e Renda Variável:** A chart showing performance metrics for fixed and variable income investments.
- NOTÍCIAS DO MERCADO FINANCEIRO:** A text slide providing news and updates from the financial market.
- CARTERA DE INVESTIMENTOS:** A pie chart representing the composition of the investment portfolio.
- Resultado dos Investimentos:** A table summarizing investment results.

| Item | Valor (R\$) | Valor (R\$) | Valor (R\$) |
|------|-------------|-------------|-------------|
| 2019 | 14.128.222 | 14.128.222 | 14.128.222 |
| 2020 | 14.128.222 | 14.128.222 | 14.128.222 |
| 2021 | 14.128.222 | 14.128.222 | 14.128.222 |
- Evolução Patrimonial:** A line chart showing the evolution of net worth over time.

The image displays a grid of 12 Microsoft Teams meeting windows, arranged in two columns and six rows. Each window shows a different slide from a financial presentation, along with a small video feed of a participant and a 'W' icon. The slides are as follows:

- Slide 1 (Top Left):** 'Resultado dos investimentos' - A table with columns for 'Ativo', 'Valor', 'Peso', 'Rendimento', and 'Risco'. It lists various assets like 'Bônus Fixo', 'Fundos de Investimento', etc.
- Slide 2 (Top Right):** 'Resultado dos investimentos - Perfil Terceiro' - A bar chart showing performance metrics for different asset classes.
- Slide 3 (Second Row Left):** 'Composição de carteira de investimentos' - A pie chart showing the distribution of investments across different asset classes.
- Slide 4 (Second Row Right):** 'Composição de carteira de investimentos' - A bar chart showing the composition of the investment portfolio.
- Slide 5 (Third Row Left):** 'Aplicação por segmentação' - A bar chart showing the application of investments across different segments.
- Slide 6 (Third Row Right):** 'Aplicação por segmentação' - A bar chart showing the application of investments across different segments.
- Slide 7 (Fourth Row Left):** 'Aplicação por segmentação' - A pie chart showing the application of investments across different segments.
- Slide 8 (Fourth Row Right):** 'Diversificação por classe de ativos' - A bar chart showing the diversification of investments across different asset classes.
- Slide 9 (Fifth Row Left):** 'Visão por grupo' - A pie chart showing the view of investments by group.
- Slide 10 (Fifth Row Right):** 'Meta Atuarial' - A bar chart showing the actuarial goal.
- Slide 11 (Bottom Row Left):** 'Meta Atuarial' - A line chart showing the actuarial goal over time.
- Slide 12 (Bottom Row Right):** 'Meta Atuarial e Bônus Fixa' - A bar chart showing the actuarial goal and fixed bonus.

The image displays a grid of Zoom meeting windows, each showing a slide from a presentation. The slides cover various financial and investment topics:

- Mix Inicial e Bonds Variável**: A bar chart showing the initial mix of investments.
- Value at Risk (VaR)**: A slide explaining VaR as a risk indicator, showing a table with columns for 'Mês', 'VaR', and 'Limite'.
- Análise de liquidez**: A table with columns for 'Período', 'Valor (R\$)', and '%'. It shows data for periods like 'de 0 a 30 dias' and 'de 31 a 90 dias'.
- Carteira Sugerida**: A slide titled 'Carteira Sugerida' with a table of suggested investments.
- Deliberações**: A slide with a graphic of people around a globe, indicating meeting decisions.
- Principais indicadores de Renda Fixa 2020/21**: A bar chart showing key fixed income indicators for 2020/21.

Each window also shows a small video feed of a participant and a 'W' icon, indicating a watermark or logo.

The image displays a grid of 12 screenshots from a Microsoft Teams meeting. Each screenshot shows a slide from a presentation, with a small video feed of a participant in the bottom right corner. The slides are organized into two columns and six rows.

- Row 1:** The first slide is titled "Principais indicadores do Fundo Variável (2019-2021)" and features a bar chart showing performance over time. The second slide shows a table with financial data.
- Row 2:** The first slide shows a line graph with data points. The second slide displays a table with financial figures.
- Row 3:** The first slide shows a table with financial data. The second slide contains a block of text, likely a summary or key points.
- Row 4:** The first slide is titled "Proposta para Estratégia de Investimentos" and contains several bullet points. The second slide is also titled "Proposta para Estratégia de Investimentos" and contains more text.
- Row 5:** The first slide is titled "Proposta para Estratégia de Investimentos" and contains several bullet points. The second slide is also titled "Proposta para Estratégia de Investimentos" and contains more text.
- Row 6:** The first slide is titled "Estratégia de Investimentos" and features a large table with multiple columns of data. The second slide shows a table with financial data.



Carteira de Investimentos Agosto/2021



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

BOLETIM DE CAIXA

ago/21

| | |
|-----------------|-----------|
| Conta Movimento | 19.500,89 |
|-----------------|-----------|

| | |
|--------------|-----------|
| Banco Santos | 15.016,47 |
|--------------|-----------|

| | |
|---------------|----------------|
| Investimentos | 418.376.432,74 |
|---------------|----------------|

| |
|----------------|
| 418.410.950,10 |
|----------------|



Demonstração dos Saldos Bancários - Data: 31/08/2021

| Nº CONTA | BANCO | FINANCEIRO | PATRIMONIAL | TOTAL | |
|------------------------|---------------|---|---------------|----------------|---------------|
| TESOURARIA | | | | | |
| 1 | - | TESOURARIA (CAIXA) | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| CONTA MOVIMENTO | | | | | |
| 1001 | 45000150-8 | BANCO SANTANDER SA - CONTA MOVIMENTO | 11.348,28 | 0,00 | 11.348,28 |
| 1002 | 00000020-4 | CAIXA ECONOMICA FEDERAL | 5.451,37 | 0,00 | 5.451,37 |
| 1003 | 45000149-8 | BANESPA - COMPENSAÇÃO PREVIDENCIÁRIA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 1004 | 45000350-0 | BANCO SANTANDER SA - TAXA ADMINISTRAÇÃO | 2.701,24 | 0,00 | 2.701,24 |
| 1005 | 000034281-1 | BANCO ITAÚ SA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 1007 | 000026907-7 | BANCO BRADESCO | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 1009 | 130215-9 | BANCO DO BRASIL SA | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 1010 | 40330-7 | BANCO ITAÚ S.A. | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| SUB TOTAL | | 19.500,89 | 0,00 | 19.500,89 | |
| CONTA VINCULADA | | | | | |
| 2004 | 130215-9 | BB PREVIDENCIARIO RF TP XI FI | 5.427.697,33 | 1.229.663,87 | 6.657.361,20 |
| 2008 | 0586197-7 | BANCO ESPÍTIRO SANTO - BESF - B.SANTOS - FIF | 15.016,47 | 0,00 | 15.016,47 |
| 2009 | 130215-9 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA ALOCAÇÃO ATIVA | 49.220.384,03 | 10.059.531,27 | 59.279.915,30 |
| 2010 | 0130215-9 | BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B 5 + TP | 7.161.414,84 | 1.782.916,97 | 8.944.331,81 |
| 2011 | 0130215-9 | BB PREVID. RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 12.000.000,00 | 191.063,34 | 12.191.063,34 |
| 2012 | 013215-9 | BB AÇÕES FIC FI BDR AÇÕES NÍVEL I | 8.649.895,39 | 129.673,63 | 8.779.569,02 |
| 2042 | 00000020-4 | CEF TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-C 2021 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 2043 | 0000000020-4 | CEF TÍTULOS PÚBLICOS - NTN-B 2024 | 38.643.016,20 | 3.864.173,83 | 42.507.190,03 |
| 2049 | 00000020-4 | CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS LP | 12.758.082,62 | 293.285,63 | 13.051.368,25 |
| 2050 | 00000020-4 | CAIXA FI BRASIL IMAB TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 41.647.817,33 | 14.420.513,67 | 56.068.331,00 |
| 2052 | 40330-7 | ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI | 48.764.911,22 | 4.363.826,48 | 53.128.737,70 |
| 2054 | 45000150-8 | SANTANDER ATIVO RF CONTA PREVIDENCIÁRIA | 6.872.550,97 | 42.454,46 | 6.915.005,43 |
| 2055 | 45000150-8 | SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TP - RF | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 2056 | 45000350-0 | SANTANDER ATIVO RF FIC | 1.825.523,59 | 56.641,31 | 1.882.164,90 |
| 2057 | 45000150-8 | SANTANDER FI GLOBAL EQUITIES MULT. INV. EXT. | 12.018.000,00 | -179.124,40 | 11.838.875,60 |
| 2064 | 00000020-4 | CAIXA FIC BRASIL RF ATIVA LP | 8.020.000,00 | 2.801,51 | 8.022.801,51 |
| 2065 | 00600000020-4 | CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RENDA FIXA | 46.688.027,43 | 13.642.766,30 | 60.330.793,73 |
| 2066 | 00000020-4 | CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO | 16.531.000,00 | 1.935.316,07 | 18.466.316,07 |
| 2067 | 00000020-4 | CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA | 16.401.000,00 | 1.424.673,59 | 17.825.673,59 |
| 2068 | 00000020-4 | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 11.990.000,00 | 179.869,69 | 12.169.869,69 |
| 2069 | 0000620-4 | CAIXA MULTIM. MULTIGESTOR GLOB. EQUITES INV. EXT. | 3.085.000,00 | 51.800,05 | 3.136.800,05 |
| 2073 | 26907-7 | BRADESCO FIC FI RENDA FIXA ALOCAÇÃO DINÂMICA | 16.162.706,63 | 1.017.557,89 | 17.180.264,52 |
| SUB TOTAL | | 363.882.044,05 | 54.509.405,16 | 418.391.449,21 | |
| TOTAL GERAL | | 363.901.544,94 | 54.509.405,16 | 418.410.950,10 | |

UBATUBA, 31 de Agosto de 2021

Fernando Augusto Matsumoto
CRC nº 1SP233378/O-3
Diretor Financeiro do IPMU

Wellington Diniz
CRC nº 1SP316207/O-5
Depto. Contabilidade

Sirleide da Silva
CPF 133.339.578-76
Presidente do IPMU

VÍNCULOS:

3.1 - INSTITUTO DE PREVIDENCIA MUNICIPAL DE UBATUBA



:: LÂMINA COMPARAÇÃO ATIVOS

30/08/2021

| Resumo | Nome | Retorno (%) | | | | PL Médio | Aplicação Mínima | Início do Fundo | Taxa de Administração | Taxa de Performance | Ano |
|--|------|-------------|--------|----------|----------|----------------------|------------------|-----------------|-----------------------|---------------------|-----|
| | | Mês | Ano | 06 meses | 12 meses | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | |
| Portfólio - Art. 7º, I, b | | -0,85 | -1,76 | 0,33 | 1,83 | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -66,28 | -18,22 | 4,41 | 11,14 | - | - | - | - | - | |
| Portfólio - Art. 7º, IV, a | | 0,04 | 0,61 | 1,03 | 1,45 | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 3,27 | 6,36 | 13,80 | 8,83 | - | - | - | - | - | |
| Portfólio - Art. 8º, II, a | | -2,27 | 0,17 | 8,77 | 14,00 | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -176,89 | 1,75 | 117,50 | 85,42 | - | - | - | - | - | |
| Portfólio Art. 7º, I, a | | 0,16 | 0,25 | 2,25 | 3,82 | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 12,31 | 2,56 | 30,11 | 23,33 | - | - | - | - | - | |
| Portfólio Art. 9º-A, II - Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior | | 1,55 | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 120,67 | - | - | - | - | - | - | - | - | |
| Portfólio Art. 9º-A, III - Fundo de Ações BDR Nível 1 | | 3,63 | - | 5,17 | - | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 282,58 | - | 69,30 | - | - | - | - | - | - | |
| Portfólio Carteira IPMU 2021 | | -0,40 | -0,15 | 1,48 | 3,68 | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -31,08 | -1,57 | 19,89 | 22,48 | - | - | - | - | - | |
| Portfólio Exterior 2021 | | 2,73 | - | 2,59 | - | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 212,98 | - | 34,71 | - | - | - | - | - | - | |
| Portfólio Renda Fixa 2021 | | -0,47 | -0,19 | 0,91 | 3,02 | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -36,46 | -2,00 | 12,13 | 18,43 | - | - | - | - | - | |
| Portfólio Renda Variável 2021 | | -2,27 | 0,17 | 8,77 | 14,00 | - | - | - | - | - | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -176,89 | 1,75 | 117,50 | 85,42 | - | - | - | - | - | |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | -0,28 | -1,21 | 0,59 | 1,22 | R\$ 9.325.802.081,66 | R\$ 1.000.000,00 | 31/08/2016 | 0,30% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -21,79 | -12,52 | 7,91 | 7,47 | - | - | - | - | - | |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | -0,31 | -0,81 | 0,93 | 1,98 | R\$ 3.650.962.299,63 | R\$ 10.000,00 | 16/03/2020 | 0,30% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -24,31 | -8,45 | 12,52 | 12,10 | - | - | - | - | - | |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | | 2,21 | 16,29 | 11,88 | - | R\$ 187.256.008,48 | R\$ 0,00 | 30/11/2020 | 1,00% | 10,00% | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 172,14 | 169,15 | 159,13 | - | - | - | - | - | - | |
| BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I | | 4,18 | 19,08 | 6,13 | 16,21 | R\$ 1.257.035.224,36 | R\$ 200,00 | 22/01/2015 | 0,50% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 325,65 | 198,03 | 82,09 | 98,89 | - | - | - | - | - | |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | | 4,09 | 18,29 | 5,60 | 14,91 | R\$ 926.563.349,46 | R\$ 0,00 | 29/12/2015 | 1,00% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 318,86 | 189,85 | 74,96 | 90,97 | - | - | - | - | - | |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES | | -1,08 | 4,76 | 14,29 | 27,40 | R\$ 298.089.444,30 | R\$ 0,00 | 12/12/2011 | 1,00% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -83,98 | 49,41 | 191,47 | 167,18 | - | - | - | - | - | |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO | | 1,36 | 18,11 | 2,70 | 23,50 | R\$ 1.873.346.955,80 | R\$ 250.000,00 | 04/10/2013 | 0,08% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 105,87 | 187,98 | 36,20 | 143,37 | - | - | - | - | - | |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | 0,27 | 1,77 | 2,29 | 5,37 | R\$ 9.504.159.270,86 | R\$ 10.000,00 | 28/04/2011 | 0,20% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 20,87 | 18,42 | 30,64 | 32,77 | - | - | - | - | - | |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | | 0,23 | 1,43 | 2,11 | 4,88 | R\$ 5.496.447.822,29 | R\$ 1.000,00 | 17/12/1999 | 0,20% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | 18,28 | 14,83 | 28,31 | 29,76 | - | - | - | - | - | |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | -1,55 | -4,88 | 0,14 | 1,89 | R\$ 1.401.530.769,72 | R\$ 10.000,00 | 28/04/2011 | 0,20% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -120,41 | -50,68 | 1,86 | 11,56 | - | - | - | - | - | |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES | | -1,38 | 1,45 | 10,97 | 22,48 | R\$ 936.357.213,03 | R\$ 0,00 | 23/03/2006 | 1,00% | 20,00% | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -107,64 | 15,02 | 146,94 | 137,16 | - | - | - | - | - | |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | | -1,87 | 5,94 | 9,05 | 19,65 | R\$ 1.620.918.022,11 | R\$ 0,00 | 02/10/2007 | 1,00% | Não possui | |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | | -146,03 | 61,65 | 121,19 | 119,92 | - | - | - | - | - | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | 0,42 | 3,29 | 2,95 | 6,69 | R\$ 201.882.023,00 | R\$ 300.000,00 | 14/03/2016 | 0,20% | Não possui | |



:: LÂMINA COMPARAÇÃO ATIVOS

30/08/2021

| | | | | | | | | | | | |
|--|---------|--------|--------|--------|-----------------------|---------------|------------|-------|------------|---|---|
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 32,67 | 34,12 | 39,48 | 40,82 | - | - | - | - | - | - | - |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | -0,26 | -1,25 | 0,63 | 0,80 | R\$ 1.432.331.480,49 | R\$ 50.000,00 | 28/12/2017 | 0,40% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -20,22 | -13,02 | 8,49 | 4,87 | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | -1,38 | -1,27 | -0,72 | -0,15 | R\$ 927.685.596,69 | R\$ 50.000,00 | 15/04/2020 | 0,40% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -107,27 | -13,19 | -9,58 | -0,94 | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | -1,38 | -1,45 | -0,85 | 0,25 | R\$ 15.562.898.695,48 | R\$ 1.000,00 | 04/11/2016 | 0,40% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -107,87 | -15,03 | -11,33 | 1,55 | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,67 | -5,02 | 0,04 | 1,92 | R\$ 1.598.805.992,60 | R\$ 1.000,00 | 18/04/2012 | 0,20% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -130,31 | -52,06 | 0,51 | 11,74 | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,72 | -1,94 | 1,12 | 3,36 | R\$ 5.946.535.863,76 | R\$ 1.000,00 | 08/03/2010 | 0,20% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -56,34 | -20,19 | 15,01 | 20,52 | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | -0,65 | -1,30 | 9,54 | 12,23 | R\$ 507.139.891,57 | R\$ 100,00 | 19/04/2010 | 2,00% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -50,25 | -13,46 | 127,81 | 74,65 | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 3,19 | 17,88 | 4,91 | 15,62 | R\$ 2.763.901.551,07 | R\$ 1.000,00 | 24/06/2013 | 0,70% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 248,87 | 185,62 | 65,71 | 95,33 | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 0,93 | 8,20 | -3,77 | - | R\$ 127.956.886,59 | R\$ 25.000,00 | 11/11/2020 | 1,00% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 72,53 | 85,12 | -50,54 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | -3,79 | 1,60 | 8,04 | 15,72 | R\$ 1.200.070.790,56 | R\$ 1.000,00 | 01/11/2012 | 1,50% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -295,07 | 16,60 | 107,64 | 95,90 | - | - | - | - | - | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,39 | 1,55 | 1,34 | 1,74 | R\$ 3.535.863.536,67 | R\$ 5.000,00 | 01/06/2015 | 0,40% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 30,07 | 16,14 | 17,99 | 10,63 | - | - | - | - | - | - | - |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,25 | 1,35 | 1,49 | 1,92 | R\$ 923.187.965,24 | R\$ 50.000,00 | 09/05/2017 | 0,40% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 19,83 | 14,04 | 19,99 | 11,71 | - | - | - | - | - | - | - |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 1,67 | 14,85 | 0,18 | 18,53 | R\$ 1.756.647.232,89 | R\$ 50.000,00 | 09/09/2013 | 1,00% | Não possui | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 130,28 | 154,19 | 2,35 | 113,04 | - | - | - | - | - | - | - |
| NTN-B 760199 20240815 | 0,16 | 0,25 | 2,25 | 3,82 | - | - | - | - | - | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 12,31 | 2,56 | 30,11 | 23,33 | - | - | - | - | - | - | - |
| Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 1,28 | 9,63 | 7,47 | 16,39 | - | - | - | - | - | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | - | - | - | - | - | - | - |

Retorno Mensal (%)

| Nome | jul/21 | jun/21 | mai/21 | abr/21 | mar/21 | fev/21 | jan/21 | dez/20 | nov/20 | out/20 | set/20 | ago/20 |
|--|---------|---------|---------|--------|--------|---------|---------|--------|----------|---------|---------|---------|
| Portfólio - Art. 7º, I, b | -0,47 | 0,24 | 0,67 | 0,61 | -0,28 | -1,09 | -0,57 | 3,32 | 1,39 | 0,05 | -1,12 | -1,37 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -31,90 | 22,63 | 47,48 | 76,48 | -20,73 | -91,15 | -82,79 | 172,28 | 101,41 | 3,43 | -85,55 | -171,24 |
| Portfólio - Art. 7º, IV, a | 0,02 | 0,26 | 0,34 | 0,28 | 0,00 | -0,27 | -0,05 | 0,87 | 0,29 | 0,00 | -0,37 | -0,30 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 1,21 | 24,55 | 24,18 | 34,64 | -0,36 | -22,17 | -7,17 | 45,24 | 20,98 | -0,47 | -28,35 | -37,89 |
| Portfólio - Art. 8º, II, a | -4,22 | 0,31 | 5,78 | 3,12 | 5,44 | -3,59 | -3,80 | 7,96 | 14,97 | -2,32 | -5,56 | -2,51 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -284,31 | 29,97 | 411,93 | 389,83 | 404,31 | -299,28 | -550,01 | 413,09 | 1.089,99 | -173,74 | -423,33 | -313,24 |
| Portfólio Art. 7º, I, a | -0,16 | -0,31 | 0,55 | 1,51 | 0,09 | -1,42 | -0,14 | 2,56 | 1,58 | -0,17 | -0,75 | -0,22 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -11,03 | -29,50 | 39,21 | 188,21 | 6,76 | -118,35 | -20,95 | 132,62 | 114,77 | -12,39 | -57,33 | -27,10 |
| Portfólio Art. 9º-A, II - Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior | 5,04 | -2,42 | -3,49 | 1,18 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 339,09 | -232,06 | -248,64 | 148,00 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Portfólio Art. 9º-A, III - Fundo de Ações BDR Nível 1 | 5,34 | -1,72 | -3,29 | 0,51 | 3,46 | - | - | - | - | - | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 359,27 | -165,04 | -234,42 | 64,29 | 256,98 | - | - | - | - | - | - | - |
| Portfólio Carteira IPMU 2021 | -0,26 | 0,03 | 0,69 | 0,68 | 0,43 | -0,92 | -0,39 | 2,63 | 1,84 | 0,05 | -0,78 | -0,78 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -17,74 | 2,97 | 49,43 | 84,75 | 31,84 | -76,43 | -56,84 | 136,63 | 134,35 | 3,90 | -59,07 | -97,30 |
| Portfólio Exterior 2021 | 5,21 | -2,02 | -3,36 | 0,75 | 2,07 | - | - | - | - | - | - | - |



:: LÂMINA COMPARAÇÃO ATIVOS

30/08/2021

| | | | | | | | | | | | | |
|---|---------|---------|---------|--------|--------|---------|---------|--------|----------|---------|---------|----------|
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 350,71 | -193,94 | -239,00 | 93,05 | 153,57 | - | - | - | - | - | - | - |
| Portfólio Renda Fixa 2021 | -0,29 | 0,18 | 0,56 | 0,62 | 0,03 | -0,67 | -0,13 | 2,28 | 1,21 | 0,19 | -0,56 | -0,73 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -19,73 | 17,13 | 39,59 | 77,03 | 2,07 | -56,18 | -18,67 | 118,15 | 87,82 | 14,30 | -43,00 | -91,10 |
| Portfólio Renda Variável 2021 | -4,22 | 0,31 | 5,78 | 3,12 | 5,44 | -3,59 | -3,80 | 7,96 | 14,97 | -2,32 | -5,56 | -2,51 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -284,31 | 29,97 | 411,93 | 389,83 | 404,31 | -299,28 | -550,01 | 413,09 | 1.089,99 | -173,74 | -423,33 | -313,24 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,25 | 0,11 | 0,48 | 0,62 | -0,42 | -0,91 | -0,55 | 2,38 | 0,85 | -0,07 | -0,75 | -0,89 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -16,80 | 10,69 | 34,24 | 77,62 | -31,28 | -76,15 | -80,03 | 123,41 | 61,76 | -5,27 | -57,28 | -110,87 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,11 | 0,05 | 0,60 | 0,71 | -0,34 | -0,93 | -0,47 | 2,70 | 1,01 | -0,07 | -0,88 | -1,05 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -7,48 | 4,49 | 42,82 | 88,37 | -25,62 | -77,35 | -67,54 | 139,88 | 73,40 | -5,40 | -66,85 | -130,75 |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 1,33 | 0,52 | 1,76 | 4,17 | 2,58 | 2,28 | 0,44 | 3,56 | - | - | - | - |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 89,54 | 49,75 | 125,19 | 521,08 | 191,66 | 189,75 | 64,27 | 184,83 | - | - | - | - |
| BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 5,33 | -2,25 | -2,63 | 0,38 | 3,83 | 4,08 | 5,09 | 0,68 | 2,10 | -1,74 | -2,33 | 14,82 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 359,05 | -215,39 | -187,35 | 47,77 | 284,84 | 339,88 | 737,26 | 35,40 | 153,03 | -130,22 | -177,38 | 1.848,85 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 5,24 | -2,33 | -2,71 | 0,30 | 3,74 | 4,00 | 5,00 | 0,59 | 2,01 | -1,87 | -2,46 | 14,67 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 352,87 | -223,23 | -193,17 | 37,75 | 277,70 | 333,62 | 725,01 | 30,74 | 146,56 | -140,19 | -187,39 | 1.829,61 |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES | -3,10 | -1,11 | 7,04 | 6,93 | 5,16 | -4,66 | -3,68 | 6,64 | 14,53 | 1,43 | -1,49 | -3,07 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -208,66 | -106,24 | 501,30 | 865,04 | 382,94 | -388,67 | -533,50 | 344,61 | 1.058,17 | 106,86 | -113,71 | -382,39 |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO | 6,75 | -4,61 | -2,01 | 0,98 | 3,86 | 6,15 | 4,90 | 1,09 | 8,61 | -1,86 | -1,16 | 11,70 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 454,44 | -442,57 | -142,93 | 122,58 | 286,44 | 512,73 | 709,57 | 56,74 | 627,35 | -139,33 | -88,19 | 1.459,61 |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,08 | -0,09 | 0,67 | 0,84 | 0,37 | -0,55 | 0,18 | 1,53 | 1,34 | 0,33 | 0,11 | 0,69 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 5,62 | -8,97 | 47,78 | 104,90 | 27,49 | -45,68 | 25,64 | 79,14 | 97,60 | 24,63 | 8,69 | 85,59 |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,02 | -0,19 | 0,69 | 0,87 | 0,32 | -0,61 | 0,10 | 1,81 | 1,31 | 0,19 | -0,15 | 0,37 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 1,52 | -17,82 | 48,79 | 108,35 | 23,89 | -51,21 | 13,98 | 93,73 | 95,60 | 13,99 | -11,69 | 45,75 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,78 | 0,77 | 1,35 | 0,48 | -1,19 | -2,32 | -1,70 | 7,47 | 2,49 | 0,20 | -2,65 | -3,69 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -52,26 | 73,63 | 96,38 | 59,42 | -88,35 | -193,12 | -245,74 | 387,74 | 181,65 | 15,35 | -201,44 | -460,10 |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES | -2,78 | -0,80 | 5,81 | 2,53 | 8,73 | -4,85 | -4,97 | 10,42 | 16,82 | -0,66 | -4,94 | -1,31 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -187,22 | -76,55 | 413,55 | 316,55 | 648,23 | -403,77 | -719,96 | 540,67 | 1.224,87 | -49,55 | -376,15 | -163,90 |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | -4,45 | -0,26 | 2,60 | 7,96 | 7,08 | -1,35 | -3,18 | 7,99 | 11,70 | -0,20 | -5,40 | -3,34 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -299,57 | -24,66 | 184,81 | 994,06 | 525,80 | -112,61 | -460,05 | 414,26 | 852,16 | -15,17 | -411,06 | -416,10 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,66 | 0,35 | 0,75 | 0,41 | 0,39 | -0,01 | 0,29 | 1,21 | 1,17 | 0,49 | 0,19 | 0,82 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 44,18 | 33,40 | 53,18 | 50,79 | 29,12 | -1,06 | 41,46 | 62,78 | 85,43 | 37,04 | 14,62 | 102,81 |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | -0,20 | 0,33 | 0,42 | 0,53 | -0,54 | -0,96 | -0,58 | 2,48 | 0,78 | -0,28 | -0,98 | -0,86 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -13,47 | 31,74 | 30,20 | 66,57 | -40,26 | -79,82 | -83,93 | 128,63 | 57,04 | -20,84 | -74,84 | -107,29 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | -0,61 | 0,11 | 0,20 | 0,52 | 0,33 | -0,52 | 0,08 | 1,00 | 0,68 | -0,12 | -0,59 | -0,35 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -40,85 | 10,11 | 14,03 | 65,54 | 24,31 | -43,19 | 12,10 | 51,99 | 49,18 | -8,73 | -44,57 | -43,83 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | -0,78 | 0,00 | 0,24 | 0,66 | 0,30 | -0,51 | 0,03 | 1,32 | 0,82 | -0,11 | -0,50 | -0,56 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -52,20 | -0,29 | 17,00 | 83,00 | 22,36 | -42,29 | 3,66 | 68,51 | 59,72 | -8,08 | -38,30 | -69,50 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,76 | 0,77 | 1,39 | 0,45 | -1,20 | -2,35 | -1,70 | 7,56 | 2,57 | 0,22 | -2,64 | -3,64 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -51,48 | 74,06 | 99,07 | 56,22 | -88,78 | -195,76 | -245,82 | 392,32 | 186,84 | 16,33 | -201,16 | -454,50 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,40 | 0,40 | 1,04 | 0,63 | -0,47 | -1,54 | -0,87 | 4,84 | 1,99 | 0,19 | -1,53 | -1,83 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -26,83 | 38,49 | 74,25 | 78,72 | -35,27 | -128,36 | -126,42 | 251,09 | 144,83 | 14,51 | -116,70 | -228,34 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | -3,09 | -0,52 | 4,89 | 1,81 | 6,20 | -5,23 | -4,12 | 8,33 | 14,19 | -2,24 | -5,18 | -3,66 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -208,30 | -49,92 | 348,02 | 226,48 | 460,31 | -435,46 | -596,75 | 432,27 | 1.033,48 | -167,62 | -394,37 | -455,98 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 5,42 | -1,19 | -3,79 | 0,61 | 3,43 | 3,55 | 5,79 | 0,69 | 2,43 | -1,77 | -1,99 | 15,16 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 364,83 | -113,98 | -270,20 | 76,48 | 254,63 | 295,52 | 838,51 | 35,98 | 176,99 | -132,83 | -151,79 | 1.891,54 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 4,05 | 0,21 | -4,81 | 1,65 | -1,27 | 3,46 | 4,02 | 1,45 | - | - | - | - |



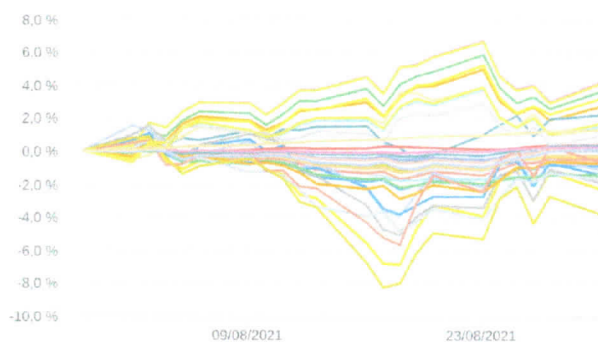
:: LÂMINA COMPARAÇÃO ATIVOS

30/08/2021

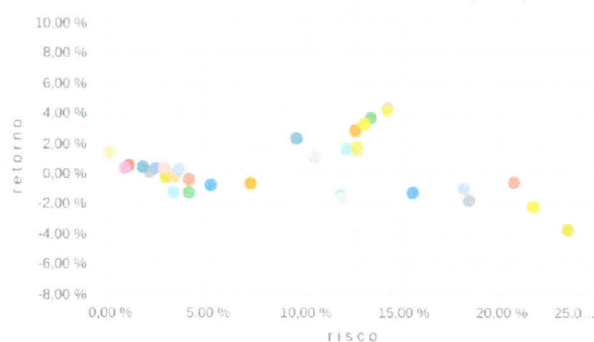
| | | | | | | | | | | | | |
|--|---------|---------|---------|--------|--------|---------|---------|--------|----------|---------|---------|----------|
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 272,48 | 19,95 | -342,63 | 206,65 | -94,31 | 288,62 | 582,43 | 75,45 | - | - | - | - |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | -5,25 | 1,09 | 6,62 | 4,37 | 4,73 | -1,99 | -3,48 | 7,60 | 15,73 | -2,40 | -5,93 | -1,38 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -353,48 | 104,21 | 471,69 | 546,32 | 351,41 | -166,18 | -504,08 | 394,22 | 1.145,53 | -180,20 | -451,10 | -172,78 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,16 | 0,29 | 0,27 | 0,11 | 0,14 | 0,06 | 0,13 | 0,20 | 0,10 | 0,08 | -0,23 | -0,12 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 10,49 | 27,47 | 19,29 | 13,42 | 10,74 | 4,98 | 19,41 | 10,49 | 7,62 | 5,82 | -17,45 | -15,56 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,28 | 0,30 | 0,33 | 0,17 | 0,09 | -0,12 | 0,03 | 0,61 | 0,14 | 0,00 | -0,23 | -0,35 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 18,98 | 28,59 | 23,76 | 21,33 | 6,76 | -9,70 | 4,55 | 31,71 | 9,98 | 0,22 | -17,13 | -44,00 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 5,20 | -2,82 | -3,51 | 1,05 | 2,58 | 4,60 | 5,64 | 0,48 | 4,36 | -0,61 | 0,54 | 11,85 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 349,88 | -270,83 | -250,16 | 130,67 | 191,32 | 383,18 | 816,81 | 24,67 | 317,39 | -45,81 | 41,23 | 1.477,79 |
| NTN-B 760199 20240815 | -0,16 | -0,31 | 0,55 | 1,51 | 0,09 | -1,42 | -0,14 | 2,56 | 1,58 | -0,17 | -0,75 | -0,22 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | -11,03 | -29,50 | 39,21 | 188,21 | 6,76 | -118,35 | -20,95 | 132,62 | 114,77 | -12,39 | -57,33 | -27,10 |
| Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 1,49 | 1,04 | 1,40 | 0,80 | 1,35 | 1,20 | 0,69 | 1,93 | 1,37 | 1,33 | 1,31 | 0,80 |
| % do Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410% | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 | 100,00 |
| CDI | 0,36 | 0,31 | 0,27 | 0,21 | 0,20 | 0,13 | 0,15 | 0,16 | 0,15 | 0,16 | 0,16 | 0,16 |
| Dólar | 2,39 | -4,40 | -3,17 | -5,16 | 3,02 | 0,99 | 5,37 | -2,53 | -7,63 | 2,32 | 3,10 | 5,15 |
| Euro | 2,52 | -7,38 | -1,56 | -2,84 | -0,34 | 0,92 | 4,32 | -0,03 | -5,12 | 1,68 | 1,13 | 6,30 |
| Ibovespa | -3,94 | 0,46 | 6,16 | 1,94 | 6,00 | -4,37 | -3,32 | 9,30 | 15,90 | -0,69 | -4,80 | -3,44 |
| IBX | -3,99 | 0,63 | 5,92 | 2,84 | 6,04 | -3,45 | -3,03 | 9,15 | 15,46 | -0,55 | -4,58 | -3,38 |
| IGP-M | 0,78 | 0,60 | 4,10 | 1,51 | 2,94 | 2,53 | 2,58 | 0,96 | 3,28 | 3,23 | 4,34 | 2,74 |

Gráficos

Retorno Acumulado - 02/08/2021 a 30/08/2021 (diária)



Risco x Retorno - 02/08/2021 a 30/08/2021 (diária)





:: LÂMINA COMPARAÇÃO ATIVOS

30/08/2021

- Portfólio Art. 7º, I, a
- Portfólio Carteira IPMU 2021
- Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410%
- CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES
- BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES
- BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES
- BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO
- BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I
- CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I
- Portfólio - Art. 7º, I, b
- BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP
- BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA
- SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA
- BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- NTN-B 760199 20240815
- Portfólio Exterior 2021
- CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO
- Portfólio - Art. 8º, II, a
- CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA
- Portfólio Renda Fixa 2021
- BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES
- BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP
- Portfólio - Art. 7º, IV, a
- BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- Portfólio Art. 9º-A, II - Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior
- BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
- BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I
- Portfólio Art. 9º-A, III - Fundo de Ações BDR Nível 1
- SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO
- CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES
- Portfólio Renda Variável 2021
- BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO



Rentabilidade 2021

| Agosto | Saldo | % PL IPMU | Mês | Meta Atuarial | Ano | Meta Atuarial |
|--------------------------------------|---------------|-----------|----------|---------------|----------|---------------|
| | | | | 1,3500% | | 9,7000% |
| Caixa Gestão Estratégica | 60.330.793,73 | 14,420% | -1,4500% | -107,41% | -1,5130% | -15,60% |
| BB RF Alocação Ativa | 59.279.915,30 | 14,169% | -0,4490% | -33,26% | -1,3740% | -14,16% |
| Caixa Brasil IMA-B | 56.068.331,00 | 13,401% | -1,1370% | -84,22% | -2,3540% | -24,27% |
| Itaú Institucional Alocação Dinâmica | 53.128.737,70 | 12,699% | 0,3100% | -0,93% | 1,4700% | -10,38% |
| Títulos Públicos 2024 | 42.507.190,03 | 10,160% | -0,8500% | -62,96% | -1,7600% | -18,14% |
| Caixa FI Ações Small Caps | 18.466.316,07 | 4,414% | -5,0140% | -371,41% | 0,3040% | 3,13% |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | 17.825.673,59 | 4,261% | -1,7480% | -129,48% | -2,3930% | -24,67% |
| Bradesco Alocação Dinâmica | 17.180.264,52 | 4,106% | -0,5000% | -37,04% | -1,5000% | -15,46% |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | 13.051.368,25 | 3,120% | -2,3570% | -174,59% | -5,6760% | -58,52% |
| BB Alocação Retorno Total | 12.191.063,34 | 2,914% | -0,4550% | -33,70% | -0,9560% | -9,86% |
| Caixa Ações BDR Nível I | 12.169.869,69 | 2,909% | 2,4400% | 180,74% | 17,0100% | 175,36% |
| Santander Global Equities IE | 11.838.875,60 | 2,830% | 1,6700% | 123,70% | 14,8500% | 153,09% |
| BB IMA-B 5+ | 8.944.331,81 | 2,138% | -2,4100% | -178,52% | -5,5550% | -57,27% |
| BB Ações ESG Globais | 8.779.569,02 | 2,098% | 3,0000% | 222,22% | 17,0480% | 175,75% |
| Caixa Brasil RF Ativo | 8.022.801,51 | 1,918% | -1,4020% | -103,85% | -1,2970% | -13,37% |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 6.915.005,43 | 1,653% | 0,2300% | 17,04% | 1,3200% | 13,61% |
| BB Previdenciário RF TP 2022 | 6.657.361,20 | 1,591% | 0,4520% | 33,48% | 3,3210% | 34,24% |
| Caixa Multigestor Equities IE | 3.136.800,05 | 0,750% | 0,8070% | 59,78% | 8,0680% | 83,18% |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 1.882.164,90 | 0,450% | 0,2300% | 17,04% | 1,3200% | 13,61% |

Patrimônio

418.376.432,74

-0,720%

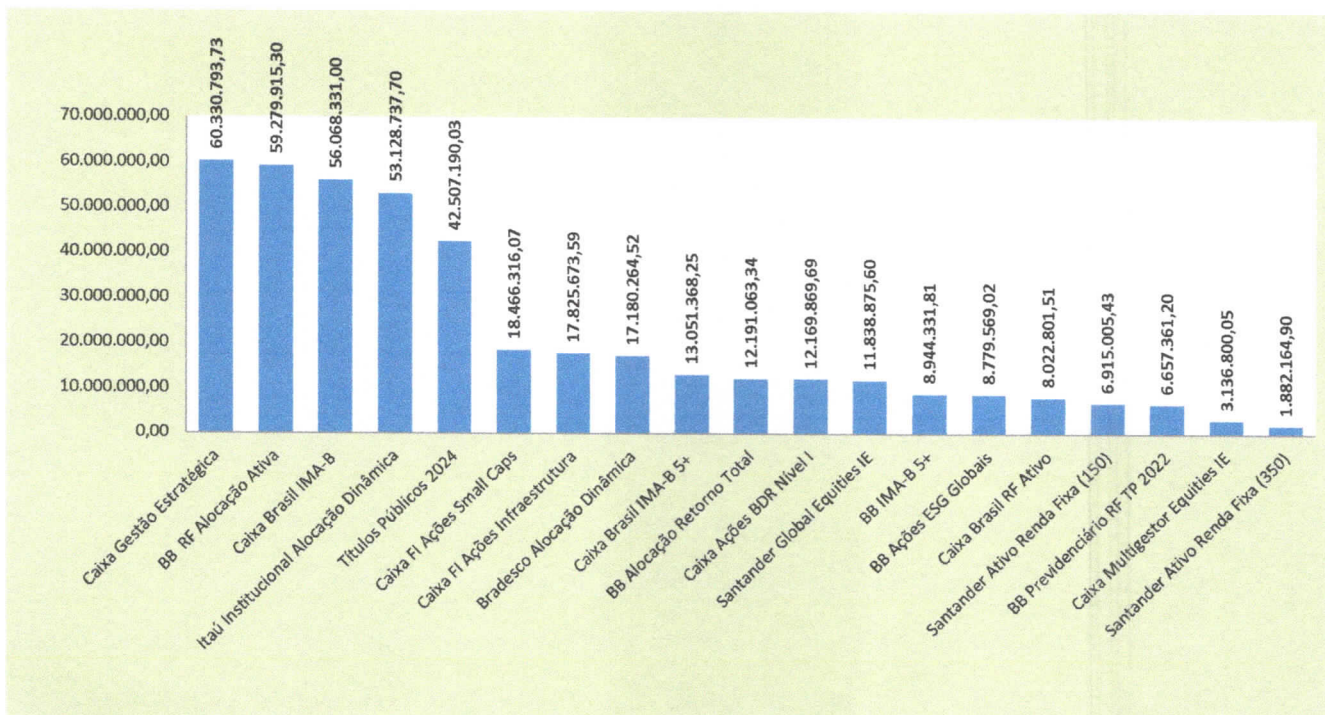
-53,33%

-0,480%

-4,95%

Carteira de Investimentos

1/2



Carteira de Investimentos

2/2



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

VaR 95,0% MV 21 du - Mensal

| Carteira IPMU | | | | |
|---------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| Janeiro | 390.732.768,80 | 29.341.621,30 | - | 420.074.390,10 |
| Fevereiro | 385.361.373,33 | 31.836.152,84 | - | 417.197.526,17 |
| Março | 382.778.665,50 | 32.169.880,53 | 3.613.477,13 | 418.562.023,16 |
| Abril | 357.446.973,83 | 33.173.922,51 | 30.700.309,53 | 421.321.205,87 |
| Maio | 356.813.530,93 | 36.691.643,99 | 30.583.527,47 | 424.088.702,39 |
| Junho | 356.056.455,48 | 36.918.904,71 | 29.965.077,90 | 422.940.438,09 |
| Julho | 352.414.005,54 | 37.583.864,18 | 31.637.971,01 | 421.635.840,73 |
| Agosto | 346.159.328,72 | 35.925.114,36 | 36.291.989,66 | 418.376.432,74 |
| Setembro | - | - | - | - |
| Outubro | - | - | - | - |
| Novembro | - | - | - | - |
| Dezembro | - | - | - | - |

| VaR - % | | | | |
|-----------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| | 5,00% | 20,00% | | |
| Janeiro | 1,263% | 11,585% | | 1,685% |
| Fevereiro | 1,125% | 12,218% | | 1,778% |
| Março | 1,650% | 14,135% | 10,757% | 2,284% |
| Abril | 1,417% | 5,163% | 8,545% | 1,244% |
| Maio | 1,234% | 8,409% | 5,582% | 1,581% |
| Junho | 1,294% | 6,009% | 4,935% | 1,278% |
| Julho | 1,340% | 8,773% | 7,213% | 1,642% |
| Agosto | 1,884% | 10,173% | 5,958% | 1,935% |
| Setembro | - | - | - | - |
| Outubro | - | - | - | - |
| Novembro | - | - | - | - |
| Dezembro | - | - | - | - |

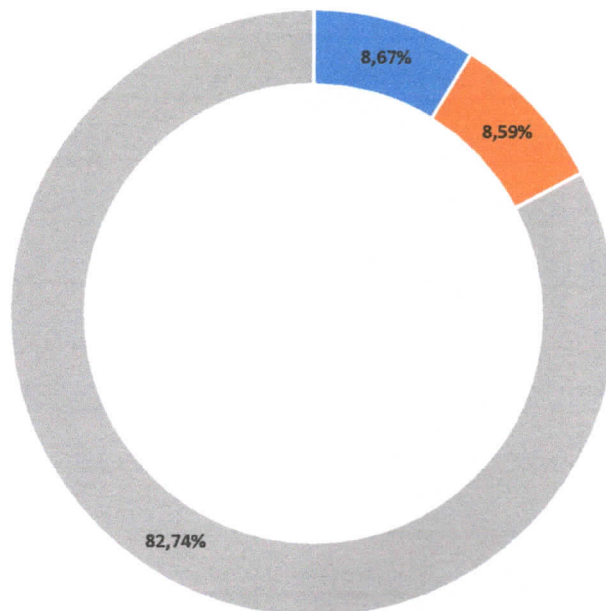
| VaR - R\$ | | | | |
|-----------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| Janeiro | 4.933.366,25 | 3.399.365,74 | - | 7.077.447,66 |
| Fevereiro | 4.335.023,00 | 3.889.668,02 | - | 7.417.711,99 |
| Março | 6.317.220,22 | 4.547.346,60 | 388.693,83 | 9.558.906,25 |
| Abril | 5.066.803,10 | 1.712.721,20 | 2.623.423,74 | 5.242.769,76 |
| Maio | 4.403.836,45 | 3.085.375,08 | 1.707.311,56 | 6.703.777,09 |
| Junho | 4.606.562,76 | 2.218.605,21 | 1.478.699,64 | 5.405.875,15 |
| Julho | 4.721.215,76 | 3.297.120,56 | 2.282.081,76 | 6.924.323,13 |
| Agosto | 6.521.432,27 | 3.654.497,65 | 2.162.108,99 | 8.096.742,11 |
| Setembro | - | - | - | - |
| Outubro | - | - | - | - |
| Novembro | - | - | - | - |
| Dezembro | - | - | - | - |



| | |
|--|-----------------------|
| Ações | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 18.466.316,07 |
| Exterior | 35.925.114,36 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 12.169.869,69 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 11.838.875,60 |
| Renda Fixa | 346.159.328,72 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 59.279.915,30 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 12.191.063,34 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.944.331,81 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 6.657.361,20 |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 8.022.801,51 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 60.330.793,73 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 13.051.368,25 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 56.068.331,00 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 53.128.737,70 |
| NTN-B 760199 20240815 | 42.507.190,03 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 8.797.170,33 |
| Total Geral | 418.376.432,74 |
| Ações | 36.291.989,66 |
| Exterior | 35.925.114,36 |
| Renda Fixa | 346.159.328,72 |
| Total Geral | 418.376.432,74 |

Soma de Saldo

Carteira IPMU



Classificação CVM

- Ações
- Exterior
- Renda Fixa



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2021

| Agosto | Valor | % PL | % Política | Rentabilidade | | | | | |
|---|-----------------------|----------------|---------------|-------------------|-------------|----------------|------------|-------------|--|
| Artigo 7º – Inciso I – Alínea A (até 100%) | 42.507.190,03 | 10,16% | 15,00% | Limite 25% | | | Mês | 2021 | |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 42.507.190,03 | 10,16% | | | | | -0,85% | -1,76% | |
| Artigo 7º – Inciso I – Alínea B (até 100%) | 204.332.101,29 | 48,84% | 50,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | Mês | 2021 | |
| BB Previdenciário RF Alocação Ativa | 59.279.915,30 | 14,17% | | 8.803.716.462,71 | 0,6734% | 585 | -0,449% | -1,374% | |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 6.657.361,20 | 1,59% | | 199.736.376,24 | 3,3331% | 45 | 0,452% | 3,321% | |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | 8.944.331,81 | 2,14% | | 1.109.310.892,98 | 0,8063% | 264 | -2,241% | -5,555% | |
| Caixa FI Brasil IMA-B | 56.068.331,00 | 13,40% | | 5.489.990.227,20 | 1,0213% | 872 | -1,137% | -2,354% | |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica | 60.330.793,73 | 14,42% | | 15.341.053.159,31 | 0,3933% | 976 | -1,450% | -1,513% | |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | 13.051.368,25 | 3,12% | | 1.380.467.864,45 | 0,9454% | 305 | -2,357% | -5,676% | |
| 7º – Inciso IV (até 40%) | 99.320.037,40 | 23,74% | 20,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | Mês | 2021 | |
| Itaú Alocação Ativa | 53.128.737,70 | 12,70% | | 3.275.640.848,90 | 1,6219% | 249 | 0,310% | 1,470% | |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 6.915.005,43 | 1,65% | | 835.512.614,01 | 0,8276% | 98 | 0,230% | 1,320% | |
| BB Renda Fixa Retorno Total | 12.191.063,34 | 2,91% | | 4.477.081.866,50 | 0,2723% | 584 | -0,455% | -0,956% | |
| Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica | 17.180.264,52 | 4,11% | | 1.351.295.808,04 | 1,2714% | 195 | -0,500% | -1,500% | |
| Caixa FIC Brasil RF Ativa | 8.022.801,51 | 1,92% | | 1.044.425.824,76 | 0,7682% | 142 | -1,402% | -1,297% | |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 1.882.164,90 | 0,45% | | 835.512.614,01 | 0,2253% | 98 | 0,230% | 1,320% | |
| Artigo 8º – Inciso I - A (até 30%) | 0,00 | 0,00% | 4,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | | | |
| Artigo 8º – Inciso I - B (até 30%) | 0,00 | 0,00% | 1,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | | | |
| Artigo 8º – Inciso II - A (até 20%) | 36.291.989,66 | 8,67% | 5,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | Mês | 2021 | |
| Caixa FI Ações Small Caps Ativo | 18.466.316,07 | 4,41% | | 1.120.309.778,71 | 1,6483% | 11.994 | -5,014% | 0,304% | |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | 17.825.673,59 | 4,26% | | 437.227.724,66 | 4,0770% | 6.383 | -1,748% | -2,393% | |
| Artigo 8º – Inciso II - B (até 20%) | 0,00 | 0,00% | 1,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | | | |
| Artigo 8º – Inciso III - B (até 10%) | 0,00 | 0,00% | 1,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | | | |
| Artigo 9º – Inciso I - A (até 10%) | 0,00 | 0,00% | 1,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | | | |
| Artigo 9º – Inciso II - A (até 10%) | 14.975.675,65 | 3,58% | 1,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | Mês | 2021 | |
| Caixa Multigestor Global Equities IE | 3.136.800,05 | 0,75% | | 195.497.444,79 | 1,6045% | 1.189 | 0,807% | 8,068% | |
| Santander Global Equities | 11.838.875,60 | 2,83% | | 1.973.726.587,17 | 0,5998% | 13.112 | 1,670% | 14,850% | |
| Artigo 9º – Inciso III - A (até 10%) | 20.949.438,71 | 5,01% | 1,00% | PL Fundo | % PL | Cotista | Mês | 2021 | |
| BB Ações ESG Globais | 8.779.569,02 | 2,10% | | 1.101.736.947,31 | 0,7969% | 24.080 | 3,000% | 17,048% | |
| Caixa Ações BDR Nível I | 12.169.869,69 | 2,91% | | 3.230.077.335,87 | 0,3768% | 478 | 2,440% | 17,010% | |
| Consolidado | 418.376.432,74 | 100,00% | | | | | | | |

| Aplicação por Instituição Financeira | | | |
|--------------------------------------|-----------------------|--|----------------|
| 1- Títulos Públicos | 42.507.190,03 | | 10,16% |
| 2- Caixa Econômica Federal | 189.071.953,89 | | 45,19% |
| 3- Santander | 20.636.045,93 | | 4,93% |
| 4- Brasil | 95.852.240,67 | | 22,91% |
| 5- Bradesco | 17.180.264,52 | | 4,11% |
| 6- Itaú | 53.128.737,70 | | 12,70% |
| | 418.376.432,74 | | 100,00% |

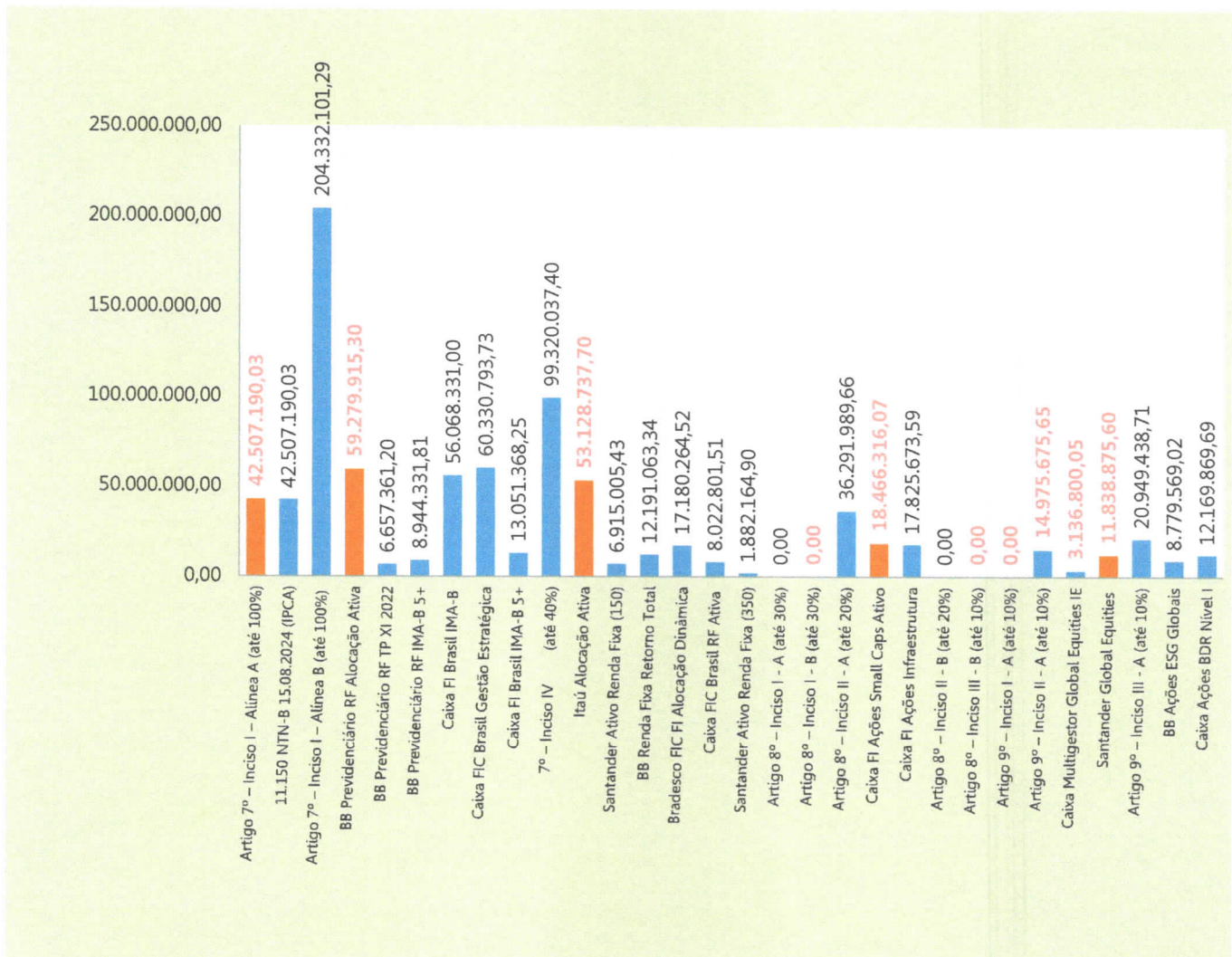
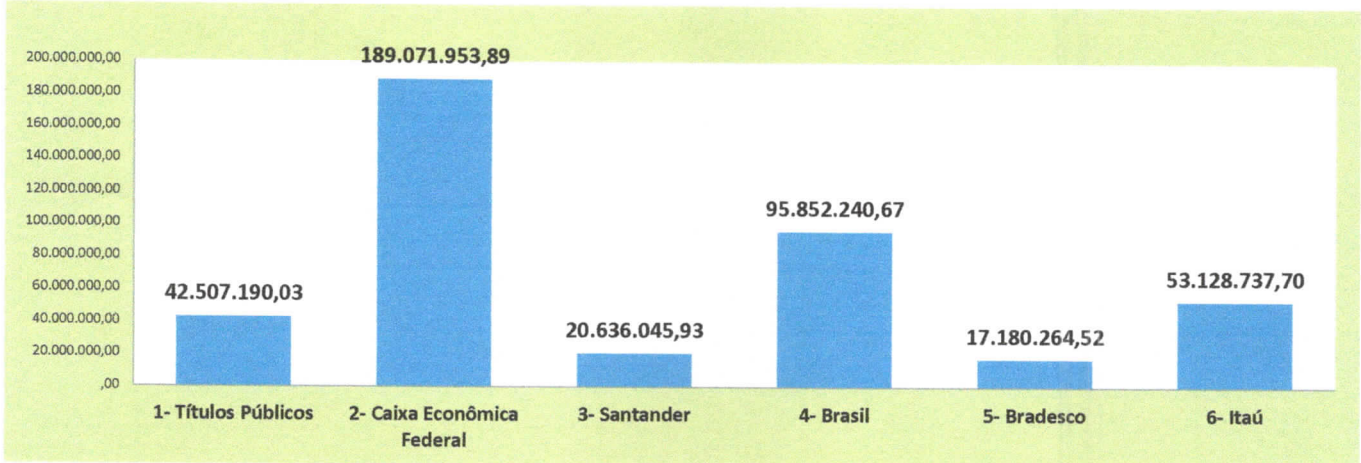


Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br





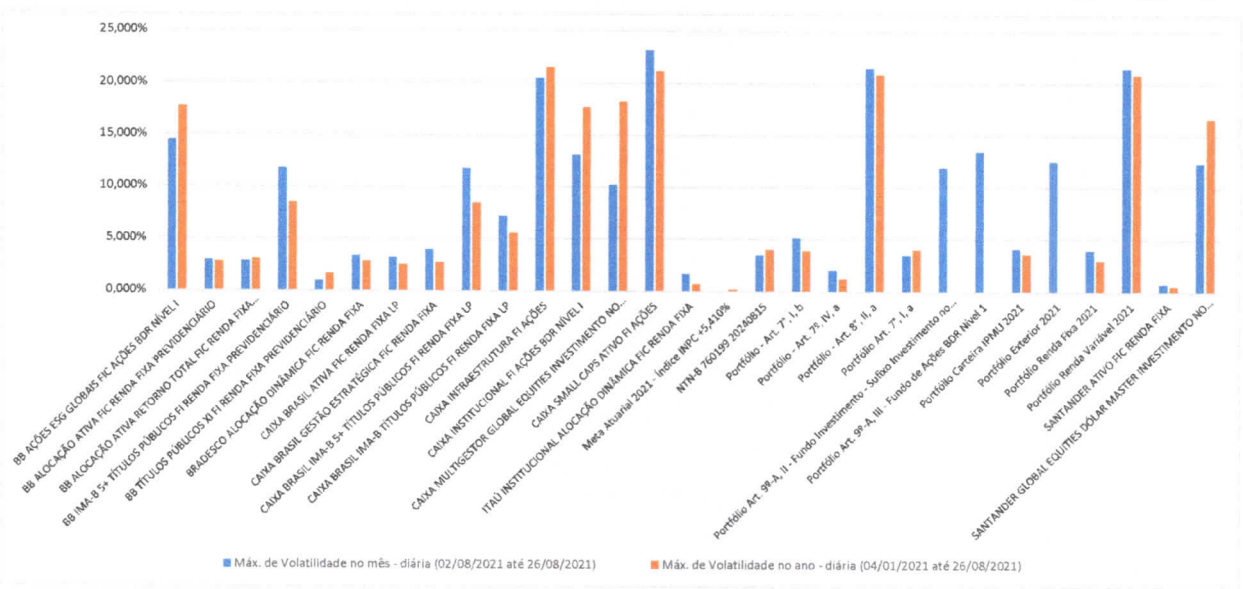
Retorno Carteira IPMU 31/8/2021

| | Athivo | No ano | No mês | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | Saldo |
|--|---------|---------|----------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------------------|
| Ações | | | | | | | | | 36.291.989,66 |
| Fi de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | | | | | | | | | 36.291.989,66 |
| - CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | -1,046% | -3,381% | -8,639% | 7,73% | 10,830% | 17,984% | 79,802% | 17,984% | 36.291.989,66 |
| - CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | -2,393% | -1,748% | -6,991% | 8,520% | 8,749% | 14,959% | 88,154% | 88,154% | 17.825.673,59 |
| - CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 0,304% | -5,014% | -10,287% | 6,945% | 12,912% | 21,008% | 71,450% | 71,450% | 18.466.316,07 |
| Renda Fixa | | | | | | | | | 346.159.328,72 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | | | | | | | | | 204.332.101,29 |
| - IMA-B | -2,354% | -1,137% | -1,989% | 0,528% | 2,582% | 10,079% | 38,258% | 38,258% | 56.068.331,00 |
| - CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -2,354% | -1,137% | -1,989% | 0,528% | 2,582% | 10,079% | 38,258% | 38,258% | 56.068.331,00 |
| - IMA-B 5+ | -5,515% | -2,299% | -3,724% | -0,982% | 0,740% | 6,968% | 44,271% | 44,271% | 21.995.700,06 |
| - BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -5,515% | -2,299% | -3,724% | -0,982% | 0,740% | 6,968% | 44,271% | 44,271% | 21.995.700,06 |
| - CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -5,676% | -2,241% | -3,671% | -0,938% | 0,721% | 7,087% | 44,544% | 44,544% | 8.944.331,81 |
| - CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -5,676% | -2,357% | -3,776% | -1,026% | 0,760% | 6,849% | 43,997% | 43,997% | 13.051.368,25 |
| - BB ALOCAÇÃO ATIVA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,145% | -0,482% | -0,564% | 0,913% | 2,447% | 11,337% | 29,020% | 29,020% | 126.268.070,23 |
| - BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,374% | -0,449% | -0,860% | 0,492% | 0,832% | 7,410% | 24,016% | 24,016% | 59.279.915,30 |
| - CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | 3,321% | 0,452% | 1,464% | 3,087% | 6,575% | 16,925% | 35,842% | 35,842% | 6.657.361,20 |
| - CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA | -1,513% | -1,450% | -2,297% | -0,842% | -0,068% | 9,676% | 27,203% | 27,203% | 60.330.793,73 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | | | | | | | | | 99.320.037,40 |
| - IPCA | -1,250% | -0,787% | -1,163% | 0,226% | 0,495% | 6,802% | 22,671% | 22,671% | 37.394.129,37 |
| - BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,956% | -0,455% | -0,815% | 0,857% | 1,573% | 6,802% | 22,671% | 22,671% | 12.191.063,34 |
| - BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | -1,496% | -0,504% | -0,711% | 0,500% | 0,292% | 6,802% | 22,671% | 22,671% | 17.180.264,52 |
| - CAIXA BRASIL ATIVA FI RENDA FIXA LP | -1,297% | -1,402% | -1,962% | -0,679% | -0,382% | 7,777% | 21,170% | 21,170% | 8.022.801,51 |
| - ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA | 1,400% | 0,267% | 0,712% | 1,354% | 1,717% | 6,580% | 20,614% | 20,614% | 61.925.908,03 |
| - SANTANDER ATIVO FI RENDA FIXA | 1,474% | 0,307% | 0,724% | 1,255% | 1,599% | 6,580% | 20,614% | 20,614% | 53.128.737,70 |
| Art. 7º, I, a | | | | | | | | | 42.507.190,03 |
| - NTN-B 760199 20240815 | 0,087% | -0,002% | -0,678% | 2,178% | 3,322% | 15,220% | 37,965% | 37,965% | 42.507.190,03 |
| - NTN-B 760199 20240815 | 0,087% | -0,002% | -0,678% | 2,178% | 3,322% | 15,220% | 37,965% | 37,965% | 42.507.190,03 |
| Exterior | | | | | | | | | 35.925.114,36 |
| Fundo de Ações BDR Nivel 1 - Art. 9º-A, III | | | | | | | | | 20.949.438,71 |
| - BB AÇÕES ESG GLOBAIS FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17,031% | 2,718% | 9,136% | 6,784% | 17,328% | 90,531% | 91,272% | 91,272% | 20.949.438,71 |
| - CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17,048% | 3,000% | 8,753% | 7,245% | 16,742% | 86,530% | 81,272% | 81,272% | 8.779.569,02 |
| - CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17,015% | 2,435% | 9,520% | 6,323% | 17,915% | 94,532% | 101,271% | 101,271% | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | | | | | | | | | 14.975.675,65 |
| - CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 11,256% | 1,059% | 6,928% | -1,296% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 93,621% | 14.975.675,65 |
| - SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 8,068% | 0,807% | 7,627% | -2,749% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 93,621% | 3.136.800,05 |
| - SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 14,445% | 1,310% | 6,229% | 0,156% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 93,621% | 11.838.875,60 |
| Total Geral | | | | | | | | | 418.376.432,74 |



Volatilidade Carteira IPMU 31/8/2021

| Ações | Ativo | Volatilidade - Mês | Volatilidade - Ano | Saldo |
|--|-------|--------------------|--------------------|-----------------------|
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | | 23,147% | 21,492% | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | | 20,458% | 21,492% | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | | 23,147% | 21,174% | 18.466.316,07 |
| Renda Fixa | | | | 346.159.328,72 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | | | | 204.332.101,29 |
| IMA-B | | | | 56.068.331,00 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | | 7,156% | 5,513% | 56.068.331,00 |
| IMA-B 5+ | | | | 21.995.700,06 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | 11,721% | 8,439% | 8.944.331,81 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | | 11,749% | 8,470% | 13.051.368,25 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | 2,915% | 2,759% | 59.279.915,30 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | 0,979% | 1,620% | 6.657.361,20 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | | 3,930% | 2,700% | 60.330.793,73 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | | | | 99.320.037,40 |
| IPCA | | | | 37.394.129,37 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | 2,818% | 3,020% | 12.191.063,34 |
| BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | | 3,316% | 2,818% | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | | 3,180% | 2,482% | 8.022.801,51 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | | 1,675% | 0,675% | 53.128.737,70 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | | 0,761% | 0,559% | 8.797.170,33 |
| Art. 7º, I, a | | | | 42.507.190,03 |
| NTN-B 760199 20240815 | | 3,487% | 4,001% | 42.507.190,03 |
| Exterior | | | | 35.925.114,36 |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | | | | 20.949.438,71 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | | 14,477% | 17,691% | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | | 13,065% | 17,652% | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | | | | 14.975.675,65 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | | 10,221% | 18,231% | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | | 12,382% | 16,626% | 11.838.875,60 |
| Total Geral | | | | 418.376.432,74 |





Risco x Retorno Carteira IPMU 31/8/2021

| Ativo | Retorno - Mês | Volatilidade - Mês | Retorno - Ano | Volatilidade - Ano | Saldo |
|--|----------------|--------------------|----------------|--------------------|-----------------------|
| Ações | | | | | |
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | -1,748% | 23,147% | 0,304% | 21,492% | 36.291.989,66 |
| - | -1,748% | 23,147% | 0,304% | 21,492% | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | -1,748% | 20,458% | -2,393% | 21,492% | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | -5,014% | 23,147% | 0,304% | 21,174% | 18.466.316,07 |
| Renda Fixa | 0,452% | 11,749% | 3,321% | 8,470% | 346.159.328,72 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | 0,452% | 11,749% | 3,321% | 8,470% | 204.332.101,29 |
| - | -1,137% | 7,156% | -2,354% | 5,513% | 56.068.331,00 |
| IMA-B | -1,137% | 7,156% | -2,354% | 5,513% | 56.068.331,00 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -2,241% | 11,749% | -5,555% | 8,470% | 21.995.700,06 |
| IMA-B 5+ | -2,241% | 11,749% | -5,555% | 8,470% | 8.944.331,81 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -2,241% | 11,749% | -5,555% | 8,470% | 13.051.368,25 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -2,241% | 11,749% | -5,555% | 8,470% | 126.268.070,23 |
| - | 0,452% | 3,930% | 3,321% | 2,759% | 59.279.915,30 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,449% | 2,915% | -1,374% | 2,759% | 6.657.361,20 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,452% | 0,979% | 3,321% | 1,620% | 60.330.793,73 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | -1,450% | 3,930% | -1,513% | 2,700% | 98.320.037,40 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | 0,307% | 3,316% | 1,474% | 3,020% | 37.394.129,37 |
| - | -0,455% | 3,316% | -0,956% | 3,020% | 12.191.063,34 |
| IPCA | -0,455% | 2,818% | -0,956% | 2,818% | 17.180.264,52 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,504% | 3,316% | -1,496% | 2,818% | 8.022.801,51 |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | -1,402% | 3,180% | -1,297% | 2,482% | 61.925.908,03 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 0,307% | 1,675% | 1,474% | 0,675% | 53.128.737,70 |
| ITÁÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,307% | 1,675% | 1,474% | 0,675% | 8.797.170,33 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 0,227% | 0,761% | 1,325% | 0,559% | 42.507.190,03 |
| Art. 7º, I, a | -0,002% | 3,487% | 0,087% | 4,001% | 42.507.190,03 |
| - | -0,002% | 3,487% | 0,087% | 4,001% | 42.507.190,03 |
| NTN-8 760199 20240815 | -0,002% | 3,487% | 0,087% | 4,001% | 42.507.190,03 |
| Exterior | 3,000% | 14,477% | 17,048% | 18,231% | 35.925.114,36 |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | 3,000% | 14,477% | 17,048% | 17,691% | 20.949.438,71 |
| - | 3,000% | 14,477% | 17,048% | 17,691% | 20.949.438,71 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 3,000% | 14,477% | 17,048% | 17,691% | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2,435% | 13,065% | 17,015% | 17,652% | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Suíço Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | 1,310% | 12,382% | 14,445% | 18,231% | 14.975.675,65 |
| - | 1,310% | 12,382% | 14,445% | 18,231% | 14.975.675,65 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 0,807% | 10,221% | 8,068% | 18,231% | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 1,310% | 12,382% | 14,445% | 16,626% | 11.838.875,60 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cap. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

Retorno x Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent. Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-----------|
| 2021 | -0,39 | -0,92 | 0,43 | 0,68 | 0,69 | 0,03 | -0,26 | -0,72 | - | - | - | - | -0,48% |
| INPC + 5,410% | 0,69 | 1,20 | 1,35 | 0,80 | 1,40 | 1,04 | 1,49 | 1,35 | - | - | - | - | 9,70% |
| p.p. indexador | -1,08 | -2,12 | -0,92 | -0,12 | -0,71 | -1,01 | -1,75 | -2,07 | - | - | - | - | -10,18% |
| 2020 | 0,45 | 0,43 | -3,22 | 0,84 | 1,35 | 1,24 | 2,23 | -0,78 | -0,78 | 0,05 | 1,84 | 2,63 | 6,34 |
| INPC + 5,86% | 0,69 | 0,58 | 0,68 | 0,22 | 0,20 | 0,78 | 0,96 | 0,84 | 1,35 | 1,37 | 1,41 | 1,97 | 11,60 |
| p.p. indexador | -0,24 | -0,15 | -3,90 | 0,62 | 1,15 | 0,46 | 1,27 | -1,62 | -2,13 | -1,32 | 0,43 | 0,66 | -5,26 |
| 2019 | 2,36 | 0,52 | 0,65 | 1,13 | 2,41 | 2,83 | 1,13 | -0,16 | 2,06 | 2,14 | -1,26 | 1,28 | 16,10 |
| INPC + 6% | 0,87 | 1,01 | 1,21 | 1,09 | 0,66 | 0,45 | 0,63 | 0,63 | 0,44 | 0,57 | 1,01 | 1,71 | 10,78 |
| p.p. indexador | 1,49 | -0,49 | -0,56 | 0,04 | 1,75 | 2,38 | 0,50 | -0,79 | 1,62 | 1,57 | -2,27 | -0,43 | 5,32 |
| 2018 | 1,76 | 0,58 | 1,28 | 0,26 | -1,66 | 0,28 | 1,46 | -0,26 | 0,54 | 3,44 | 0,39 | 1,30 | 9,72 |
| INPC + 6% | 0,74 | 0,60 | 0,56 | 0,70 | 0,92 | 1,92 | 0,76 | 0,53 | 0,74 | 0,91 | 0,21 | 0,60 | 9,59 |
| p.p. indexador | 1,02 | -0,02 | 0,72 | -0,44 | -2,58 | -1,64 | 0,70 | -0,79 | -0,20 | 2,53 | 0,18 | 0,70 | 0,13 |
| 2017 | 1,66 | 2,15 | 1,20 | 0,17 | -0,47 | 0,45 | 2,55 | 1,13 | 1,23 | 0,17 | -0,14 | 0,83 | 11,43 |
| INPC + 6% | 0,93 | 0,66 | 0,85 | 0,50 | 0,87 | 0,19 | 0,66 | 0,50 | 0,44 | 0,86 | 0,64 | 0,72 | 8,12 |
| p.p. indexador | 0,73 | 1,49 | 0,35 | -0,33 | -1,34 | 0,26 | 1,89 | 0,63 | 0,79 | -0,69 | -0,78 | 0,11 | 3,31 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba
Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

META ATUARIAL X CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

ago/21

| 03 meses | Carteira | Meta |
|----------|-----------------|----------------|
| jun/21 | 0,0300% | 1,0400% |
| jul/21 | -0,2600% | 1,4900% |
| ago/21 | -0,7200% | 1,3500% |
| | -0,9484% | 3,9299% |

| 06 meses | Carteira | Meta |
|----------|----------------|----------------|
| mar/21 | 0,4300% | 1,3500% |
| abr/21 | 0,6800% | 0,8000% |
| mai/21 | 0,6900% | 1,4000% |
| jun/21 | 0,0300% | 1,0400% |
| jul/21 | -0,2600% | 1,4900% |
| ago/21 | -0,7200% | 1,3500% |
| | 0,8450% | 7,6620% |

| 12 meses | Carteira | Meta |
|----------|----------------|-----------------|
| set/20 | -0,7800% | 1,3500% |
| out/20 | 0,0500% | 1,3700% |
| nov/20 | 1,8400% | 1,4100% |
| dez/20 | 2,6300% | 1,9700% |
| jan/21 | -0,3900% | 0,6900% |
| fev/21 | -0,9200% | 1,2000% |
| mar/21 | 0,4300% | 1,3500% |
| abr/21 | 0,6800% | 0,8000% |
| mai/21 | 0,6900% | 1,4000% |
| jun/21 | 0,0300% | 1,0400% |
| jul/21 | -0,2600% | 1,4900% |
| ago/21 | -0,7200% | 1,3500% |
| | 3,2648% | 16,0342% |

| 24 Meses | Carteira | Meta |
|----------|-----------------|-----------------|
| set/19 | 2,0600% | 0,4400% |
| out/19 | 2,1400% | 0,5700% |
| nov/19 | -1,2600% | 1,0100% |
| dez/19 | 1,2800% | 1,7100% |
| jan/20 | 0,4500% | 0,6900% |
| fev/20 | 0,4300% | 0,5800% |
| mar/20 | -3,2200% | 0,6800% |
| abr/20 | 0,8400% | 0,2200% |
| mai/20 | 1,3500% | 0,2000% |
| jun/20 | 1,2400% | 0,7800% |
| jul/20 | 2,2300% | 0,9600% |
| ago/20 | -0,7800% | 0,8400% |
| set/20 | -0,7800% | 1,3500% |
| out/20 | 0,0500% | 1,3700% |
| nov/20 | 1,8400% | 1,4100% |
| dez/20 | 2,6300% | 1,9700% |
| jan/21 | -0,3900% | 0,6900% |
| fev/21 | -0,9200% | 1,2000% |
| mar/21 | 0,4300% | 1,3500% |
| abr/21 | 0,6800% | 0,8000% |
| mai/21 | 0,6900% | 1,4000% |
| jun/21 | 0,0300% | 1,0400% |
| jul/21 | -0,2600% | 1,4900% |
| ago/21 | -0,7200% | 1,3500% |
| | 10,3077% | 27,0688% |

| 36 meses | Carteira | Meta |
|----------|-----------------|-----------------|
| set/18 | 0,5400% | 0,7400% |
| out/18 | 3,4400% | 0,9100% |
| nov/18 | 0,3900% | 0,2100% |
| dez/18 | 1,3000% | 0,6000% |
| jan/19 | 2,3600% | 0,8700% |
| fev/19 | 0,5200% | 1,0100% |
| mar/19 | 0,6500% | 1,2100% |
| abr/19 | 1,1300% | 1,0900% |
| mai/19 | 2,4100% | 0,6600% |
| jun/19 | 2,8300% | 0,4500% |
| jul/19 | 1,1300% | 0,6300% |
| ago/19 | -0,1600% | 0,6300% |
| set/19 | 2,0600% | 0,4400% |
| out/19 | 2,1400% | 0,5700% |
| nov/19 | -1,2600% | 1,0100% |
| dez/19 | 1,2800% | 1,7100% |
| jan/20 | 0,4500% | 0,6900% |
| fev/20 | 0,4300% | 0,5800% |
| mar/20 | -3,2200% | 0,6800% |
| abr/20 | 0,8400% | 0,2200% |
| mai/20 | 1,3500% | 0,2000% |
| jun/20 | 1,2400% | 0,7800% |
| jul/20 | 2,2300% | 0,9600% |
| ago/20 | -0,7800% | 0,8400% |
| set/20 | -0,7800% | 1,3500% |
| out/20 | 0,0500% | 1,3700% |
| nov/20 | 1,8400% | 1,4100% |
| dez/20 | 2,6300% | 1,9700% |
| jan/21 | -0,3900% | 0,6900% |
| fev/21 | -0,9200% | 1,2000% |
| mar/21 | 0,4300% | 1,3500% |
| abr/21 | 0,6800% | 0,8000% |
| mai/21 | 0,6900% | 1,4000% |
| jun/21 | 0,0300% | 1,0400% |
| jul/21 | -0,2600% | 1,4900% |
| ago/21 | -0,7200% | 1,3500% |
| | 29,9142% | 38,9965% |



Relatório Financeiro - Carteira de Investimentos

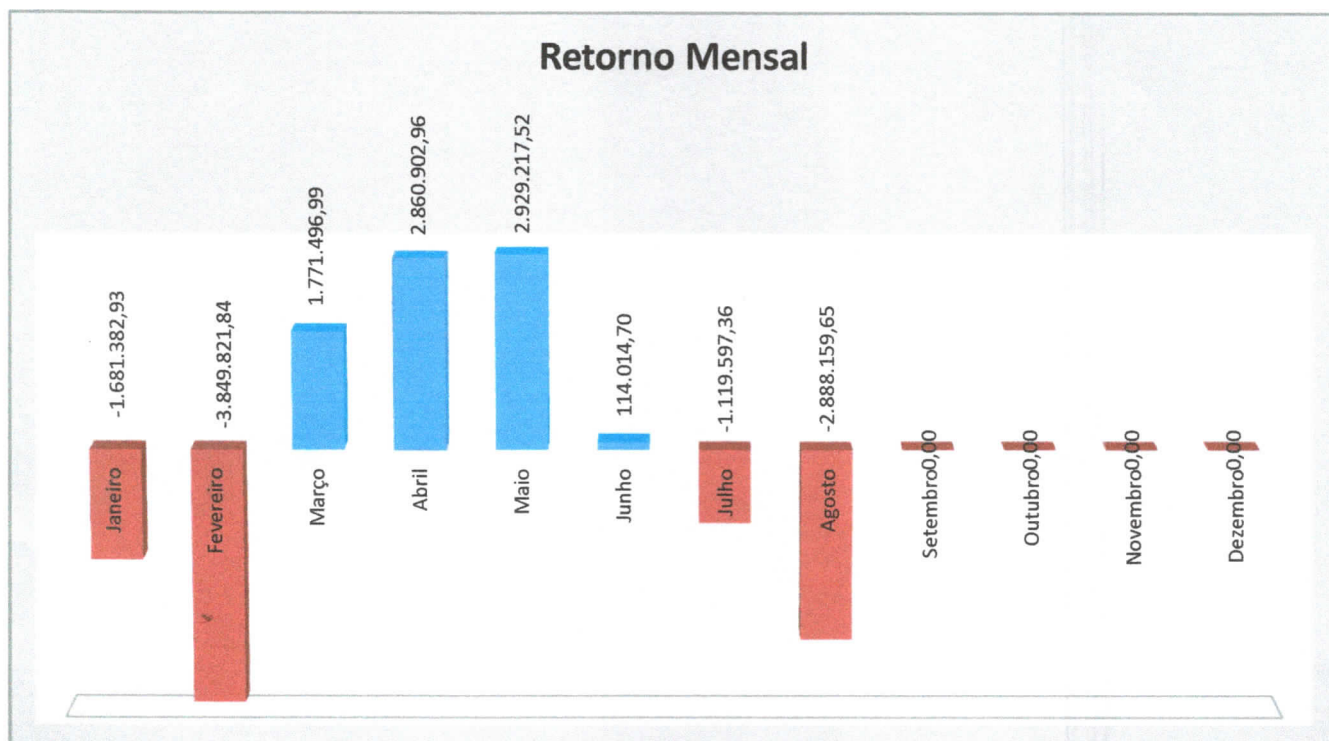
| 201 | Renda Fixa | | Renda Variável | | Total |
|--------------|---------------------|----------------------|---------------------|----------------------|----------------------|
| | Valorização | Desvalorização | Valorização | Desvalorização | |
| Janeiro | 927.887,29 | -1.451.536,64 | 0,00 | -1.157.733,58 | -1.681.382,93 |
| Fevereiro | 616.675,91 | -3.222.437,25 | 4.240,27 | -1.248.300,77 | -3.849.821,84 |
| Março | 1.016.638,10 | -917.345,93 | 1.709.089,41 | -36.884,59 | 1.771.496,99 |
| Abril | 2.237.028,58 | 0,00 | 1.020.083,54 | -396.209,16 | 2.860.902,96 |
| Maio | 1.974.278,10 | 0,00 | 1.977.721,48 | -1.022.782,06 | 2.929.217,52 |
| Junho | 757.110,74 | -136.907,19 | 211.031,95 | -717.220,80 | 114.014,70 |
| Julho | 166.393,53 | -1.198.843,47 | 1.562.893,11 | -1.650.040,53 | -1.119.597,36 |
| Agosto | 364.189,08 | -2.585.314,21 | 624.840,00 | -1.291.874,52 | -2.888.159,65 |
| Setembro | | | | | 0,00 |
| Outubro | | | | | 0,00 |
| Novembro | | | | | 0,00 |
| Dezembro | | | | | 0,00 |
| Total | 8.060.201,33 | -9.512.384,69 | 7.109.899,76 | -7.521.046,01 | -1.863.329,61 |

Valorização **15.170.101,09**

Desvalorização **-17.033.430,70**

-1.863.329,61

Retorno Mensal





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

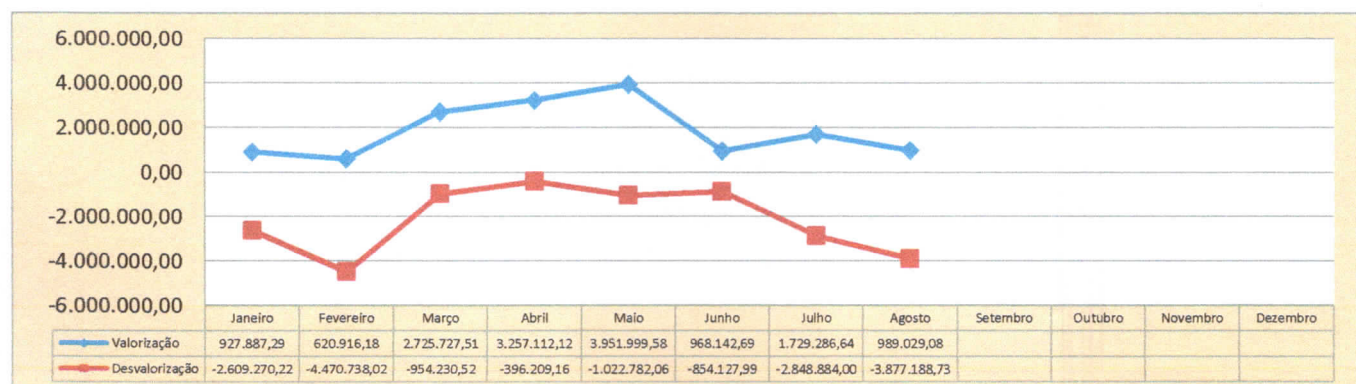
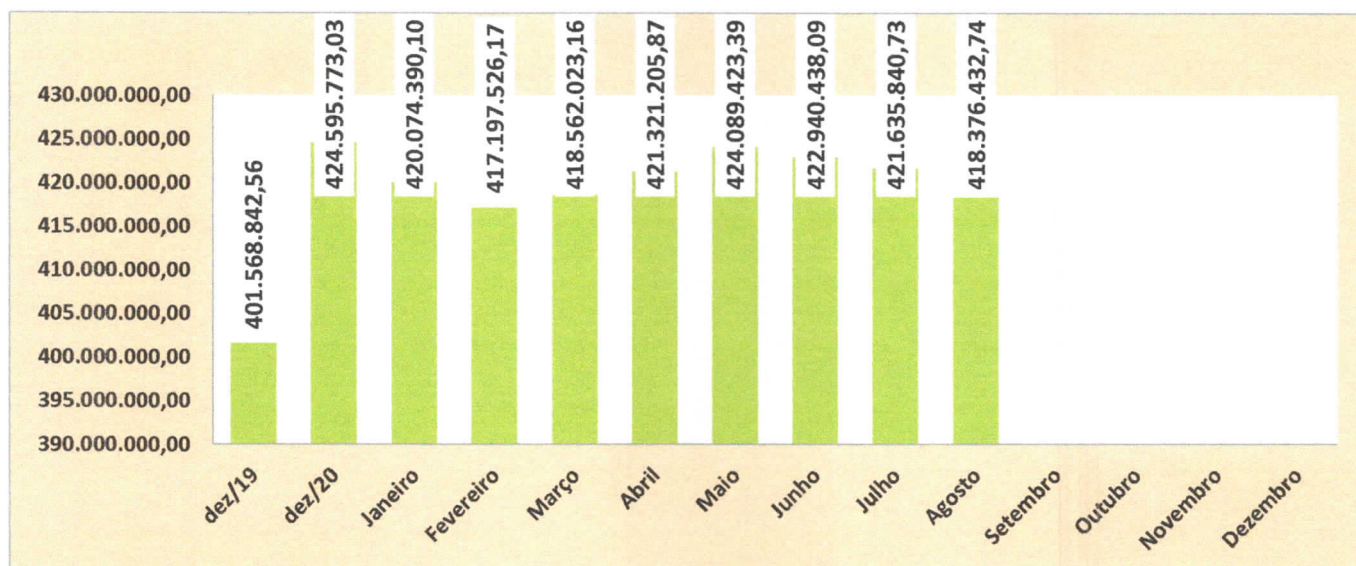
Retorno dos Investimentos

| Investimentos | Enquadramento | ago/21 | % PL | Valorização | Desvalorização | Consolidado |
|-----------------------|-----------------|----------------|---------|-------------|----------------|---------------|
| Renda Fixa | Artigo 7º I A | 42.507.190,03 | 10,16% | 0,00 | -8.845,96 | -8.845,96 |
| Renda Fixa | Artigo 7º I B | 204.332.101,29 | 48,84% | 177.303,35 | -2.319.672,64 | -2.142.369,29 |
| Renda Fixa | Artigo 7º IV | 99.320.037,40 | 23,74% | 186.885,73 | -256.795,61 | -69.909,88 |
| Renda Variável | Artigo 8º II A | 36.291.989,66 | 8,67% | 0,00 | -1.291.874,52 | -1.291.874,52 |
| Investimento Exterior | Artigo 9º II A | 14.975.675,65 | 3,58% | 159.637,00 | 0,00 | 159.637,00 |
| Investimento Exterior | Artigo 9º III A | 20.949.438,71 | 5,01% | 465.203,00 | 0,00 | 465.203,00 |
| Total | | 418.376.432,74 | 100,00% | 989.029,08 | -3.877.188,73 | -2.888.159,65 |



Carteira de Investimentos 2021

| | Saldo | Valorização | Desvalorização | Acumulado | Rentabilidade | |
|-----------|----------------|----------------------|-----------------------|----------------------|---------------|--------|
| | | | | | Mês | Ano |
| dez/19 | 401.568.842,56 | | | | | |
| dez/20 | 424.595.773,03 | | | | | |
| Janeiro | 420.074.390,10 | 927.887,29 | -2.609.270,22 | -1.681.382,93 | -0,39% | |
| Fevereiro | 417.197.526,17 | 620.916,18 | -4.470.738,02 | -3.849.821,84 | -0,92% | |
| Março | 418.562.023,16 | 2.725.727,51 | -954.230,52 | 1.771.496,99 | 0,43% | |
| Abril | 421.321.205,87 | 3.257.112,12 | -396.209,16 | 2.860.902,96 | 0,68% | -0,21% |
| Maio | 424.089.423,39 | 3.951.999,58 | -1.022.782,06 | 2.929.217,52 | 0,69% | 0,48% |
| Junho | 422.940.438,09 | 968.142,69 | -854.127,99 | 114.014,70 | 0,03% | 0,52% |
| Julho | 421.635.840,73 | 1.729.286,64 | -2.848.884,00 | -1.119.597,36 | -0,26% | 0,25% |
| Agosto | 418.376.432,74 | 989.029,08 | -3.877.188,73 | -2.888.159,65 | | |
| Setembro | | | | | | |
| Outubro | | | | | | |
| Novembro | | | | | | |
| Dezembro | | | | | | |
| | | 15.170.101,09 | -17.033.430,70 | -1.863.329,61 | | |





ANÁLISE DE LIQUIDEZ

ago/21

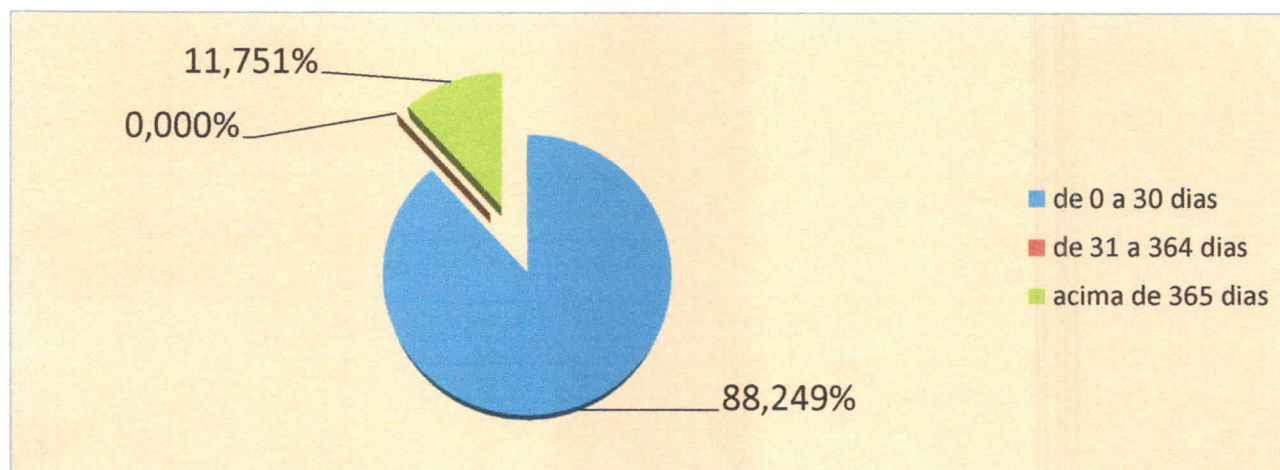
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|---------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 369.211.881,51 | 88,249% | 369.211.881,51 | 88,25% |
| de 31 a 364 dias | 0,00 | 0,000% | 369.211.881,51 | 88,25% |
| acima de 365 dias | 49.164.551,23 | 11,751% | 418.376.432,74 | 100,00% |

DE 0 A 30 DIAS

| Ativo | Liquidação | Vencimento | Valor (R\$) |
|--|------------|------------|-----------------------|
| CAIXA BRASIL IMA B 5+ TÍP RF LP | D+0 | | 13.051.368,25 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP | D+0 | | 56.068.331,00 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | D+0 | | 60.330.793,73 |
| CAIXA BRASIL RF ATIVA LP | D +1 | | 8.022.801,51 |
| ITAU DINAMICA RF FICFI | D+1 du | | 53.128.737,70 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC (150) | D+1 du | | 6.915.005,43 |
| SANTANDER RF ATIVO FIC (350) | D+1 du | | 1.882.164,90 |
| BB PREV RF IMA-B5+ TP FI | D+2 du | | 8.944.331,81 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | D+3 du | | 59.279.915,30 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RETORNO TOTAL | D+3 du | | 12.191.063,34 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA | D+3 du | | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO | D+3 du | | 18.466.316,07 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS BDR NÍVEL I | D+4 du | | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 du | | 12.169.869,69 |
| BRDESCO ALOCACAO DINAMICA | D+4 du | | 17.180.264,52 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES | D+8 du | | 11.838.875,60 |
| CAIXA MULTIGESTOR EQUITIES | D+12 du | | 3.136.800,05 |
| | | | 369.211.881,51 |

ACIMA DE 365 DIAS

| Ativo | Liquidação | Vencimento | Valor (R\$) |
|-------------------------------|------------|------------|----------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO XI TP | D+0 | 15/08/2022 | 6.657.361,20 |
| TÍTULOS PÚBLICOS NTN-B 150824 | | 15/08/2024 | 42.507.190,03 |
| | | | 49.164.551,23 |





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cap. 11.690-000

Telefone: (12) 3833-3044 • www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2021

Retorno Mensal "R\$"

| | 2019 | 2020 | jan/21 | fev/21 | mar/21 | abr/21 | mai/21 | jun/21 | jul/21 | ago/21 | set/21 | out/21 | nov/21 | dez/21 | 2021 |
|--|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|---------------------|---------------------|---------------------|--------------------|----------------------|----------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|
| Artigo 7º – Inciso I – Alinea A | 9.110.878,13 | 8.167.617,55 | 733.318,32 | -37.311,17 | 680.164,54 | 677.826,87 | 240.482,72 | -135.046,43 | -71.722,00 | -8.845,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.078.866,89 |
| 4.400 NTN-C 01.04.2021 (IGPM) | 2.439.031,27 | 4.388.740,14 | 798.103,59 | 578.413,16 | 641.038,23 | 29.529,80 | | | | | | | | | 2.047.084,78 |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 6.671.846,86 | 3.778.877,41 | -64.785,27 | -615.724,33 | 39.126,31 | 648.297,07 | 240.482,72 | -135.046,43 | -71.722,00 | 8.845,96 | | | | | 31.782,11 |
| Artigo 7º – Inciso I – Alinea B | 36.414.065,78 | 9.609.488,66 | -1.193.426,39 | -2.269.635,44 | -572.882,06 | 1.253.272,03 | 1.372.980,92 | 489.162,65 | -984.797,90 | -2.142.369,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -4.047.695,48 |
| BB Previdenciário RF Alocação | 7.951.700,44 | 2.933.535,04 | -331.996,56 | 546.292,79 | -249.432,81 | 366.525,93 | 285.336,12 | 66.484,89 | -149.034,66 | -267.294,33 | | | | | -825.704,21 |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 880.460,40 | 528.972,92 | 19.420,94 | -157,60 | 26.001,93 | 27.077,71 | 49.934,98 | 23.458,80 | 44.371,69 | 177.303,35 | | | | | 367.411,80 |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | 1.781.510,38 | 527.439,76 | -160.620,56 | -215.777,41 | -108.161,38 | 42.749,66 | 122.193,33 | 70.248,27 | -71.590,20 | -205.074,88 | | | | | -526.033,17 |
| Caixa FI Brasil IMA-B | 12.406.155,22 | 3.365.820,00 | -500.978,86 | -876.860,65 | -266.079,92 | 351.524,56 | 585.195,52 | 227.624,41 | -226.987,10 | 644.899,51 | | | | | -1.351.461,55 |
| Caixa FIC Brasil Gestão | 10.218.557,49 | 4.350.733,82 | 15.492,65 | -310.985,54 | 183.525,15 | 406.328,02 | 146.917,23 | -1.860,76 | -478.532,66 | -887.409,10 | | | | | -926.525,01 |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | 3.175.681,85 | -2.097.012,88 | -234.744,00 | -319.561,45 | -158.735,03 | 59.066,15 | 183.403,74 | 103.207,04 | -103.024,97 | -314.994,82 | | | | | -785.383,34 |
| 7º – Inciso IV | 2.576.201,88 | 3.470.116,34 | -63.541,28 | -298.814,73 | -7.990,31 | 305.929,68 | 360.814,46 | 266.087,33 | 24.069,96 | -69.909,88 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 516.645,23 |
| Itaú Alocação Ativa | 1.962.978,40 | 1.581.760,75 | 86.132,23 | 38.262,75 | 87.553,27 | 62.118,21 | 149.213,35 | 151.019,36 | 82.435,45 | 162.352,71 | | | | | 819.087,33 |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 42.454,46 | 647.405,36 | 1.387,66 | -12.975,89 | 11.267,40 | 21.432,01 | 43.270,59 | 38.103,08 | 34.354,46 | 20.306,30 | | | | | 157.145,61 |
| BB RF Retorno Total | | 308.791,34 | -57.379,16 | -113.732,21 | -41.854,07 | 85.581,74 | 73.254,80 | 5.738,54 | -13.630,17 | -55.707,47 | | | | | -117.728,00 |
| Bradesco FIC FI Alocação | 501.583,81 | 776.884,47 | -101.032,23 | -166.100,83 | 93.082,72 | 91.033,77 | 72.813,74 | 57.070,36 | -34.634,68 | -86.977,80 | | | | | -260.910,39 |
| Caixa FIC Brasil RF Ativa | | 108.183,61 | 6.788,11 | -42.164,06 | 26.480,13 | 42.605,83 | 16.085,51 | 8.619,75 | -49.687,03 | 114.110,34 | | | | | -105.382,10 |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 69.185,21 | 47.090,81 | 562,11 | 2.104,49 | 1.645,68 | 3.158,12 | 6.176,47 | 5.536,24 | 5.231,93 | 4.226,72 | | | | | 24.432,78 |
| Artigo 8º – Inciso II - A | 0,00 | 3.953.354,88 | -1.157.733,58 | -1.248.300,77 | 1.660.560,00 | 1.004.041,98 | 1.977.721,48 | 112.260,72 | -1.650.040,53 | -1.291.874,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -593.365,22 |
| Caixa FI Ações Small Caps Ativo | 0,00 | 2.046.565,17 | 535.225,92 | -369.689,24 | 742.111,59 | 718.636,24 | 1.166.497,21 | 207.374,28 | -1.066.241,85 | -974.711,41 | | | | | -111.249,10 |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | 0,00 | 1.906.789,71 | -622.507,66 | -878.611,53 | 918.448,41 | 285.405,74 | 811.224,27 | -95.113,56 | -583.798,68 | -317.163,11 | | | | | -482.116,12 |
| Artigo 9º – Inciso II - A | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -36.884,59 | -150.633,11 | -430.718,18 | -319.141,57 | 650.416,10 | 159.637,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -127.324,35 |
| Caixa Multigestor Equities | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -30.413,08 | 16.041,56 | -17.044,56 | 3.657,67 | 72.980,14 | 6.578,32 | | | | | 51.800,05 |
| Santander Global Equities | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -6.471,51 | -166.674,67 | -413.673,62 | -322.799,24 | 577.435,96 | 153.058,68 | | | | | -179.124,40 |
| Artigo 9º – Inciso III - A | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.240,27 | 48.529,41 | -229.534,49 | -592.063,88 | -299.308,00 | 912.477,01 | 465.203,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 309.543,32 |
| BB Ações ESG Globais | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.228,22 | 6.498,09 | -125.600,16 | -226.631,95 | -189.188,12 | 416.211,51 | 247.156,04 | | | | | 129.673,63 |
| Caixa Ações BDR | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.012,05 | 42.031,32 | -103.934,33 | -365.431,93 | -110.119,88 | 496.265,50 | 218.046,96 | | | | | 179.869,69 |
| Consolidado | 48.101.145,79 | 25.200.577,43 | -1.681.382,93 | -3.849.821,84 | 1.771.496,99 | 2.860.902,96 | 2.929.217,52 | 114.014,70 | -1.119.597,36 | -2.888.159,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -1.863.329,61 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

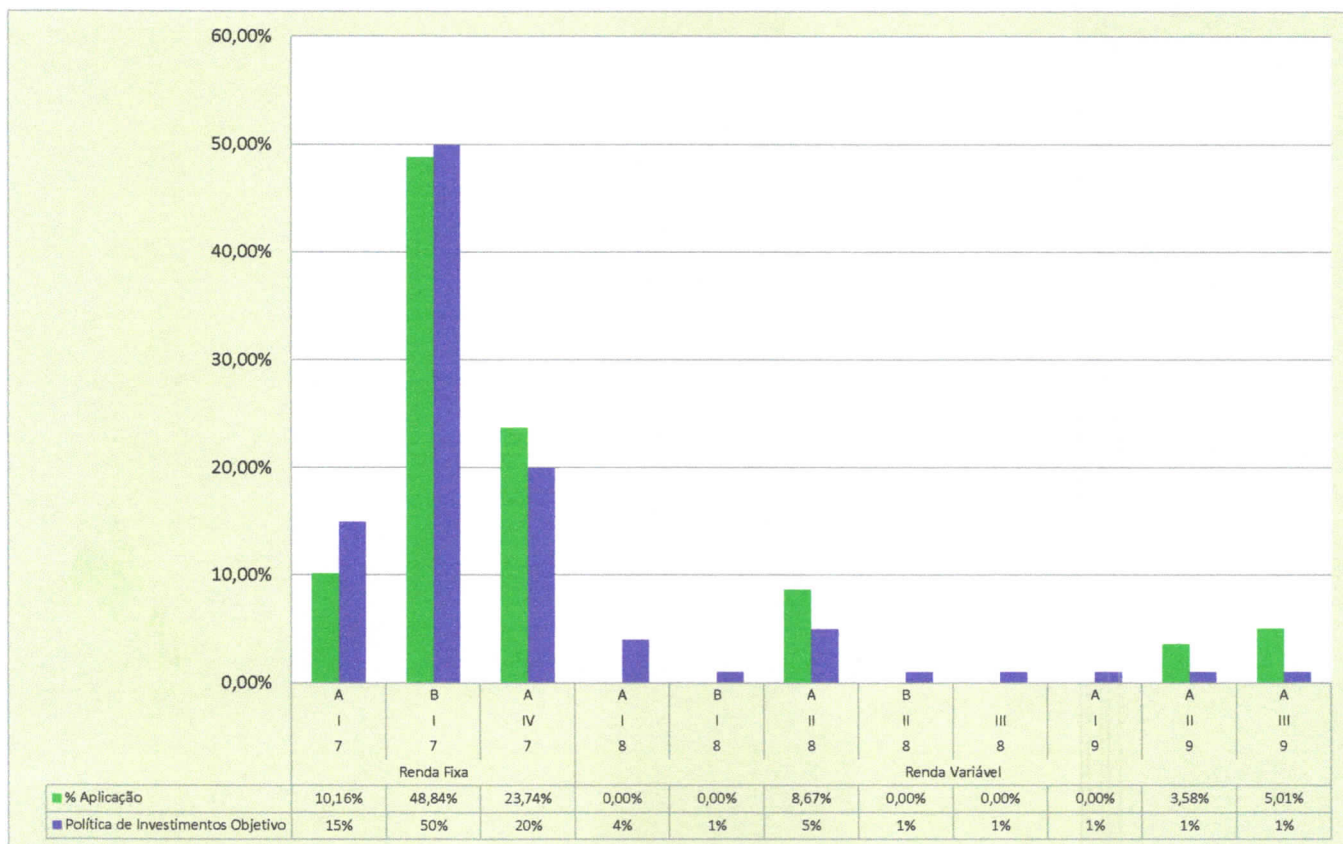
Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2021

AGOSTO

| Enquadramento - Resolução | | | | | % Aplicação | Política de Investimentos | | |
|---------------------------|--------|--------|--------|--------|---------------|---------------------------|----------|--------|
| Segmento | Artigo | Inciso | Alínea | Límite | | Mínimo | Objetivo | Máximo |
| Renda Fixa | 7 | I | A | 100% | 10,16% | 15% | 15% | 100% |
| | 7 | I | B | 100% | 48,84% | 0% | 50% | 100% |
| | 7 | IV | A | 40% | 23,74% | 0% | 20% | 40% |
| Renda Variável | 8 | I | A | 30% | 0,00% | 0% | 4% | 30% |
| | 8 | I | B | 30% | 0,00% | 0% | 1% | 30% |
| | 8 | II | A | 20% | 8,67% | 0% | 5% | 20% |
| | 8 | II | B | 20% | 0,00% | 0% | 1% | 20% |
| | 8 | III | | 10% | 0,00% | 0% | 1% | 20% |
| | 9 | I | A | 10% | 0,00% | 0% | 1% | 10% |
| | 9 | II | A | 10% | 3,58% | 0% | 1% | 10% |
| | 9 | III | A | 10% | 5,01% | 0% | 1% | 10% |





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cap. 11.660-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2021

| | dez/19 | dez/20 | jan/21 | fev/21 | mar/21 | abr/21 | mai/21 | jun/21 | ju/21 | ago/21 | set/21 | out/21 | nov/21 | dez/21 |
|--|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|--------|--------|--------|--------|
| Artigo 7º – Inciso I – Alinea A (até 100%) | 62.877.843,20 | 67.704.345,18 | 68.437.663,50 | 67.262.310,24 | 67.942.474,78 | 43.671.581,40 | 43.912.064,12 | 43.777.017,69 | 43.705.295,69 | 42.507.190,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 4.400 NTN-C 01.04.2021 (IGPM) | 19.674.136,21 | 22.901.635,47 | 23.699.739,06 | 24.278.152,22 | 24.919.190,45 | | | | | | | | | |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 43.203.706,99 | 44.802.709,71 | 44.737.924,44 | 42.984.158,02 | 43.023.284,33 | 43.671.581,40 | 43.912.064,12 | 43.777.017,69 | 43.705.295,69 | 42.507.190,03 | | | | |
| Artigo 7º – Inciso I – Alinea B (até 100%) | 246.181.192,14 | 208.876.680,80 | 207.683.254,41 | 205.241.026,93 | 204.668.144,87 | 205.921.416,90 | 207.294.397,82 | 207.783.560,47 | 206.798.762,57 | 204.332.101,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF Alocação Ativa | 60.841.715,28 | 60.105.619,51 | 59.773.622,95 | 59.227.330,16 | 58.977.897,35 | 59.344.423,28 | 59.629.759,40 | 59.696.244,29 | 59.547.209,63 | 59.279.915,30 | | | | |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 6.588.229,70 | 6.786.833,43 | 6.806.254,37 | 6.633.504,73 | 6.659.506,66 | 6.686.584,37 | 6.736.519,35 | 6.759.978,15 | 6.804.349,84 | 6.657.361,20 | | | | |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | 16.942.925,22 | 9.470.364,98 | 9.309.744,42 | 9.093.967,01 | 8.985.805,63 | 9.028.555,29 | 9.150.748,62 | 9.220.996,89 | 9.149.406,69 | 8.944.331,81 | | | | |
| Caixa FI Brasil IMA-B | 58.967.972,55 | 57.419.792,55 | 56.918.813,69 | 56.041.953,04 | 55.775.873,12 | 56.127.397,68 | 56.712.593,20 | 56.940.217,61 | 56.713.230,51 | 56.068.331,00 | | | | |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica | 66.906.584,92 | 61.257.318,74 | 61.272.811,39 | 60.961.825,85 | 61.145.351,00 | 61.551.679,02 | 61.698.596,25 | 61.696.735,49 | 61.218.202,83 | 60.330.793,73 | | | | |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | 35.933.764,47 | 13.836.751,59 | 13.602.007,59 | 13.282.446,14 | 13.123.711,11 | 13.182.777,26 | 13.366.181,00 | 13.469.388,04 | 13.366.363,07 | 13.051.368,25 | | | | |
| 7º – Inciso IV (até 40%) | 92.509.807,22 | 117.515.392,17 | 114.611.850,89 | 112.858.036,16 | 110.168.045,85 | 107.853.975,53 | 105.607.789,99 | 104.495.877,32 | 101.909.947,28 | 99.320.037,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Itaú Alocação Ativa | 45.542.889,62 | 64.309.650,37 | 64.395.782,60 | 61.434.045,35 | 58.521.598,62 | 55.583.716,83 | 52.732.930,18 | 52.883.949,54 | 52.966.384,99 | 53.128.737,70 | | | | |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 28.602.454,46 | 13.524.859,82 | 10.696.247,48 | 12.213.271,59 | 12.552.538,99 | 12.903.971,00 | 13.340.241,59 | 12.000.344,67 | 9.434.699,13 | 6.915.005,43 | | | | |
| BB RF Retorno Total | 0,00 | 12.308.791,34 | 12.251.412,18 | 12.137.679,97 | 12.095.825,90 | 12.181.407,64 | 12.254.662,44 | 12.260.400,98 | 12.246.770,81 | 12.191.063,34 | | | | |
| Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica | 16.667.821,83 | 17.441.174,91 | 17.340.142,68 | 17.174.041,85 | 17.080.959,13 | 17.171.992,90 | 17.244.806,64 | 17.301.877,00 | 17.267.242,32 | 17.180.264,52 | | | | |
| Caixa FIC Brasil RF Ativa | 0,00 | 8.128.183,61 | 8.134.971,72 | 8.092.807,66 | 8.119.287,79 | 8.161.893,62 | 8.177.979,13 | 8.186.598,88 | 8.136.911,85 | 8.022.801,51 | | | | |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 1.696.641,31 | 1.802.732,12 | 1.793.294,23 | 1.806.189,74 | 1.797.835,42 | 1.850.993,54 | 1.857.170,01 | 1.862.706,25 | 1.857.938,18 | 1.882.164,90 | | | | |
| Artigo 8º – Inciso I - A (até 30%) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 8º – Inciso II - A (até 20%) | 0,00 | 30.499.354,88 | 29.341.621,30 | 30.509.320,53 | 32.169.880,53 | 33.173.922,51 | 36.691.643,99 | 36.918.904,71 | 37.583.864,18 | 36.291.989,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Caixa FI Ações Small Caps Ativo | 0,00 | 15.384.565,17 | 14.849.339,25 | 15.687.650,01 | 16.429.761,60 | 17.148.397,84 | 19.084.895,05 | 19.292.269,33 | 19.441.027,48 | 18.466.316,07 | | | | |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | 0,00 | 15.114.789,71 | 14.492.282,05 | 14.821.670,52 | 15.740.118,93 | 16.025.524,67 | 17.606.748,94 | 17.626.635,38 | 18.142.836,70 | 17.825.673,59 | | | | |
| Artigo 8º – Inciso II - B (até 20%) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.048.115,41 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.975.675,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 8º – Inciso III - B (até 10%) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.048.115,41 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 14.975.675,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 9º – Inciso I - A (até 10%) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 9º – Inciso II - A (até 10%) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.048.115,41 | 12.714.482,30 | 13.189.764,12 | 12.870.622,55 | 13.631.038,65 | 14.975.675,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Caixa Multigestor Global Equities IE | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 969.586,92 | 985.628,48 | 1.758.583,92 | 1.762.241,59 | 1.945.221,73 | 3.136.800,05 | | | | |
| Santander Global Equities IE | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.078.528,49 | 11.728.853,82 | 11.431.180,20 | 11.108.380,96 | 11.685.816,92 | 11.838.875,60 | | | | |
| Artigo 9º – Inciso III - A (até 10%) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.326.832,31 | 1.565.361,72 | 17.985.827,23 | 17.393.763,35 | 17.094.455,35 | 18.006.932,36 | 20.949.438,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| BB Ações ESG Globais | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 173.820,26 | 180.318,35 | 8.354.718,19 | 8.128.086,24 | 7.938.898,12 | 8.355.109,63 | 8.779.569,02 | | | | |
| Caixa Ações BDR Nível I | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.153.012,05 | 1.385.043,37 | 9.631.109,04 | 9.265.677,11 | 9.155.557,23 | 9.651.822,73 | 12.169.869,69 | | | | |
| Consolidado | 401.568.842,56 | 424.595.773,03 | 420.074.390,10 | 417.197.526,17 | 418.562.023,16 | 421.321.205,87 | 424.089.423,39 | 422.940.438,09 | 421.635.840,73 | 418.376.432,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

| | 2018 | % PL | 2019 | % PL | 2020 | % PL | ago/21 | % PL |
|--|------|------|------|------|------|------|--------|------|
|--|------|------|------|------|------|------|--------|------|

| Artigo 7º – Inciso I – Alínea A (até 100%) | 56.911.029,10 | 16,38% | 62.877.843,20 | 15,66% | 67.704.345,18 | 15,95% | 42.507.190,03 | 10,16% |
|--|---------------|--------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|--------|
| 4.400 NTN-C 01.04.2021 (IGPM) | 18.268.012,89 | 5,26% | 19.674.136,21 | 4,90% | 22.901.635,47 | 5,39% | 0,00 | 0,00% |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 38.643.016,21 | 11,12% | 43.203.706,99 | 10,76% | 44.802.709,71 | 10,55% | 42.507.190,03 | 10,16% |

| Artigo 7º – Inciso I – Alínea B (até 100%) | 187.536.780,59 | 53,97% | 246.181.192,14 | 61,30% | 208.876.680,80 | 49,19% | 204.332.101,29 | 48,84% |
|--|----------------|--------|----------------|--------|----------------|--------|----------------|--------|
| BB Previdenciário RF Alocação Ativa | 67.731.632,55 | 19,49% | 60.841.715,28 | 15,15% | 60.105.619,51 | 14,16% | 59.279.915,30 | 14,17% |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 6.077.820,45 | 1,75% | 6.588.229,70 | 1,64% | 6.786.833,43 | 1,60% | 6.657.361,20 | 1,59% |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | 0,00 | 0,00% | 16.942.925,22 | 4,22% | 9.470.364,98 | 2,23% | 8.944.331,81 | 2,14% |
| Caixa FI Brasil IMA-B | 51.302.817,33 | 14,76% | 58.967.972,55 | 14,68% | 57.419.792,55 | 13,52% | 56.068.331,00 | 13,40% |
| Santander IMA-B 5 TP | 56.439.335,60 | 16,24% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| Bradesco TP 2019 | 5.985.174,66 | 1,72% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica | 0,00 | 0,00% | 66.906.584,92 | 16,66% | 61.257.318,74 | 14,43% | 60.330.793,73 | 14,42% |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | 0,00 | 0,00% | 35.933.764,47 | 8,95% | 13.836.751,59 | 3,26% | 13.051.368,25 | 3,12% |

| 7º – Inciso IV (até 40%) | 103.044.794,81 | 29,65% | 92.509.807,22 | 23,04% | 117.515.392,17 | 27,68% | 99.320.087,40 | 23,74% |
|-----------------------------------|----------------|--------|---------------|--------|----------------|--------|---------------|--------|
| Itaú Alocação Ativa | 20.637.682,40 | 5,94% | 45.542.889,62 | 11,34% | 64.309.650,37 | 15,15% | 53.128.737,70 | 12,70% |
| Bradesco RF Referenciado DI | 14.305.456,59 | 4,12% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 0,00 | 0,00% | 28.602.454,46 | 7,12% | 13.524.859,82 | 3,19% | 6.915.055,43 | 1,65% |
| BB RF Retorno Total | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 12.308.791,34 | 2,90% | 12.191.063,34 | 2,91% |
| Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica | 0,00 | 0,00% | 16.667.821,83 | 4,15% | 17.441.174,91 | 4,11% | 17.180.264,52 | 4,11% |
| Caixa Gestão Ativa | 66.688.027,43 | 19,19% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| Caixa FIC Brasil RF Ativa | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 8.128.183,61 | 1,91% | 8.022.801,51 | 1,92% |
| Santander Institucional DI (350) | 1.413.628,39 | 0,41% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 0,00 | 0,00% | 1.696.641,31 | 0,42% | 1.802.732,12 | 0,42% | 1.882.164,90 | 0,45% |

| Artigo 8º – Inciso II - A (até 20%) | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 30.499.354,88 | 7,18% | 36.291.989,66 | 8,67% |
|-------------------------------------|------|-------|------|-------|---------------|-------|---------------|-------|
| Caixa Small Caps Ativo | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 15.384.565,17 | 3,62% | 18.466.316,07 | 4,41% |
| Caixa Infraestrutura | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 15.114.789,71 | 3,56% | 17.825.673,59 | 4,26% |

| Artigo 9º – Inciso II - A (até 10%) | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 14.975.675,65 | 3,58% |
|-------------------------------------|------|-------|------|-------|------|-------|---------------|-------|
| Caixa Multigestor Equities | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 3.136.800,05 | 0,75% |
| Santander Multigestor Equities | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 11.838.875,60 | 2,83% |

| Artigo 9º – Inciso III - A (até 10%) | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 20.949.438,71 | 5,01% |
|--------------------------------------|------|-------|------|-------|------|-------|---------------|-------|
| BB Ações ESG Globais | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 8.779.569,02 | 2,10% |
| Caixa Ações BDR Nível I | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 12.169.869,69 | 2,91% |

| | | | | | | | | |
|--------------------|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|--|
| Consolidado | 347.492.604,50 | | 401.568.842,56 | | 424.595.773,03 | | 418.376.482,74 | |
|--------------------|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|--|-----------------------|--|



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2021

| Agosto | Variações | Orçamentária |
|--|----------------------|------------------|
| Títulos Públicos Artigo 7º – Inciso I – Alínea A (até 100%) | -8.845,96 | 0,00 |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | -8.845,96 | 0,00 |
| Fundos 100% Títulos Públicos Artigo 7º – Inciso I – Alínea B (até 100%) | -2.142.369,29 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF Alocação Ativa | -267.294,33 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 177.303,35 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | -205.074,88 | 0,00 |
| Caixa FI Brasil IMA-B TP RF | -644.899,51 | 0,00 |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica | -887.409,10 | 0,00 |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | -314.994,82 | 0,00 |
| Fundo Renda Fixa Artigo 7º – Inciso IV (até 40%) | -94.442,90 | 24.533,02 |
| Itaú Alocação Ativa | 162.352,71 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF Retorno Total | -55.707,47 | 0,00 |
| Caixa Renda Fixa Ativa | -114.110,34 | 0,00 |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 0,00 | 20.306,30 |
| Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica | -86.977,80 | 0,00 |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 0,00 | 4.226,72 |
| Fundo Renda Variável Artigo 8º – Inciso II (até 20%) | -1.291.874,52 | 0,00 |
| Caixa FI Ações Small Caps | -974.711,41 | 0,00 |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | -317.163,11 | 0,00 |
| Fundo Renda Variável Artigo 9º – Inciso II a (até 10%) | 159.637,00 | 0,00 |
| Caixa Multigestor Global Equities | 6.578,32 | 0,00 |
| Santander Global Equiteis | 153.058,68 | 0,00 |
| Fundo Renda Variável Artigo 9º - Inciso III - A (até 10%) | 465.203,00 | 0,00 |
| BB Ações ESG Globais | 247.156,04 | 0,00 |
| Caixa Ações BDR Nível I | 218.046,96 | 0,00 |

-2.912.692,67 **24.533,02**

-2.888.159,65

Juros Semestrais Fundo BB RF TP XI 2022

177.303,35

Juros Semestrais Títulos 2021

1.189.259,70

-1.521.596,60



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

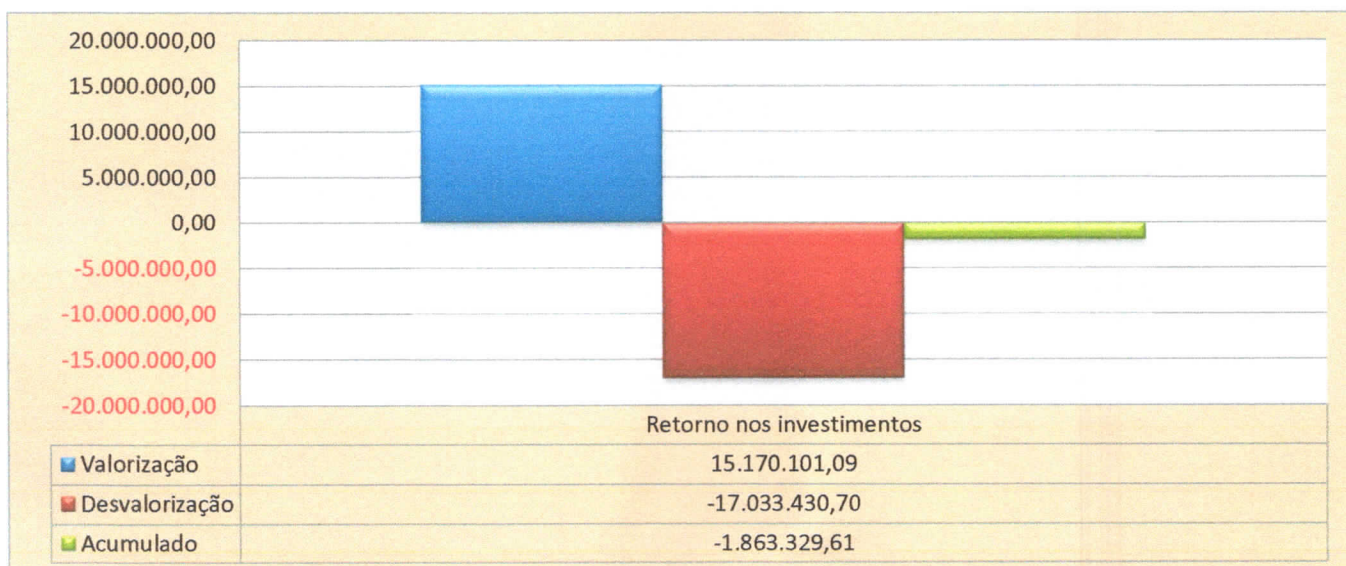
Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – VALORIZAÇÃO E DESVALORIZAÇÃO

| Variações | Dezembro/2020 | Valorização | Desvalorização | Acumulado | Agosto/2021 |
|-------------------------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|----------------------|-----------------------|
| Títulos Públicos | 67.704.345,18 | 2.974.990,88 | -896.123,99 | 2.078.866,89 | 42.507.190,03 |
| 4.400 NTN-C 01.04.2021 (IGPM) | 22.901.635,47 | 2.047.084,78 | 0,00 | 2.047.084,78 | 0,00 |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 44.802.709,71 | 927.906,10 | -896.123,99 | 31.782,11 | 42.507.190,03 |
| Fundos 100% Títulos Públicos | 208.876.680,80 | 3.583.392,07 | -7.631.087,55 | -4.047.695,48 | 204.332.101,29 |
| BB Previdenciário Alocação | 60.105.619,51 | 718.346,94 | -1.544.051,15 | -825.704,21 | 59.279.915,30 |
| BB Previdenciário Títulos 2022 | 6.786.833,43 | 367.569,40 | -157,60 | 367.411,80 | 6.657.361,20 |
| BB Previdenciário IMA-B 5+ | 9.470.364,98 | 235.191,26 | -761.224,43 | -526.033,17 | 8.944.331,81 |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | 13.836.751,59 | 345.676,93 | -1.131.060,27 | -785.383,34 | 13.051.368,25 |
| Caixa Brasil Gestão Estratégica | 61.257.318,74 | 752.263,05 | -1.678.788,06 | -926.525,01 | 60.330.793,73 |
| Caixa Brasil IMA-B | 57.419.792,55 | 1.164.344,49 | -2.515.806,04 | -1.351.461,55 | 56.068.331,00 |
| Fundo Renda Fixa DI | 117.515.392,17 | 1.501.818,38 | -985.173,15 | 516.645,23 | 99.320.037,40 |
| Bradesco FIC FI Alocação | 17.441.174,91 | 220.917,87 | -481.828,26 | -260.910,39 | 17.180.264,52 |
| BB Previdenciário Retorno Total | 12.308.791,34 | 164.575,08 | -282.303,08 | -117.728,00 | 12.191.063,34 |
| Caixa Brasil RF Ativa | 8.128.183,61 | 100.579,33 | -205.961,43 | -105.382,10 | 8.022.801,51 |
| Itaú Institucional Alocação | 64.309.650,37 | 819.087,33 | 0,00 | 819.087,33 | 53.128.737,70 |
| Santander RF Ativo (350) | 1.802.732,12 | 26.537,27 | -2.104,49 | 24.432,78 | 1.882.164,90 |
| Santander RF Ativo (150) | 13.524.859,82 | 170.121,50 | -12.975,89 | 157.145,61 | 6.915.005,43 |
| Fundo Renda Variável | 30.499.354,88 | 4.849.697,74 | -5.443.062,96 | -593.365,22 | 36.291.989,66 |
| Caixa Small Cap Ativo | 15.384.565,17 | 2.834.619,32 | -2.945.868,42 | -111.249,10 | 18.466.316,07 |
| Caixa Infraestrutura | 15.114.789,71 | 2.015.078,42 | -2.497.194,54 | -482.116,12 | 17.825.673,59 |
| Fundo Renda Variável | 0,00 | 829.752,33 | -957.076,68 | -127.324,35 | 14.975.675,65 |
| Caixa Multigestor Equities | 0,00 | 99.257,69 | -47.457,64 | 51.800,05 | 3.136.800,05 |
| Santander Global Equities | 0,00 | 730.494,64 | -909.619,04 | -179.124,40 | 11.838.875,60 |
| Fundo Renda Variável | 0,00 | 1.430.449,69 | -1.120.906,37 | 309.543,32 | 20.949.438,71 |
| BB Ações ESG Globais | 0,00 | 671.093,86 | -541.420,23 | 129.673,63 | 8.779.569,02 |
| Caixa Ações BDR Nível I | 0,00 | 759.355,83 | -579.486,14 | 179.869,69 | 12.169.869,69 |
| Consolidado | 424.595.773,03 | 15.170.101,09 | -17.033.430,70 | -1.863.329,61 | 418.376.432,74 |





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2021

| Agosto | Variações | Orçamentária |
|--|----------------------|------------------|
| Títulos Públicos Artigo 7º – Inciso I – Alínea A (até 100%) | -8.845,96 | 0,00 |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | -8.845,96 | 0,00 |
| Fundos 100% Títulos Públicos Artigo 7º – Inciso I – Alínea B (até 100%) | -2.142.369,29 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF Alocação Ativa | -267.294,33 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 177.303,35 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | -205.074,88 | 0,00 |
| Caixa FI Brasil IMA-B TP RF | -644.899,51 | 0,00 |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica | -887.409,10 | 0,00 |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | -314.994,82 | 0,00 |
| Fundo Renda Fixa Artigo 7º – Inciso IV (até 40%) | -94.442,90 | 24.533,02 |
| Itaú Alocação Ativa | 162.352,71 | 0,00 |
| BB Previdenciário RF Retorno Total | -55.707,47 | 0,00 |
| Caixa Renda Fixa Ativa | -114.110,34 | 0,00 |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 0,00 | 20.306,30 |
| Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica | -86.977,80 | 0,00 |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 0,00 | 4.226,72 |
| Fundo Renda Variável Artigo 8º – Inciso II (até 20%) | -1.291.874,52 | 0,00 |
| Caixa FI Ações Small Caps | -974.711,41 | 0,00 |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | -317.163,11 | 0,00 |
| Fundo Renda Variável Artigo 9º – Inciso II a (até 10%) | 159.637,00 | 0,00 |
| Caixa Multigestor Global Equities | 6.578,32 | 0,00 |
| Santander Global Equiteis | 153.058,68 | 0,00 |
| Fundo Renda Variável Artigo 9º - Inciso III - A (até 10%) | 465.203,00 | 0,00 |
| BB Ações ESG Globais | 247.156,04 | 0,00 |
| Caixa Ações BDR Nível I | 218.046,96 | 0,00 |

-2.912.692,67 **24.533,02**

-2.888.159,65

Juros Semestrais Títulos 2021

1.189.259,70



ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

| | |
|--------|--------------------|
| 2001 | R\$ 29.673.542,26 |
| 2002 | R\$ 38.783.607,62 |
| 2003 | R\$ 50.508.505,19 |
| 2004 | R\$ 61.389.707,26 |
| 2005 | R\$ 73.126.810,77 |
| 2006 | R\$ 81.993.867,57 |
| 2007 | R\$ 95.577.547,91 |
| 2008 | R\$ 107.679.653,49 |
| 2009 | R\$ 129.356.586,31 |
| 2010 | R\$ 145.183.600,57 |
| 2011 | R\$ 165.255.228,91 |
| 2012 | R\$ 207.355.171,18 |
| 2013 | R\$ 195.262.412,60 |
| 2014 | R\$ 217.682.873,02 |
| 2015 | R\$ 243.893.483,43 |
| 2016 | R\$ 282.264.739,86 |
| 2017 | R\$ 317.453.068,61 |
| 2018 | R\$ 347.492.604,50 |
| 2019 | R\$ 401.568.842,56 |
| 2020 | R\$ 424.595.773,03 |
| ago/21 | R\$ 418.376.432,74 |





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2021

Aplicação Patrimônio "%"

| | dez/19 | dez/20 | jan/21 | fev/21 | mar/21 | abr/21 | mai/21 | jun/21 | jul/21 | ago/21 | set/21 | out/21 | nov/21 | dez/21 |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| Artigo 7º – Inciso I – Alínea A (até 100%) | 15,69% | 15,94% | 16,29% | 16,12% | 16,23% | 10,37% | 10,35% | 10,35% | 10,37% | 10,16% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| 4.400 NTN-C 01.04.2021 (IGPM) | 4,90% | 5,39% | 5,64% | 5,82% | 5,95% | | | | | | | | | |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 10,79% | 10,55% | 10,65% | 10,30% | 10,28% | 10,37% | 10,35% | 10,35% | 10,37% | 10,16% | | | | |
| Artigo 7º – Inciso I – Alínea B (até 100%) | 61,30% | 49,20% | 49,44% | 49,19% | 48,91% | 48,88% | 48,88% | 49,12% | 49,04% | 48,84% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BB Previdenciário RF Alocação Ativa | 15,15% | 14,16% | 14,23% | 14,20% | 14,09% | 14,09% | 14,06% | 14,11% | 14,12% | 14,17% | | | | |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 1,64% | 1,60% | 1,62% | 1,59% | 1,59% | 1,59% | 1,59% | 1,60% | 1,61% | 1,59% | | | | |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | 4,22% | 2,23% | 2,22% | 2,18% | 2,15% | 2,14% | 2,16% | 2,18% | 2,17% | 2,14% | | | | |
| Caixa FI Brasil IMA-B | 14,68% | 13,52% | 13,55% | 13,43% | 13,33% | 13,32% | 13,37% | 13,46% | 13,45% | 13,40% | | | | |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica | 16,66% | 14,43% | 14,58% | 14,61% | 14,61% | 14,61% | 14,55% | 14,59% | 14,52% | 14,42% | | | | |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | 8,95% | 3,26% | 3,24% | 3,18% | 3,14% | 3,13% | 3,15% | 3,18% | 3,17% | 3,12% | | | | |
| 7º – Inciso IV (até 40%) | 23,03% | 27,68% | 27,30% | 27,06% | 26,32% | 25,60% | 24,91% | 24,71% | 24,17% | 23,74% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Itaú Alocação Ativa | 11,34% | 15,15% | 15,33% | 14,73% | 13,98% | 13,19% | 12,43% | 12,50% | 12,56% | 12,70% | | | | |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 7,12% | 3,19% | 2,55% | 2,93% | 3,00% | 3,06% | 3,15% | 2,84% | 2,24% | 1,65% | | | | |
| BB RF Retorno Total | 0,00% | 2,90% | 2,92% | 2,91% | 2,89% | 2,89% | 2,89% | 2,90% | 2,90% | 2,91% | | | | |
| Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica | 4,15% | 4,11% | 4,13% | 4,12% | 4,08% | 4,08% | 4,07% | 4,09% | 4,10% | 4,11% | | | | |
| Caixa FIC Brasil RF Ativa | 0,42% | 1,91% | 1,94% | 1,94% | 1,94% | 1,94% | 1,93% | 1,94% | 1,93% | 1,92% | | | | |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 0,00% | 0,42% | 0,43% | 0,43% | 0,43% | 0,44% | 0,44% | 0,44% | 0,44% | 0,45% | | | | |
| Artigo 8º – Inciso II - A (até 20%) | 0,00% | 7,18% | 6,98% | 7,31% | 7,69% | 7,87% | 8,65% | 8,73% | 8,91% | 8,67% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Caixa Small Caps Ativo | 0,00% | 3,62% | 3,53% | 3,76% | 3,93% | 4,07% | 4,50% | 4,56% | 4,61% | 4,41% | | | | |
| Caixa Infraestrutura | 0,00% | 3,56% | 3,45% | 3,55% | 3,76% | 3,80% | 4,15% | 4,17% | 4,30% | 4,26% | | | | |
| Artigo 9º – Inciso II - A (até 10%) | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,46% | 3,01% | 3,11% | 3,05% | 3,23% | 3,58% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| Caixa Multigestor Global Equities | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,20% | 0,23% | 0,41% | 0,42% | 0,46% | 0,75% | | | | |
| Santander Global Equities | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,26% | 2,78% | 2,70% | 2,63% | 2,77% | 2,83% | | | | |
| Artigo 9º – Inciso III - A (até 10%) | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,32% | 0,37% | 4,27% | 4,10% | 4,04% | 4,27% | 5,01% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% |
| BB Ações ESG Global | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,04% | 0,04% | 1,98% | 1,92% | 1,88% | 1,98% | 2,10% | | | | |
| Caixa Ações BDR Nível I | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,28% | 0,33% | 2,29% | 2,18% | 2,16% | 2,29% | 2,91% | | | | |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.690-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

Carteira de Investimentos - Aplicação por Fundo de Investimentos

| ago/21 | Valor | % PL |
|---|-----------------------|----------------|
| Artigo 7º – Inciso I – Alínea A (até 100%) | 42.507.190,03 | 10,16% |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 42.507.190,03 | 10,16% |
| Artigo 7º – Inciso I – Alínea B (até 100%) | 204.332.101,29 | 48,84% |
| BB Previdenciário RF Alocação Ativa | 59.279.915,30 | 14,17% |
| BB Previdenciário RF TP XI 2022 | 6.657.361,20 | 1,59% |
| BB Previdenciário RF IMA-B 5+ | 8.944.331,81 | 2,14% |
| Caixa FI Brasil IMA-B | 56.068.331,00 | 13,40% |
| Caixa FIC Brasil Gestão Estratégica | 60.330.793,73 | 14,42% |
| Caixa FI Brasil IMA-B 5+ | 13.051.368,25 | 3,12% |
| 7º – Inciso IV (até 40%) | 99.320.037,40 | 23,74% |
| Itaú Alocação Ativa | 53.128.737,70 | 12,70% |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 6.915.005,43 | 1,65% |
| BB RF Retorno Total | 12.191.063,34 | 2,91% |
| Bradesco FIC FI Alocação Dinâmica | 17.180.264,52 | 4,11% |
| Caixa FIC Brasil RF Ativa | 8.022.801,51 | 1,92% |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 1.882.164,90 | 0,45% |
| Artigo 8º – Inciso II - A (até 20%) | 36.291.953,66 | 8,67% |
| Caixa FI Ações Small Caps Ativo | 18.466.316,07 | 4,41% |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | 17.825.637,59 | 4,26% |
| Artigo 9º – Inciso II - A (até 10%) | 14.975.675,65 | 3,58% |
| Caixa Multigestor Global Equities IE | 3.136.800,05 | 0,75% |
| Santander Global Equities | 11.838.875,60 | 2,83% |
| Artigo 9º – Inciso III - A (até 10%) | 20.949.438,71 | 5,01% |
| BB Ações ESG Globais | 8.779.569,02 | 2,10% |
| Caixa Ações BDR Nível I | 12.169.869,69 | 2,91% |
| Consolidado | 418.376.396,74 | 100,00% |

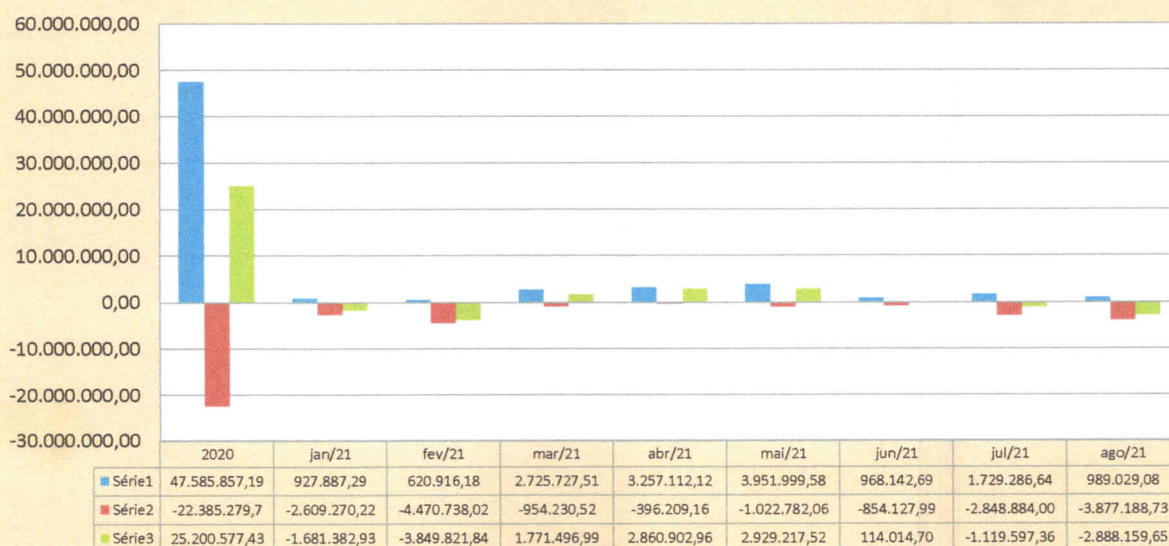


ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

| Valorização | Desvalorização | Consolidado |
|-------------|----------------|-------------|
|-------------|----------------|-------------|

| | | | | |
|--------|---------------|----------------|----------------------|----------------------|
| 2019 | 54.216.306,30 | -6.115.160,51 | 48.101.145,79 | -1.863.329,61 |
| 2020 | 47.585.857,19 | -22.385.279,76 | 25.200.577,43 | |
| jan/21 | 927.887,29 | -2.609.270,22 | -1.681.382,93 | |
| fev/21 | 620.916,18 | -4.470.738,02 | -3.849.821,84 | |
| mar/21 | 2.725.727,51 | -954.230,52 | 1.771.496,99 | |
| abr/21 | 3.257.112,12 | -396.209,16 | 2.860.902,96 | |
| mai/21 | 3.951.999,58 | -1.022.782,06 | 2.929.217,52 | |
| jun/21 | 968.142,69 | -854.127,99 | 114.014,70 | |
| jul/21 | 1.729.286,64 | -2.848.884,00 | -1.119.597,36 | |
| ago/21 | 989.029,08 | -3.877.188,73 | -2.888.159,65 | |

Resultado dos Investimentos





Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – DESVALORIZAÇÃO 2021

| | Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Maió | Junho | Julho | Agoosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro | Acumulado |
|--------------------------------------|----------------------|----------------------|--------------------|--------------------|----------------------|--------------------|----------------------|----------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------|
| Artigo 7º I A | -64.785,27 | -615.724,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -135.046,43 | -71.722,00 | -8.845,96 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -896.123,99 |
| 4.400 NTN-C 01.04.2021 (IGPM) | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | -64.785,27 | -615.724,33 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -135.046,43 | -71.722,00 | -8.845,96 | | | | | -896.123,99 |
| Artigo 7º I B | -1.228.339,98 | -2.269.635,44 | -782.409,14 | 0,00 | 0,00 | -1.860,76 | -1.029.169,59 | -2.319.672,64 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -7.631.087,55 |
| BB Previdenciário Títulos 2022 | 0,00 | -157,60 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | -157,60 |
| BB Previdenciário Alocação | -331.996,56 | -546.292,79 | -249.432,81 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -149.034,66 | -267.294,33 | | | | | -1.544.051,15 |
| BB Previdenciário IMA-B 5+ | -160.620,56 | -215.777,41 | -108.161,38 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -71.590,20 | -205.074,88 | | | | | -761.224,43 |
| Caixa Brasil Gestão Estratégica | 0,00 | -310.985,54 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -1.860,76 | -478.532,66 | -887.409,10 | | | | | -1.678.788,06 |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | -234.744,00 | -319.561,45 | -158.735,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -103.024,97 | -314.994,82 | | | | | -1.131.060,27 |
| Caixa Brasil IMA-B | -500.978,86 | -876.860,65 | -266.079,92 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -226.987,10 | -644.899,51 | | | | | -2.515.806,04 |
| Artigo 7º IV | -158.411,39 | -337.077,48 | -134.936,79 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -97.951,88 | -256.795,61 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -985.173,15 |
| Bradesco FIC FI Alocação | -101.032,23 | -166.100,83 | -93.082,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -34.634,68 | -86.977,80 | | | | | -481.828,26 |
| BB Prev. Retorno Total | -57.379,16 | -113.732,21 | -41.854,07 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -13.630,17 | -55.707,47 | | | | | -282.303,08 |
| Caixa Brasil RF Ativo | 0,00 | -42.164,06 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -49.687,03 | -114.110,34 | | | | | -205.961,43 |
| Santander RF Ativo (150) | 0,00 | -12.975,89 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | -12.975,89 |
| Santander RF Ativo (350) | 0,00 | -2.104,49 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | -2.104,49 |
| Itaú Institucional Alocação Dinâmica | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | 0,00 |
| Artigo 8º II A | -1.157.733,58 | -1.248.300,77 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -95.113,56 | -1.650.040,53 | -1.291.874,52 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -5.443.062,96 |
| Caixa Small Caps | -535.225,92 | -369.689,24 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -1.066.241,85 | -974.711,41 | | | | | -2.945.868,42 |
| Caixa Infraestrutura | -622.507,66 | -878.611,53 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -95.113,56 | -583.798,68 | -317.163,11 | | | | | -2.497.194,54 |
| Artigo 9º II A | 0,00 | 0,00 | -36.884,59 | -166.674,67 | -430.718,18 | -322.799,24 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -957.076,68 |
| Caixa Multigestor Equities | 0,00 | 0,00 | -30.413,08 | 0,00 | -17.044,56 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | -47.457,64 |
| Santander Global Equites | 0,00 | 0,00 | -6.471,51 | -166.674,67 | -413.673,62 | -322.799,24 | 0,00 | 0,00 | | | | | -909.619,04 |
| Artigo 9º III A | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -229.534,49 | -592.063,88 | -299.308,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -1.120.906,37 |
| BB Ações ESG Gloais | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -125.600,16 | -226.631,95 | -189.188,12 | 0,00 | 0,00 | | | | | -541.420,23 |
| Caixa Ações BDR Nivel I | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -103.934,33 | -365.431,93 | -110.119,88 | 0,00 | 0,00 | | | | | -579.486,14 |
| Consolidado | -2.609.270,22 | -4.470.738,02 | -954.230,52 | -396.209,16 | -1.022.782,06 | -854.127,99 | -2.848.884,00 | -3.877.188,73 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | -17.033.430,70 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

CARTEIRA DE INVESTIMENTOS – VALORIZAÇÃO 2021

| | Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Maió | Junho | Julho | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro | Acumulado |
|----------------------------------|-------------------|-------------------|---------------------|---------------------|---------------------|-------------------|---------------------|-------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|----------------------|
| Artigo 7º I A | 798.103,59 | 578.413,16 | 680.164,54 | 677.826,87 | 240.482,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.974.990,88 |
| 4.400 NTN-C 01.04.2021 (IGPM) | 798.103,59 | 578.413,16 | 641.038,23 | 29.529,80 | | | | | | | | | 2.047.084,78 |
| 11.150 NTN-B 15.08.2024 (IPCA) | 0,00 | 0,00 | 39.126,31 | 648.297,07 | 240.482,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | 927.906,10 |
| Artigo 7º I B | 34.913,59 | 0,00 | 209.527,08 | 1.253.272,03 | 1.372.980,92 | 491.023,41 | 44.371,69 | 177.303,35 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 3.583.392,07 |
| BB Previdenciário Alocação | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 366.525,93 | 285.336,12 | 66.484,89 | 0,00 | 0,00 | | | | | 718.346,94 |
| BB Previdenciário Títulos 2022 | 19.420,94 | 0,00 | 26.001,93 | 27.077,71 | 49.934,98 | 23.458,80 | 44.371,69 | 177.303,35 | | | | | 367.569,40 |
| BB Previdenciário IMA-B 5+ | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 42.749,66 | 122.193,33 | 70.248,27 | 0,00 | 0,00 | | | | | 235.191,26 |
| Caixa Brasil IMA-B | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 351.524,56 | 585.195,52 | 227.624,41 | 0,00 | 0,00 | | | | | 1.164.344,49 |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 59.066,15 | 183.403,74 | 103.207,04 | 0,00 | 0,00 | | | | | 345.676,93 |
| Caixa Brasil Gestão Estratégica | 15.492,65 | 0,00 | 183.525,15 | 406.328,02 | 146.917,23 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | 752.263,05 |
| Artigo 7º IV | 94.870,11 | 38.262,75 | 126.946,48 | 305.929,68 | 360.814,46 | 266.087,33 | 122.021,84 | 186.885,73 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.501.818,38 |
| Bradesco Alocação | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 91.033,77 | 72.813,74 | 57.070,36 | 0,00 | 0,00 | | | | | 220.917,87 |
| BB Prev. Retorno Total | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 85.581,74 | 73.254,80 | 5.738,54 | 0,00 | 0,00 | | | | | 164.575,08 |
| Caixa Brasil RF Ativa | 6.788,11 | 0,00 | 26.480,13 | 42.605,83 | 16.085,51 | 8.619,75 | 0,00 | 0,00 | | | | | 100.579,33 |
| Itaú Institucional RF Alocação | 86.132,23 | 38.262,75 | 87.553,27 | 62.118,21 | 149.213,35 | 151.019,36 | 82.435,45 | 162.352,71 | | | | | 819.087,33 |
| Santander RF Ativo (150) | 1.387,66 | 0,00 | 11.267,40 | 21.432,01 | 43.270,59 | 38.103,08 | 34.354,46 | 20.306,30 | | | | | 170.121,50 |
| Santander RF Ativo (350) | 562,11 | 0,00 | 1.645,68 | 3.158,12 | 6.176,47 | 5.536,24 | 5.231,93 | 4.226,72 | | | | | 26.537,27 |
| Artigo 8º II A | 0,00 | 0,00 | 1.660.560,00 | 1.004.041,98 | 1.977.721,48 | 207.374,28 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 4.849.697,74 |
| Caixa Small Caps | 0,00 | 0,00 | 742.111,59 | 718.636,24 | 1.166.497,21 | 207.374,28 | 0,00 | 0,00 | | | | | 2.834.619,32 |
| Caixa Infraestrutura | 0,00 | 0,00 | 918.448,41 | 285.405,74 | 811.224,27 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | | | | | 2.015.078,42 |
| Artigo 9º II A | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.041,56 | 0,00 | 3.657,67 | 650.416,10 | 159.637,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 829.752,33 |
| Caixa Multigestor Global Equites | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 16.041,56 | 0,00 | 3.657,67 | 72.980,14 | 6.578,32 | | | | | 99.257,69 |
| Santander Global Equites | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 577.435,96 | 153.058,68 | | | | | 730.494,64 |
| Artigo 9º III | 0,00 | 4.240,27 | 48.529,41 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 912.477,01 | 465.203,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.430.449,69 |
| BB Ações ESG Globais | 0,00 | 1.228,22 | 6.498,09 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 416.211,51 | 247.156,04 | | | | | 671.093,86 |
| Caixa Ações BDR Nível I | 0,00 | 3.012,05 | 42.031,32 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 496.265,50 | 218.046,96 | | | | | 759.355,83 |
| Consolidado | 927.887,29 | 620.916,18 | 2.725.727,51 | 3.257.112,12 | 3.951.999,58 | 968.142,69 | 1.729.286,64 | 989.029,08 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 15.170.101,09 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cap. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

BALANCETE RESUMIDO DA RECEITA 2021

| AGOSTO | ORÇAMENTO | ANTERIOR | MÊS | CONSOLIDADO |
|--|----------------------|----------------------|---------------------|----------------------|
| Contribuição Servidor | 14.450.000,00 | 6.111.501,26 | 979.010,47 | 7.090.511,73 |
| Contribuição Servidor PMU | 13.000.000,00 | 5.440.406,89 | 875.368,17 | 6.315.775,06 |
| Contribuição Servidor Câmara | 610.000,00 | 269.916,09 | 44.186,53 | 314.102,62 |
| Contribuição Servidor IPMU | 140.000,00 | 44.551,05 | 6.226,96 | 50.778,01 |
| Contribuição Servidor Licenciado | 2.000,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Contribuição Servidor Rescisão | 28.000,00 | 8.365,97 | 3.324,19 | 11.690,16 |
| Contribuição Servidor Inativo | 640.000,00 | 336.091,74 | 48.204,36 | 384.296,10 |
| Contribuição Pensionista | 30.000,00 | 12.169,52 | 1.700,26 | 13.869,78 |
| Outras Receitas | 915.000,00 | 1.183.965,81 | 72.688,19 | 1.256.654,00 |
| COMPREV | 900.000,00 | 1.183.886,81 | 72.688,19 | 1.256.575,00 |
| Outras Restituições | 15.000,00 | 79,00 | 0,00 | 79,00 |
| Aplicações Financeiras | 9.100.000,00 | 8.163.467,23 | 1.391.096,07 | 9.554.563,30 |
| Títulos do Tesouro | 3.600.000,00 | 7.818.749,44 | 1.189.259,70 | 9.008.009,14 |
| Remuneração Renda Fixa | 5.500.000,00 | 344.717,79 | 201.836,37 | 546.554,16 |
| Contribuição Patronal | 20.875.000,00 | 8.608.727,73 | 1.410.802,12 | 10.019.529,85 |
| Contribuição Patronal PMU | 15.000.000,00 | 6.223.261,07 | 1.016.474,53 | 7.239.735,60 |
| Contribuição Patronal Câmara | 710.000,00 | 307.857,38 | 51.288,01 | 359.145,39 |
| Contribuição Patronal IPMU | 160.000,00 | 50.969,49 | 7.227,71 | 58.197,20 |
| Contribuição Patronal Rescisão | 30.000,00 | 9.844,70 | 3.858,40 | 13.703,10 |
| Contribuição Patronal (PMU Déficit) | 4.700.000,00 | 1.903.357,57 | 312.761,40 | 2.216.118,97 |
| Contribuição Patronal (Câmara Déficit) | 220.000,00 | 94.725,43 | 15.780,94 | 110.506,37 |
| Contribuição Patronal (IPMU Déficit) | 50.000,00 | 15.682,98 | 2.223,92 | 17.906,90 |
| Contribuição Patronal (Rescisão Déficit) | 5.000,00 | 3.029,11 | 1.187,21 | 4.216,32 |
| Dívida Patronal | 840.000,00 | 635.972,09 | 99.564,89 | 735.536,98 |
| Parcelamento da dívida PMU | 180.000,00 | 105.000,00 | 15.000,00 | 120.000,00 |
| Juros parcelamento dívida PMU | 660.000,00 | 530.972,09 | 84.564,89 | 615.536,98 |
| Unidade Gestora Única | 150.000,00 | 79.055,23 | 10.683,14 | 89.738,37 |
| Câmara Municipal (Unidade Gestora) | 150.000,00 | 79.055,23 | 10.683,14 | 89.738,37 |
| Total Orçamentário (1) | 46.330.000,00 | 24.782.689,35 | 3.963.844,88 | 28.746.534,23 |

| Rendimento Negativo Investimentos |
|--|
| Santander Ativo 150 |
| Santander Ativo 350 |

| Anterior | Mês | Consolidado |
|------------|------|-------------|
| -15.080,38 | 0,00 | -15.080,38 |
| -12.975,89 | 0,00 | -12.975,89 |
| -2.104,49 | 0,00 | -2.104,49 |

| Total Orçamentário Final |
|---------------------------------|
|---------------------------------|

| Anterior | Mês | Consolidado |
|---------------|--------------|---------------|
| 24.767.608,97 | 3.963.844,88 | 28.731.453,85 |

| Unidade Gestora Prefeitura |
|-----------------------------------|
|-----------------------------------|

| Anterior | Mês | Consolidado |
|--------------|------------|--------------|
| 1.224.275,24 | 160.562,54 | 1.384.837,78 |

| | |
|--------------|---------------|
| 4.124.407,42 | 30.116.291,63 |
|--------------|---------------|



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

| | 31/12/2019 | 31/12/2020 | Jan/2021 | Fev/2021 | mar/2021 | abr/2021 | maio/2021 | junho/2021 |
|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| Artigo 7º I A | 62.877.843,20 | 67.704.345,18 | 68.437.663,50 | 67.262.310,24 | 67.942.474,78 | 43.671.581,40 | 43.912.064,12 | 43.777.017,69 |
| Artigo 7º I b | 246.181.192,14 | 208.876.680,80 | 207.683.254,41 | 205.241.026,93 | 204.668.144,87 | 205.921.416,90 | 207.294.397,82 | 207.783.560,47 |
| Artigo 7º IV | 92.509.807,22 | 117.515.392,17 | 114.611.850,89 | 112.858.036,16 | 110.168.045,85 | 107.853.975,53 | 105.607.789,99 | 104.495.877,32 |
| Artigo 8º II | 0,00 | 30.499.354,88 | 29.341.621,30 | 30.509.320,53 | 32.169.880,53 | 33.173.922,51 | 36.691.643,99 | 36.918.904,71 |
| Artigo 9º II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.048.115,41 | 12.714.482,30 | 13.189.764,12 | 12.870.622,55 |
| Artigo 9º III | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.326.832,31 | 1.565.361,72 | 17.985.827,23 | 17.393.763,35 | 17.094.455,35 |
| | 401.568.842,56 | 424.595.773,03 | 420.074.390,10 | 417.197.526,17 | 418.562.023,16 | 421.321.205,87 | 424.089.423,39 | 422.940.438,09 |

| | | | | | | | | |
|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| Renda Fixa | 401.568.842,56 | 394.096.418,15 | 390.732.768,80 | 385.361.373,33 | 382.778.665,50 | 357.446.973,83 | 356.814.251,93 | 356.056.455,48 |
| Renda Variável | 0,00 | 30.499.354,88 | 29.341.621,30 | 31.836.152,84 | 35.783.357,66 | 63.874.232,04 | 67.275.171,46 | 66.883.982,61 |
| | 401.568.842,56 | 424.595.773,03 | 420.074.390,10 | 417.197.526,17 | 418.562.023,16 | 421.321.205,87 | 424.089.423,39 | 422.940.438,09 |

| | julho/2021 | agosto/2021 | setembro/2021 | outubro/2021 | novembro/2021 | dezembro/2021 |
|---------------|----------------|----------------|---------------|--------------|---------------|---------------|
| Artigo 7º I A | 43.705.295,69 | 42.507.190,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 7º I b | 206.798.762,57 | 204.332.101,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 7º IV | 101.909.947,28 | 99.320.037,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 8º II | 37.583.864,18 | 36.291.989,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 9º II | 13.631.038,65 | 14.975.675,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 9º III | 18.006.932,36 | 20.949.438,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | 421.635.840,73 | 418.376.432,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | | | | | | |
|----------------|----------------|----------------|------|------|------|------|
| Renda Fixa | 352.414.005,54 | 346.159.328,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Renda Variável | 69.221.835,19 | 72.217.104,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | 421.635.840,73 | 418.376.432,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

| Nome | Enquadramento 3922 | Classificação CVM | Benchmark | Benchmark Anbima | Categoria Anbima | Classificação Anbima | Participação na Carteira | |
|--|--|-------------------|-----------|------------------|--------------------------|---|--------------------------|---------|
| | | | | | | | Saldo | Saldo % |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | Exterior | - | Global - BDRX | Ativos | Ações Livre | 8.779.569,02 | 2,10% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | Renda Fixa | - | IMA-GERAL ex-C | Duração Livre | Renda Fixa Duração Livre Soberano | 59.279.915,30 | 14,17% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | Renda Fixa | IPCA | Não definido | Duração Livre | Renda Fixa Duração Livre Soberano | 12.191.063,34 | 2,91% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | Renda Fixa | IMA-B 5+ | IMA-B 5+ | Indexados | Renda Fixa Indexados | 8.944.331,81 | 2,14% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | Renda Fixa | - | IDKa IPCA 5 Anos | Duração Livre | Renda Fixa Duração Livre Soberano | 6.657.361,20 | 1,59% |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | Renda Fixa | IPCA | Não definido | Duração Alta | Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento | 17.180.264,52 | 4,11% |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | Renda Fixa | IPCA | Não definido | Duração Livre | Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 8.022.801,51 | 1,92% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | Renda Fixa | - | Não se aplica | Duração Livre | Renda Fixa Duração Livre Soberano | 60.330.793,73 | 14,42% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | Renda Fixa | IMA-B 5+ | IMA-B 5+ | Indexados | Renda Fixa Indexados | 13.051.368,25 | 3,12% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | Renda Fixa | IMA-B | IMA-B | Indexados | Renda Fixa Indexados | 56.068.331,00 | 13,40% |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | Ações | - | Não se aplica | Ativos | Ações Setoriais | 17.825.673,59 | 4,26% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | Exterior | - | Não se aplica | Ativos | Ações Livre | 12.169.869,69 | 2,91% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | Exterior | - | Não se aplica | Investimento no Exterior | Multimercados Investimento no Exterior | 3.136.800,05 | 0,75% |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | Ações | - | SMLL | Ativos | Ações Small Caps | 18.466.316,07 | 4,41% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | Renda Fixa | - | Não definido | Duração Livre | Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre | 53.128.737,70 | 12,70% |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | Renda Fixa | - | Não se aplica | Duração Livre | Renda Fixa Duração Livre Soberano | 8.797.170,33 | 2,10% |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | Exterior | - | CDI | Investimento no Exterior | Multimercados Investimento no Exterior | 11.838.875,60 | 2,83% |
| NTN-B 760199 20240815 | Art. 7º, I, a | Renda Fixa | - | | | | 42.507.190,03 | 10,16% |
| Portfólio Carteira IPMU 2021 | | | | | | | 418.376.432,74 | 100,00% |

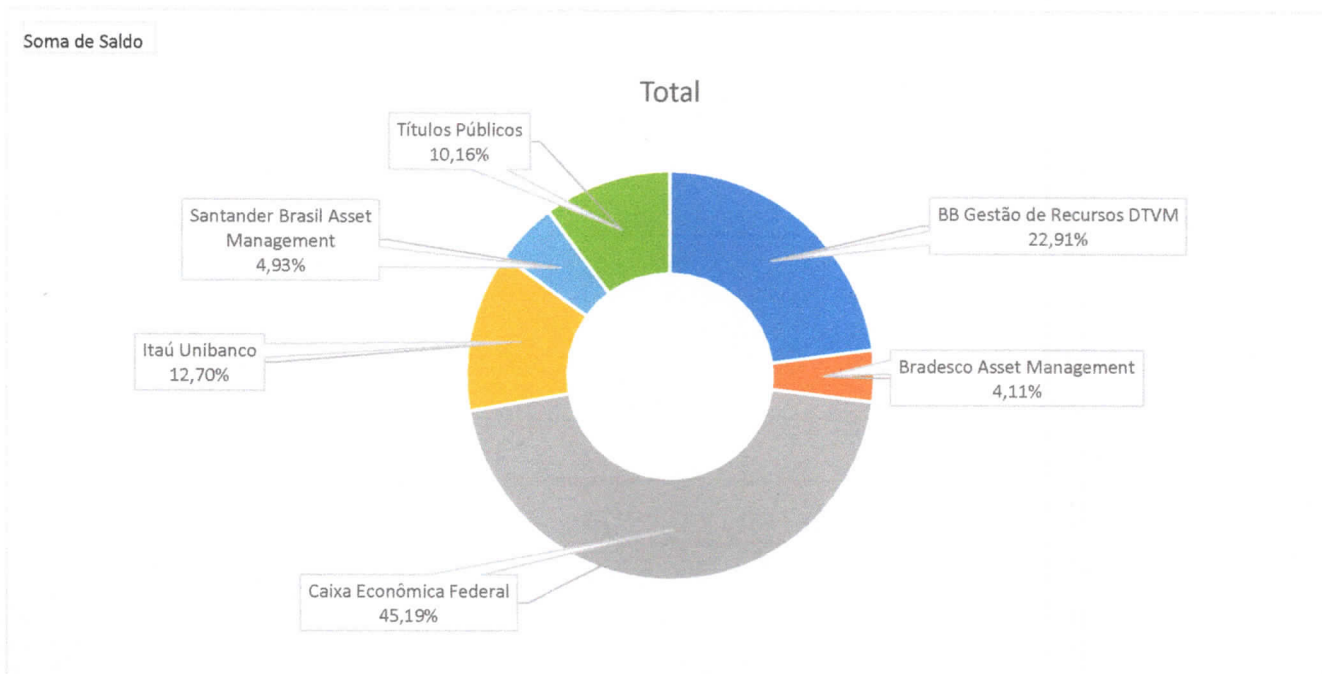


Retorno Carteira IPMU 31/8/2021

| Ativo | No ano | No mês | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | Saldo |
|--|---------|---------|----------|---------|----------|----------|----------|-----------------------|
| Ações | | | | | | | | 36.291.989,66 |
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | | | | | | | | 36.291.989,66 |
| - | -1,044% | -3,381% | -8,639% | 7,733% | 10,830% | 17,984% | 79,802% | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | -2,393% | -1,748% | -6,991% | 8,520% | 8,749% | 14,959% | 88,154% | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 0,304% | -5,014% | -10,287% | 6,945% | 12,912% | 21,008% | 71,450% | 18.466.316,07 |
| Renda Fixa | | | | | | | | 346.159.328,72 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | | | | | | | | 204.332.101,29 |
| IMA-B | -2,354% | -1,137% | -1,989% | 0,528% | 2,582% | 10,079% | 38,258% | 56.068.331,00 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -2,354% | -1,137% | -1,989% | 0,528% | 2,582% | 10,079% | 38,258% | 56.068.331,00 |
| IMA-B 5+ | -5,615% | -2,299% | -3,724% | -0,982% | 0,740% | 6,968% | 44,271% | 21.995.700,06 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -5,555% | -2,241% | -3,671% | -0,938% | 0,721% | 7,087% | 44,544% | 8.944.331,81 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -5,676% | -2,357% | -3,776% | -1,026% | 0,760% | 6,849% | 43,997% | 13.051.368,25 |
| - | 0,145% | -0,482% | -0,564% | 0,913% | 2,447% | 11,337% | 29,020% | 126.268.070,23 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,374% | -0,449% | -0,860% | 0,492% | 0,832% | 7,410% | 24,016% | 59.279.915,30 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3,321% | 0,452% | 1,464% | 3,087% | 6,575% | 16,925% | 35,842% | 6.657.361,20 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | -1,513% | -1,450% | -2,297% | -0,842% | -0,068% | 9,676% | 27,203% | 60.330.793,73 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | | | | | | | | 99.320.037,40 |
| IPCA | -1,250% | -0,787% | -1,163% | 0,226% | 0,495% | 6,802% | 22,671% | 37.394.129,37 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,956% | -0,455% | -0,815% | 0,857% | 1,573% | 6,802% | 22,671% | 12.191.063,34 |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | -1,496% | -0,504% | -0,711% | 0,500% | 0,292% | 6,802% | 22,671% | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | -1,297% | -1,402% | -1,962% | -0,679% | -0,382% | 8,022% | 21,170% | 8.022.801,51 |
| - | 1,400% | 0,267% | 0,712% | 1,354% | 1,717% | 7,777% | 21,170% | 61.925.908,03 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1,474% | 0,307% | 0,724% | 1,255% | 1,599% | 6,580% | 20,614% | 53.128.737,70 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 1,325% | 0,227% | 0,700% | 1,453% | 1,836% | 8,975% | 21,727% | 8.797.170,33 |
| Art. 7º, I, a | | | | | | | | 42.507.190,03 |
| - | 0,087% | -0,002% | -0,678% | 2,178% | 3,322% | 15,220% | 37,965% | 42.507.190,03 |
| NTN-B 760199 20240815 | 0,087% | -0,002% | -0,678% | 2,178% | 3,322% | 15,220% | 37,965% | 42.507.190,03 |
| Exterior | | | | | | | | 35.925.114,36 |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | | | | | | | | 20.949.438,71 |
| - | 17,031% | 2,718% | 9,136% | 6,784% | 17,328% | 90,531% | 91,272% | 20.949.438,71 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 17,048% | 3,000% | 8,753% | 7,245% | 16,742% | 86,530% | 81,272% | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17,015% | 2,435% | 9,520% | 6,323% | 17,915% | 94,532% | 101,271% | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | | | | | | | | 14.975.675,65 |
| - | 11,256% | 1,059% | 6,928% | -1,296% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 14.975.675,65 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 8,068% | 0,807% | 7,627% | -2,749% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 14,445% | 1,310% | 6,229% | 0,156% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 11.838.875,60 |
| Total Geral | | | | | | | | 418.376.432,74 |



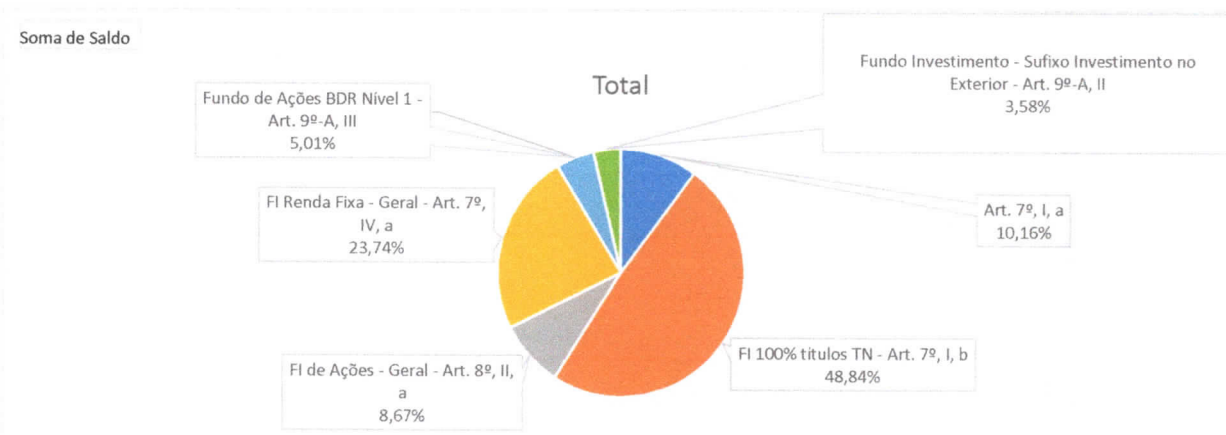
| | |
|--|-----------------------|
| BB Gestão de Recursos DTVM | 95.852.240,67 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 8.779.569,02 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 59.279.915,30 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 12.191.063,34 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.944.331,81 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 6.657.361,20 |
| Bradesco Asset Management | 17.180.264,52 |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 17.180.264,52 |
| Caixa Econômica Federal | 189.071.953,89 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 8.022.801,51 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 60.330.793,73 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 13.051.368,25 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 56.068.331,00 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 17.825.673,59 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 12.169.869,69 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 3.136.800,05 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 18.466.316,07 |
| Itaú Unibanco | 53.128.737,70 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 53.128.737,70 |
| Santander Brasil Asset Management | 20.636.045,93 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 8.797.170,33 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 11.838.875,60 |
| Títulos Públicos | 42.507.190,03 |
| NTN-B 760199 20240815 | 42.507.190,03 |
| Total Geral | 418.376.432,74 |
| BB Gestão de Recursos DTVM | 95.852.240,67 |
| Bradesco Asset Management | 17.180.264,52 |
| Caixa Econômica Federal | 189.071.953,89 |
| Itaú Unibanco | 53.128.737,70 |
| Santander Brasil Asset Management | 20.636.045,93 |
| Títulos Públicos | 42.507.190,03 |
| Total Geral | 418.376.432,74 |





| Rótulos de Linha | Soma de Saldo |
|--|-----------------------|
| Art. 7º, I, a | 42.507.190,03 |
| NTN-B 760199 20240815 | 42.507.190,03 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | 204.332.101,29 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 59.279.915,30 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 8.944.331,81 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 6.657.361,20 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 60.330.793,73 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 13.051.368,25 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 56.068.331,00 |
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 18.466.316,07 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | 99.320.037,40 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 12.191.063,34 |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 8.022.801,51 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 53.128.737,70 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 8.797.170,33 |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | 20.949.438,71 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | 14.975.675,65 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 11.838.875,60 |
| Total Geral | 418.376.432,74 |

| Rótulos de Linha | Soma de Saldo |
|--|-----------------------|
| Art. 7º, I, a | 42.507.190,03 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | 204.332.101,29 |
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | 36.291.989,66 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | 99.320.037,40 |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | 20.949.438,71 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | 14.975.675,65 |
| Total Geral | 418.376.432,74 |





Retorno Carteira IPMU 31/8/2021

| Ativo | No ano | No mês | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses | Saldo |
|--|---------|---------|----------|---------|----------|----------|----------|-----------------------|
| Ações | | | | | | | | 36.291.989,66 |
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | | | | | | | | 36.291.989,66 |
| - | | | | | | | | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | -1,044% | -3,381% | -8,639% | 7,733% | 10,830% | 17,984% | 79,802% | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | -2,393% | -1,748% | -6,991% | 8,520% | 8,749% | 14,959% | 88,154% | 18.466.316,07 |
| | 0,304% | -5,014% | -10,287% | 6,945% | 12,912% | 21,008% | 71,450% | |
| Renda Fixa | | | | | | | | 346.159.328,72 |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | | | | | | | | 204.332.101,29 |
| IMA-B | -2,354% | -1,137% | -1,989% | 0,528% | 2,582% | 10,079% | 38,258% | 56.068.331,00 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -2,354% | -1,137% | -1,989% | 0,528% | 2,582% | 10,079% | 38,258% | 56.068.331,00 |
| IMA-B 5+ | -5,615% | -2,299% | -3,724% | -0,982% | 0,740% | 6,968% | 44,271% | 21.995.700,06 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -5,555% | -2,241% | -3,671% | -0,938% | 0,721% | 7,087% | 44,544% | 8.944.331,81 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -5,676% | -2,357% | -3,776% | -1,026% | 0,760% | 6,849% | 43,997% | 13.051.368,25 |
| - | 0,145% | -0,482% | -0,564% | 0,913% | 2,447% | 11,337% | 29,020% | 126.268.070,23 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,374% | -0,449% | -0,860% | 0,492% | 0,832% | 7,410% | 24,016% | 59.279.915,30 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3,321% | 0,452% | 1,464% | 3,087% | 6,575% | 16,925% | 35,842% | 6.657.361,20 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | -1,513% | -1,450% | -2,297% | -0,842% | -0,068% | 9,676% | 27,203% | 60.330.793,73 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | | | | | | | | 99.320.037,40 |
| IPCA | -1,250% | -0,787% | -1,163% | 0,226% | 0,495% | 6,802% | 22,671% | 37.394.129,37 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,956% | -0,455% | -0,815% | 0,857% | 1,573% | 6,802% | 22,671% | 12.191.063,34 |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | -1,496% | -0,504% | -0,711% | 0,500% | 0,292% | 6,802% | 22,671% | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | -1,297% | -1,402% | -1,962% | -0,679% | -0,382% | | | 8.022.801,51 |
| - | 1,400% | 0,267% | 0,712% | 1,354% | 1,717% | 7,777% | 21,170% | 61.925.908,03 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1,474% | 0,307% | 0,724% | 1,255% | 1,599% | 6,580% | 20,614% | 53.128.737,70 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 1,325% | 0,227% | 0,700% | 1,453% | 1,836% | 8,975% | 21,727% | 8.797.170,33 |
| Art. 7º, I, a | | | | | | | | 42.507.190,03 |
| - | 0,087% | -0,002% | -0,678% | 2,178% | 3,322% | 15,220% | 37,965% | 42.507.190,03 |
| NTN-B 760199 20240815 | 0,087% | -0,002% | -0,678% | 2,178% | 3,322% | 15,220% | 37,965% | 42.507.190,03 |
| Exterior | | | | | | | | 35.925.114,36 |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | | | | | | | | 20.949.438,71 |
| - | 17,031% | 2,718% | 9,136% | 6,784% | 17,328% | 90,531% | 91,272% | 20.949.438,71 |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 17,048% | 3,000% | 8,753% | 7,245% | 16,742% | 86,530% | 81,272% | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 17,015% | 2,435% | 9,520% | 6,323% | 17,915% | 94,532% | 101,271% | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | | | | | | | | 14.975.675,65 |
| - | 11,256% | 1,059% | 6,928% | -1,296% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 14.975.675,65 |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 8,068% | 0,807% | 7,627% | -2,749% | | | | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 14,445% | 1,310% | 6,229% | 0,156% | 21,011% | 97,205% | 93,621% | 11.838.875,60 |
| Total Geral | | | | | | | | 418.376.432,74 |



Liquidez - Carteira IPMU 31/8/2021

| Ações | Ativo | Liquidez - Dias | Patrimônio do fundo | Cota Fundo | Saldo |
|---|--|-----------------|---------------------|--------------|---------------|
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | | | | | |
| - | CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | 3 | 437.227.724,66 | 1,925869 | 17.825.673,59 |
| - | CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 3 | 1.120.309.778,71 | 1,950734 | 18.466.316,07 |
| Renda Fixa | | | | | |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | | | | | |
| IMA-B | | | | | |
| - | CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0 | 5.489.990.227,20 | 3,607103 | 56.068.331,00 |
| - | IMA-B 5+ | 2 | 1.244.889.378,72 | 3,372165 | 21.995.700,06 |
| - | BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | | | | |
| - | CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0 | 1.380.467.864,45 | 2,652206 | 13.051.368,25 |
| - | BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3 | 8.803.716.462,71 | 1,506864 | 59.279.915,30 |
| - | BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0 | 199.736.376,24 | 1,788209 | 6.657.361,20 |
| - | CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0 | 15.341.053.159,31 | 1,491462 | 60.330.793,73 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | | | | | |
| IPCA | | | | | |
| - | BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3 | 4.477.081.866,50 | 1,056326 | 12.191.063,34 |
| - | BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 4 | 1.351.295.808,04 | 1,269472 | 17.180.264,52 |
| - | CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | 1 | 1.044.425.824,76 | 1,022,613854 | 8.022.801,51 |
| - | ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1 | 2.055.576.731,45 | 18,291885 | 61.925.908,03 |
| - | SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 1 | 3.275.640.848,90 | 18,291885 | 53.128.737,70 |
| - | SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | 1 | 835.512.614,00 | 12,985658 | 8.797.170,33 |
| Art. 7º, I, a | | | | | |
| - | NTN-B 760199 20240815 | 0 | | | 42.507.190,03 |
| Exterior | | | | | |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | | | | | |
| - | BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 4 | 1.101.736.947,31 | 2,476543 | 8.779.569,02 |
| - | CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 3 | 3.230.077.335,87 | 6,142048 | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | | | | | |
| - | CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 12 | 195.497.444,79 | 1.104,327035 | 3.136.800,05 |
| - | SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 8 | 1.973.726.587,17 | 47,858484 | 11.838.875,60 |

**Sharpe - Carteira IPMU 31/8/2021**

| Ativo | Sharpe - Selic - Ano | Sharpe - Selic - Mês | Saldo |
|--|-----------------------------|-----------------------------|----------------|
| Ações | | | |
| FI de Ações - Geral - Art. 8º, II, a | | | |
| - | -0,0176 | -1,1177 | 36.291.989,66 |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES | -0,2054 | -1,1177 | 17.825.673,59 |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | -0,0176 | -2,6331 | 18.466.316,07 |
| Renda Fixa | | | |
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, b | | | |
| IMA-B | -1,1806 | -2,4479 | 56.068.331,00 |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,1806 | -2,4479 | 56.068.331,00 |
| IMA-B 5+ | -1,3430 | -2,5562 | 21.995.700,06 |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,3430 | -2,5562 | 8.944.331,81 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,3608 | -2,6647 | 13.051.368,25 |
| - | 1,1592 | 0,5235 | 126.268.070,23 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,8542 | -3,3538 | 59.279.915,30 |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,1592 | 0,5235 | 6.657.361,20 |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | -1,9739 | -5,4226 | 60.330.793,73 |
| FI Renda Fixa - Geral - Art. 7º, IV, a | | | |
| IPCA | -1,4803 | -3,1345 | 37.394.129,37 |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,4803 | -3,4939 | 12.191.063,34 |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | -1,8807 | -3,1345 | 17.180.264,52 |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP | -2,0160 | -6,5375 | 8.022.801,51 |
| - | -1,2659 | -0,6834 | 61.925.908,03 |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | -1,2659 | -0,6834 | 53.128.737,70 |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA | -1,9298 | -2,7052 | 8.797.170,33 |
| Art. 7º, I, a | | | |
| - | | | |
| NTN-B 760199 20240815 | -0,7136 | -1,3265 | 42.507.190,03 |
| Exterior | | | |
| Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º-A, III | | | |
| - | | | |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 1,2578 | 2,0877 | 8.779.569,02 |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1,2578 | 1,8163 | 12.169.869,69 |
| Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior - Art. 9º-A, II | | | |
| - | | | |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 0,5650 | 0,4937 | 3.136.800,05 |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO | 1,1232 | 0,8867 | 11.838.875,60 |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 408 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tel: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

VaR 95,0% MV 21 du - Mensal

| Carteira IPMU | | | | |
|---------------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| Janeiro | 390.732.768,80 | 29.341.621,30 | - | 420.074.390,10 |
| Fevereiro | 385.361.373,33 | 31.836.152,84 | - | 417.197.526,17 |
| Março | 382.778.665,50 | 32.169.880,53 | 3.613.477,13 | 418.562.023,16 |
| Abril | 357.446.973,83 | 33.173.922,51 | 30.700.309,53 | 421.321.205,87 |
| Maio | 356.813.530,93 | 36.691.643,99 | 30.583.527,47 | 424.088.702,39 |
| Junho | 356.056.455,48 | 36.918.904,71 | 29.965.077,90 | 422.940.438,09 |
| Julho | 352.414.005,54 | 37.583.864,18 | 31.637.971,01 | 421.635.840,73 |
| Agosto | 346.159.328,72 | 35.925.114,36 | 36.291.989,66 | 418.376.432,74 |
| Setembro | - | - | - | - |
| Outubro | - | - | - | - |
| Novembro | - | - | - | - |
| Dezembro | - | - | - | - |

| VaR - % | | | | |
|-----------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| | 5,00% | 20,00% | | |
| Janeiro | 1,263% | 11,585% | | 1,685% |
| Fevereiro | 1,125% | 12,218% | | 1,778% |
| Março | 1,650% | 14,135% | 10,757% | 2,284% |
| Abril | 1,417% | 5,163% | 8,545% | 1,244% |
| Maio | 1,234% | 8,409% | 5,582% | 1,581% |
| Junho | 1,294% | 6,009% | 4,935% | 1,278% |
| Julho | 1,340% | 8,773% | 7,213% | 1,642% |
| Agosto | 1,884% | 10,173% | 5,958% | 1,935% |
| Setembro | - | - | - | - |
| Outubro | - | - | - | - |
| Novembro | - | - | - | - |
| Dezembro | - | - | - | - |

| VaR - R\$ | | | | |
|-----------|---------------------------|-------------------------------|-------------------------|------------------------------|
| | Portfólio Renda Fixa 2021 | Portfólio Renda Variável 2021 | Portfólio Exterior 2021 | Portfólio Carteira IPMU 2021 |
| Janeiro | 4.933.366,25 | 3.399.365,74 | - | 7.077.447,66 |
| Fevereiro | 4.335.023,00 | 3.889.668,02 | - | 7.417.711,99 |
| Março | 6.317.220,22 | 4.547.346,60 | 388.693,83 | 9.558.906,25 |
| Abril | 5.066.803,10 | 1.712.721,20 | 2.623.423,74 | 5.242.769,76 |
| Maio | 4.403.836,45 | 3.085.375,08 | 1.707.311,56 | 6.703.777,09 |
| Junho | 4.606.562,76 | 2.218.605,21 | 1.478.699,64 | 5.405.875,15 |
| Julho | 4.721.215,76 | 3.297.120,56 | 2.282.081,76 | 6.924.323,13 |
| Agosto | 6.521.432,27 | 3.654.497,65 | 2.162.108,99 | 8.096.742,11 |
| Setembro | - | - | - | - |
| Outubro | - | - | - | - |
| Novembro | - | - | - | - |
| Dezembro | - | - | - | - |



Extrato de Operações de Renda Fixa

| | | | | |
|------------------|---|--------------|-------------|-------------|
| Data de Emissão: | 08/09/2021 | Agência | UBATUBA, SP | |
| Data Anterior: | 31/07/2021 | | | |
| Data da Posição: | 31/08/2021 | | | |
| Cliente: | INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UBATUBA | | | |
| CNPJ: | 04.921.738/0001-42 | Cód. Agência | Cód. Oper | C. Corrente |
| | | 798 | 006 | 20-4 |

Operação

| # | Título | Cód Título | Data de Vencto. | Tipo de Operação | Data da Oper | Quantidade | Valor da Oper R\$ | Código ISIN |
|---|--------|------------|-----------------|------------------|--------------|------------|-------------------|--------------|
| 1 | NTN-B | 760199 | 15/08/24 | TRANSF. CUSTÓDIA | 01/07/05 | 11.150 | 4.672.375,71 | BRSTNCNTB096 |

NTN-B (#1)

| Data | Histórico | Quantidade | Valor R\$ | Rendimento no Período R\$ |
|----------|--------------------|------------|---------------|---------------------------|
| 31/07/21 | POSIÇÃO FINAL | 11.150 | 40.387.496,09 | |
| | PAGAMENTO DE JUROS | - | 1.189.259,70 | |
| 31/08/21 | POSIÇÃO FINAL | 11.150 | 39.758.127,71 | 559.891,32 |

| Data | Histórico | Quantidade | Valor R\$ | PU |
|----------|-----------|------------|---------------|--------------|
| 31/08/21 | PU ANDIMA | 11.150 | 42.507.190,03 | 3.812,304039 |

Pagamento de Juros - Extrato de Operação Compromissada

| Data | Valor Compromissada | Saldo em Conta | Total | Rendimento |
|----------|---------------------|----------------|--------------|------------|
| 16/08/21 | | | 1.189.259,70 | |

SALDO em Compromissada

| | |
|-----------------------------|---------------|
| SALDO TOTAL (Sem provisões) | 39.758.127,71 |
|-----------------------------|---------------|

SALDO EM CONTA

PROVISÕES (Débitos)

| | |
|-----------------------|---------|
| Taxa de Administração | -650,00 |
| Custo SELIC | -128,02 |

| | |
|--------------------|---------------|
| PATRIMONIO LÍQUIDO | 39.757.349,69 |
|--------------------|---------------|

Rentabilidade

| # | | No Mês | % do CDI |
|---|-------|--------|----------|
| | CDI | 0,408% | |
| 1 | NTN-B | 1,386% | 339,8% |



Extrato de Operações de Renda Fixa

| | | | | |
|------------------|---|--------------|-------------|-------------|
| Data de Emissão: | 08/09/2021 | Agência | UBATUBA, SP | |
| Data Anterior: | 31/07/2021 | Cód. Agência | 798 | C. Corrente |
| Data da Posição: | 31/08/2021 | Cód. Oper | 006 | 20-4 |
| Cliente: | INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UBATUBA | | | |
| CNPJ: | 04.921.738/0001-42 | | | |

Operação

| # | Título | Cód Titulo | Data de Vencdo. | Tipo de Operação | Data da Oper | Quantidade | Valor da Oper R\$ | Código ISIN |
|---|--------|------------|-----------------|------------------|--------------|------------|-------------------|--------------|
| 1 | NTN-B | 760199 | 15/08/24 | TRANSF. CUSTODIA | 01/07/05 | 11.150 | 4.672.375,71 | BRSTNCNTB096 |

NTN-B (#1)

| Data | Histórico | Quantidade | Valor R\$ | Rendimento no Período R\$ |
|----------|--------------------|------------|---------------|---------------------------|
| 31/07/21 | POSIÇÃO FINAL | 11.150 | 40.387.496,09 | |
| | PAGAMENTO DE JUROS | - | 1.189.259,70 | |
| 31/08/21 | POSIÇÃO FINAL | 11.150 | 39.758.127,71 | 559.891,32 |
| Data | Histórico | Quantidade | Valor R\$ | PU |
| 31/08/21 | PU ANDIMA | 11.150 | 42.507.190,03 | 3.812,304039 |

Pagamento de Juros - Extrato de Operação Compromissada

| Data | Valor Compromissada | Saldo em Conta | Total | Rendimento |
|----------|---------------------|----------------|--------------|------------|
| 16/08/21 | | | 1.189.259,70 | |

SALDO em Compromissada

| | |
|------------------------------------|---------------|
| SALDO TOTAL (Sem provisões) | 39.758.127,71 |
|------------------------------------|---------------|

SALDO EM CONTA

PROVISÕES (Débitos)

| | |
|-----------------------|---------|
| Taxa de Administração | -650,00 |
| Custo SELIC | -128,02 |

| | |
|---------------------------|---------------|
| PATRIMONIO LÍQUIDO | 39.757.349,69 |
|---------------------------|---------------|

Rentabilidade

| # | | No Mês | % do CDI |
|---|-------|--------|----------|
| | CDI | 0,408% | |
| 1 | NTN-B | 1,386% | 339,8% |



Instituto de Previdência Municipal de Ubatuba – IPMU

Prefeitura Municipal da Estância Balneária de Ubatuba

Rua Paraná, 406 – Centro – Ubatuba – São Paulo – Cep. 11.680-000

Tele: (12) 3833-3044 - www.ipmu.com.br

| | 31/12/2019 | 31/12/2020 | Jan/2021 | Fev/2021 | mar/2021 | abr/2021 | maio/2021 | junho/2021 |
|---------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| Artigo 7º I A | 62.877.843,20 | 67.704.345,18 | 68.437.663,50 | 67.262.310,24 | 67.942.474,78 | 43.671.581,40 | 43.912.064,12 | 43.777.017,69 |
| Artigo 7º I b | 246.181.192,14 | 208.876.680,80 | 207.683.254,41 | 205.241.026,93 | 204.668.144,87 | 205.921.416,90 | 207.294.397,82 | 207.783.560,47 |
| Artigo 7º IV | 92.509.807,22 | 117.515.392,17 | 114.611.850,89 | 112.858.036,16 | 110.168.045,85 | 107.853.975,53 | 105.607.789,99 | 104.495.877,32 |
| Artigo 8º II | 0,00 | 30.499.354,88 | 29.341.621,30 | 30.509.320,53 | 32.169.880,53 | 33.173.922,51 | 36.691.643,99 | 36.918.904,71 |
| Artigo 9º II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 2.048.115,41 | 12.714.482,30 | 13.189.764,12 | 12.870.622,55 |
| Artigo 9º III | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 1.326.832,31 | 1.565.361,72 | 17.985.827,23 | 17.393.763,35 | 17.094.455,35 |
| | 401.568.842,56 | 424.595.773,03 | 420.074.390,10 | 417.197.526,17 | 418.562.023,16 | 421.321.205,87 | 424.089.423,39 | 422.940.438,09 |

| | | | | | | | | |
|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| Renda Fixa | 401.568.842,56 | 394.096.418,15 | 390.732.768,80 | 385.361.373,33 | 382.778.665,50 | 357.446.973,83 | 356.814.251,93 | 356.056.455,48 |
| Renda Variável | 0,00 | 30.499.354,88 | 29.341.621,30 | 31.836.152,84 | 35.783.357,66 | 63.874.232,04 | 67.275.171,46 | 66.883.982,61 |
| | 401.568.842,56 | 424.595.773,03 | 420.074.390,10 | 417.197.526,17 | 418.562.023,16 | 421.321.205,87 | 424.089.423,39 | 422.940.438,09 |

| | julho/2021 | agosto/2021 | setembro/2021 | outubro/2021 | novembro/2021 | dezembro/2021 |
|---------------|----------------|----------------|---------------|--------------|---------------|---------------|
| Artigo 7º I A | 43.705.295,69 | 42.507.190,03 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 7º I b | 206.798.762,57 | 204.332.101,29 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 7º IV | 101.909.947,28 | 99.320.037,40 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 8º II | 37.583.864,18 | 36.291.989,66 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 9º II | 13.631.038,65 | 14.975.575,65 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Artigo 9º III | 18.006.932,36 | 20.949.438,71 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | 421.635.840,73 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |

| | | | | | | |
|----------------|----------------|----------------|------|------|------|------|
| Renda Fixa | 352.414.005,54 | 346.159.328,72 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Renda Variável | 69.221.835,19 | 72.217.004,02 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| | 421.635.840,73 | 418.376.332,74 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |



Rentabilidade 2021

| Agosto | Saldo | % PL IPMU | Mês | Meta Atuarial | Ano | Meta Atuarial |
|--------------------------------------|---------------|-----------|----------|---------------|----------|---------------|
| | | | | 1,3500% | | 9,7000% |
| Caixa Gestão Estratégica | 60.330.793,73 | 14,420% | -1,4500% | -107,41% | -1,5130% | -15,60% |
| BB RF Alocação Ativa | 59.279.915,30 | 14,169% | -0,4490% | -33,26% | -1,3740% | -14,16% |
| Caixa Brasil IMA-B | 56.068.331,00 | 13,401% | -1,1370% | -84,22% | -2,3540% | -24,27% |
| Itaú Institucional Alocação Dinâmica | 53.128.737,70 | 12,699% | 0,3100% | -0,93% | 1,4700% | -10,38% |
| Títulos Públicos 2024 | 42.507.190,03 | 10,160% | -0,8500% | -62,96% | -1,7600% | -18,14% |
| Caixa FI Ações Small Caps | 18.466.316,07 | 4,414% | -5,0140% | -371,41% | 0,3040% | 3,13% |
| Caixa FI Ações Infraestrutura | 17.825.673,59 | 4,261% | -1,7480% | -129,48% | -2,3930% | -24,67% |
| Bradesco Alocação Dinâmica | 17.180.264,52 | 4,106% | -0,5000% | -37,04% | -1,5000% | -15,46% |
| Caixa Brasil IMA-B 5+ | 13.051.368,25 | 3,120% | -2,3570% | -174,59% | -5,6760% | -58,52% |
| BB Alocação Retorno Total | 12.191.063,34 | 2,914% | -0,4550% | -33,70% | -0,9560% | -9,86% |
| Caixa Ações BDR Nível I | 12.169.869,69 | 2,909% | 2,4400% | 180,74% | 17,0100% | 175,36% |
| Santander Global Equities IE | 11.838.875,60 | 2,830% | 1,6700% | 123,70% | 14,8500% | 153,09% |
| BB IMA-B 5+ | 8.944.331,81 | 2,138% | -2,4100% | -178,52% | -5,5550% | -57,27% |
| BB Ações ESG Globais | 8.779.569,02 | 2,098% | 3,0000% | 222,22% | 17,0480% | 175,75% |
| Caixa Brasil RF Ativo | 8.022.801,51 | 1,918% | -1,4020% | -103,85% | -1,2970% | -13,37% |
| Santander Ativo Renda Fixa (150) | 6.915.005,43 | 1,653% | 0,2300% | 17,04% | 1,3200% | 13,61% |
| BB Previdenciário RF TP 2022 | 6.657.361,20 | 1,591% | 0,4520% | 33,48% | 3,3210% | 34,24% |
| Caixa Multigestor Equities IE | 3.136.800,05 | 0,750% | 0,8070% | 59,78% | 8,0680% | 83,18% |
| Santander Ativo Renda Fixa (350) | 1.882.164,90 | 0,450% | 0,2300% | 17,04% | 1,3200% | 13,61% |

Patrimônio

418.376.432,74

-0,720%

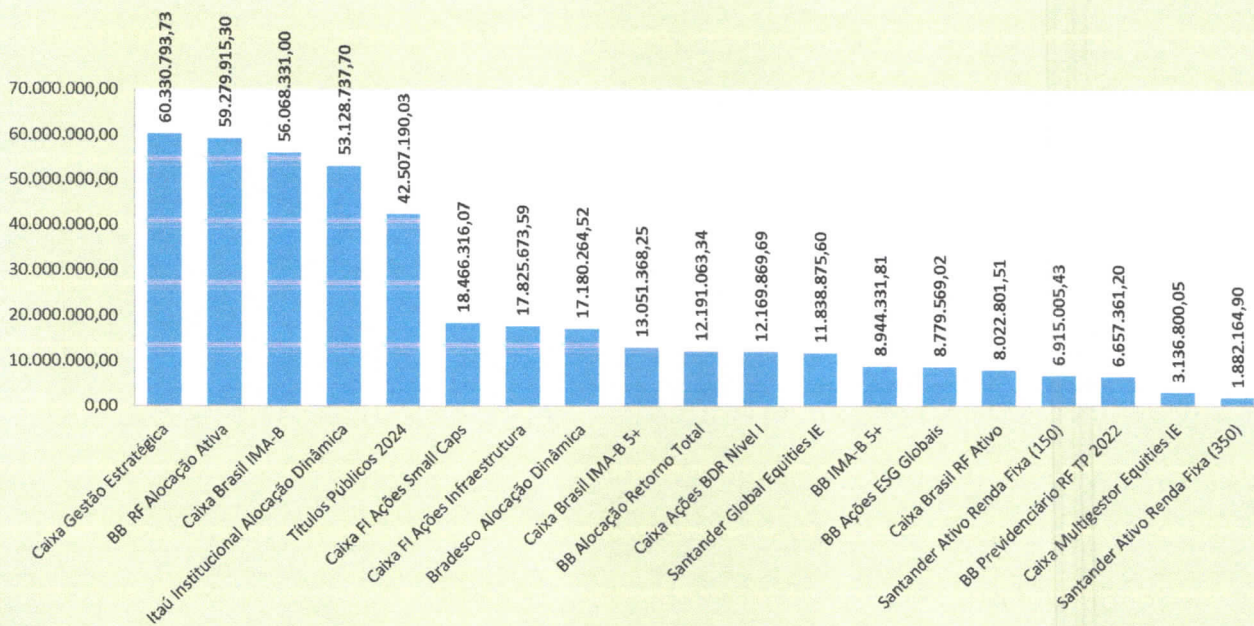
-53,33%

-0,480%

-4,95%

Carteira de Investimentos

1/2

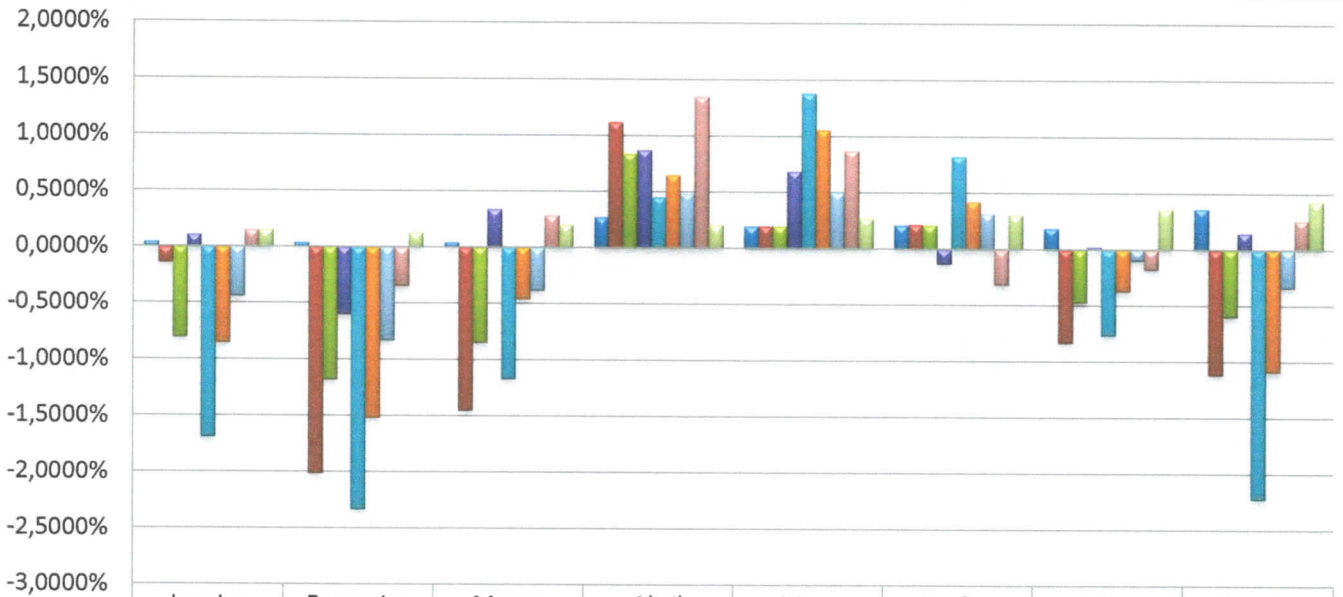


Carteira de Investimentos

2/2

Indicadores Econômicos

| Benchmark | Set/20 | Out/20 | Nov/20 | Dez/20 | Jan/21 | Fev/21 | Mar/21 | Abr/21 | Mai/21 | Jun/21 | Jul/21 | Ago/21 | 12 Meses | Acumulado 2021 |
|-----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|----------------|
| IMA-B | -1,51% | 0,21% | 2,00% | 4,85% | -0,85% | -1,52% | -0,46% | 0,65% | 1,06% | 0,42% | -0,37% | -1,09% | 3,27% | -2,17% |
| IMA-B5 | -0,12% | 0,20% | 1,32% | 1,83% | 0,11% | -0,60% | 0,34% | 0,87% | 0,69% | -0,13% | 0,03% | 0,15% | 4,77% | 1,47% |
| IMA-B5+ | -2,60% | 0,22% | 2,59% | 7,51% | -1,69% | -2,33% | -1,17% | 0,45% | 1,38% | 0,83% | -0,76% | -2,22% | 1,80% | -5,44% |
| IRF-M | -0,56% | -0,33% | 0,36% | 1,95% | -0,80% | -1,18% | -0,84% | 0,84% | 0,20% | 0,21% | -0,47% | -0,60% | -1,25% | -2,63% |
| IRF-M1 | 0,15% | 0,16% | 0,23% | 0,31% | 0,04% | 0,04% | 0,04% | 0,27% | 0,20% | 0,21% | 0,19% | 0,37% | 2,24% | 1,37% |
| IRF-M1+ | -0,91% | -0,61% | 0,46% | 3,05% | -1,39% | -2,01% | -1,45% | 1,12% | 0,20% | 0,22% | -0,83% | -1,11% | -3,32% | -5,18% |
| IMA-GERAL | -0,60% | 0,09% | 0,73% | 2,02% | -0,24% | -0,69% | -0,39% | 0,51% | 0,61% | 0,35% | -0,10% | -0,41% | 1,87% | -0,37% |
| CDI | 0,15% | 0,16% | 0,14% | 0,16% | 0,14% | 0,11% | 0,19% | 0,19% | 0,22% | 0,13% | 0,36% | 0,25% | 2,20% | 1,59% |
| IBOVESPA | -4,80% | -0,69% | 15,90% | 9,30% | -3,30% | -4,37% | 6,00% | 1,94% | 6,16% | 0,46% | -3,94% | -2,48% | 19,54% | -0,20% |
| IPCA | 0,64% | 0,86% | 0,89% | 1,35% | 0,25% | 0,86% | 0,93% | 0,31% | 0,83% | 0,53% | 0,96% | 0,87% | 9,68% | 5,67% |
| INPC | 0,87% | 0,89% | 0,95% | 1,46% | 0,27% | 0,82% | 0,86% | 0,38% | 0,96% | 0,60% | 1,02% | 0,88% | 10,42% | 5,94% |
| SELIC | 0,15% | 0,16% | 0,14% | 0,16% | 0,15% | 0,13% | 0,19% | 0,20% | 0,26% | 0,29% | 0,36% | 0,43% | 2,64% | 2,02% |



| | Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Mai | Junho | Julho | Agosto |
|-------------|----------|-----------|----------|---------|---------|----------|----------|----------|
| IRFM1 | 0,0435% | 0,0394% | 0,0443% | 0,2746% | 0,1965% | 0,2119% | 0,1891% | 0,3653% |
| IRFM 1+ | -0,1390% | -2,0109% | -1,4494% | 1,1235% | 0,1997% | 0,2151% | -0,8320% | -1,1141% |
| IRFM Total | -0,8026% | -1,1789% | -0,8430% | 0,8409% | 0,1993% | 0,2143% | -0,4740% | -0,5965% |
| IMA-B 5 | 0,1059% | -0,5967% | 0,3431% | 0,8743% | 0,6901% | -0,1303% | 0,0285% | 0,1512% |
| IMA-B 5+ | -1,6874% | -2,3277% | -1,1696% | 0,4531% | 1,3829% | 0,8287% | -0,7632% | -2,2197% |
| IMA-B Total | -0,8514% | -1,5168% | -0,4610% | 0,6511% | 1,0580% | 0,4203% | -0,3734% | -1,0896% |
| IMA-Geral | -0,4386% | -0,8252% | -0,3817% | 0,4892% | 0,5018% | 0,3193% | -0,0992% | -0,3401% |
| IDKA 2 | 0,1500% | -0,3447% | 0,2881% | 1,3491% | 0,8751% | -0,3166% | -0,1782% | 0,2640% |
| CDI | 0,1500% | 0,1300% | 0,2011% | 0,2078% | 0,2703% | 0,3078% | 0,3600% | 0,4300% |

REFERENTE A TERÇA-FEIRA - 31 DE AGOSTO 2021 - Nº 165

FECHAMENTO DO IBOVESPA: 118.781

-0,80%

DERIVATIVOS

CONTRATOS COM MINIS 40.602.533
CONTRATOS SEM MINIS 20.467.405

AÇÕES

VOLUME NEGOCIADO 38.570.826.246,33
QUANTIDADE DE NEGÓCIOS 4.320.259

DERIVATIVOS – MÉDIAS DIÁRIAS DE CONTRATOS NEGOCIADOS

| | TOTAL COM MINIS | TOTAL SEM MINIS |
|--------------------|-----------------|-----------------|
| DIA | 40.602.533 | 20.467.405 |
| MÃSS | 51.680.451 | 27.651.580 |
| MÃSS ANTERIOR | 51.264.739 | 28.634.682 |
| TRIMESTRE | 51.472.595 | 28.143.131 |
| TRIMESTRE ANTERIOR | 46.162.098 | 26.149.055 |
| SEMESTRE | 51.472.595 | 28.143.131 |
| SEMESTRE ANTERIOR | 51.699.045 | 30.894.413 |
| ANO | 51.641.052 | 30.189.817 |
| ANO ANTERIOR | 39.522.808 | 24.972.665 |

AÇÕES – MÉDIAS DIÁRIAS DE NEGOCIAÇÃO

| | VOLUME R\$ MILHÕES | NÚMERO DE NEGÓCIOS |
|--------------------|--------------------|--------------------|
| DIA | 38.570,82 | 4.320.259 |
| MES | 32.959,87 | 4.101.880 |
| MES ANTERIOR | 28.200,10 | 3.458.167 |
| TRIMESTRE | 30.635,33 | 3.787.509 |
| TRIMESTRE ANTERIOR | 33.594,94 | 3.841.743 |
| SEMESTRE | 30.635,33 | 3.787.509 |
| SEMESTRE ANTERIOR | 35.386,55 | 3.979.994 |
| ANO | 34.148,35 | 3.929.831 |
| ANO ANTERIOR | 29.716,83 | 3.572.869 |

SUMÁRIO

Evolução do Ibovespa.....2
Derivativos – Resumo das Operações.....3
Ações – Resumo das Operações.....5

INDICADORES E INFORMATIVOS

Indicadores econômicos.....6
Informações agropecuárias.....8
Evolução dos Índices.....11
Ações – Maiores Oscilações e Mais Negociadas.....15
Participação dos Investidores Informativos.....16

COTAÇÕES

Derivativos – Resumo Estatístico AI
A vista, termo e opções.....B1
After Market.....C1

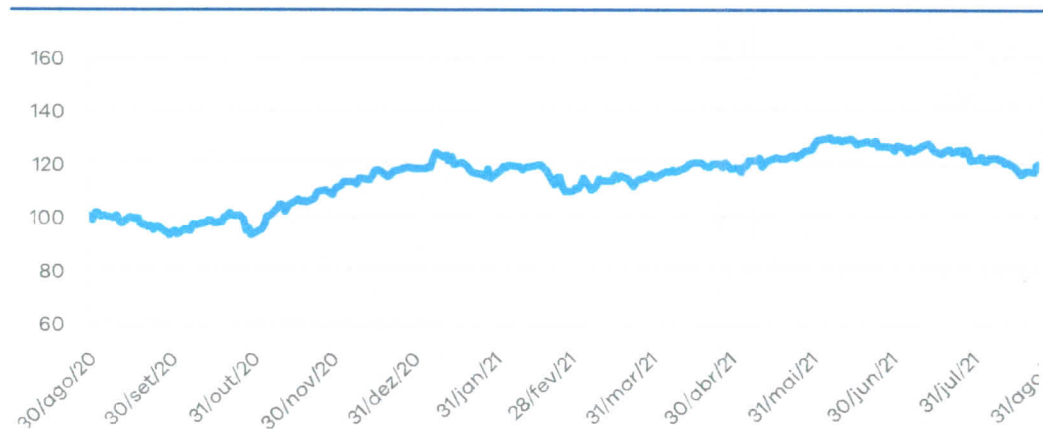
RENDA FIXA

Renda Fixa Privada.....D1
Tesouro Direto.....D3

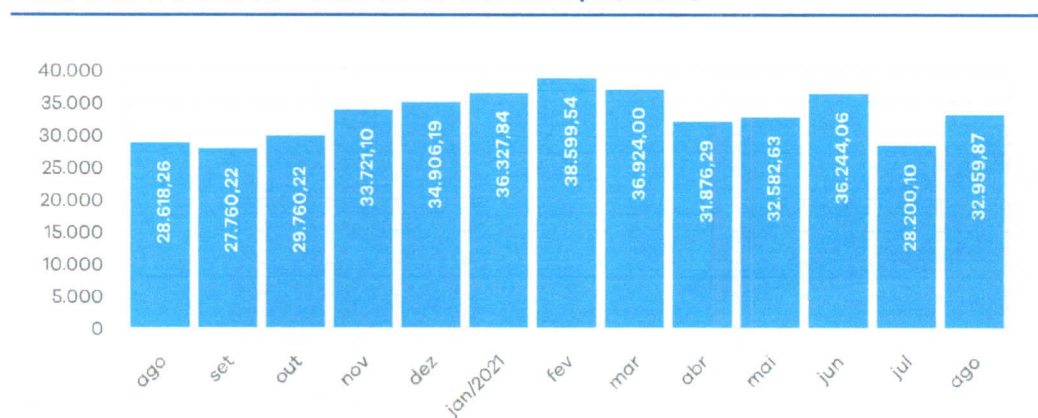
CLEARING

Câmbio.....D5
Quadro analítico das posições em aberto.....D7
Custódia.....D10
Banco de Títulos.....D13

IBOVESPA – EM UM ANO



MÉDIAS DIÁRIAS – VOLUME EM UM ANO R\$ MILHÕES



Evolução dos Índices

IFIX L B3

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 1.216 |
| MÍNIMO | 1.216 |
| MÁXIMO | 1.221 |
| FECHAMENTO | 1.220 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 1.220 |
| MÉDIA PONDERADA | 1.220 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 39 |
| BAIXAS | 18 |
| ESTÁVEIS | 1 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 58 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 1.288 - 05 FEV |
| MÍNIMO NO ANO | 1.193 - 19 AGO |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | +0,34% |
| ONTEM | +0,44% |
| NA SEMANA | +0,78% |
| EM UMA SEMANA | +1,12% |
| NO MÊS | -2,57% |
| EM UM MÊS | -2,57% |
| NO ANO | -4,63% |
| EM UM ANO | -1,62% |

IBRX100

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 51.382 |
| MÍNIMO | 50.549 |
| MÁXIMO | 51.483 |
| FECHAMENTO | 50.920 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 50.930 |
| MÉDIA PONDERADA | 50.938 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 24 |
| BAIXAS | 75 |
| ESTÁVEIS | 1 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 100 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 56.006 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 47.167 - 26 FEV |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -0,90% |
| ONTEM | -0,77% |
| NA SEMANA | -1,67% |
| EM UMA SEMANA | -1,19% |
| NO MÊS | -3,25% |
| EM UM MÊS | -3,25% |
| NO ANO | +1,07% |
| EM UM ANO | +20,88% |

IBRASIL

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.856 |
| MÍNIMO | 4.773 |
| MÁXIMO | 4.867 |
| FECHAMENTO | 4.804 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.810 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.809 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 41 |
| BAIXAS | 134 |
| ESTÁVEIS | 3 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 178 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 5.266 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 4.424 - 26 FEV |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,06% |
| ONTEM | -0,81% |
| NA SEMANA | -1,87% |
| EM UMA SEMANA | -1,43% |
| NO MÊS | -3,17% |
| EM UM MÊS | -3,17% |
| NO ANO | +2,11% |
| EM UM ANO | +21,83% |

ISE

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.061 |
| MÍNIMO | 3.998 |
| MÁXIMO | 4.077 |
| FECHAMENTO | 4.017 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.033 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.028 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 19 |
| BAIXAS | 27 |
| ESTÁVEIS | 1 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 47 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 4.393 - 15 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 3.787 - 08 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | -1,10% |
| ONTEM | -0,65% |
| NA SEMANA | -1,74% |
| EM UMA SEMANA | -0,91% |
| NO MÊS | +0,10% |
| EM UM MÊS | +0,10% |
| NO ANO | -3,28% |
| EM UM ANO | +5,68% |

ICO2

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.384 |
| MÍNIMO | 2.351 |
| MÁXIMO | 2.405 |
| FECHAMENTO | 2.370 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.374 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.373 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 18 |
| BAIXAS | 43 |
| ESTÁVEIS | 1 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 62 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 2.655 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 2.267 - 01 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | -0,59% |
| ONTEM | -0,78% |
| NA SEMANA | -1,38% |
| EM UMA SEMANA | -1,08% |
| NO MÊS | -2,68% |
| EM UM MÊS | -2,68% |
| NO ANO | -6,61% |
| EM UM ANO | +8,52% |

IEE

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 80.046 |
| MÍNIMO | 79.413 |
| MÁXIMO | 80.293 |
| FECHAMENTO | 79.946 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 79.844 |
| MÉDIA PONDERADA | 79.961 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 5 |
| BAIXAS | 12 |
| ESTÁVEIS | 1 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 18 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 85.292 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 72.997 - 08 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -0,10% |
| ONTEM | -0,70% |
| NA SEMANA | -0,80% |
| EM UMA SEMANA | -1,21% |
| NO MÊS | +2,30% |
| EM UM MÊS | +2,30% |
| NO ANO | -3,50% |
| EM UM ANO | +11,09% |

BDI**IVBX2****COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 16.146 |
| MÍNIMO | 15.898 |
| MÁXIMO | 16.218 |
| FECHAMENTO | 16.040 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 16.041 |
| MÉDIA PONDERADA | 16.041 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 10 |
| BAIXAS | 40 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 50 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 17.808 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 15.309 - 08 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -0,66% |
| ONTEM | -0,69% |
| NA SEMANA | -1,35% |
| EM UMA SEMANA | -1,28% |
| NO MÊS | -2,92% |
| EM UM MÊS | -2,92% |
| NO ANO | +0,27% |
| EM UM ANO | +10,69% |

IGC**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 19.779 |
| MÍNIMO | 19.418 |
| MÁXIMO | 19.823 |
| FECHAMENTO | 19.544 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 19.577 |
| MÉDIA PONDERADA | 19.568 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 65 |
| BAIXAS | 196 |
| ESTÁVEIS | 6 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 267 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 21.435 - 14 JUL |
| MÍNIMO NO ANO | 18.264 - 26 FEV |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,18% |
| ONTEM | -0,81% |
| NA SEMANA | -1,99% |
| EM UMA SEMANA | -1,44% |
| NO MÊS | -3,57% |
| EM UM MÊS | -3,57% |
| NO ANO | +2,21% |
| EM UM ANO | +19,85% |

IGC TRADE**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 5.462 |
| MÍNIMO | 5.369 |
| MÁXIMO | 5.477 |
| FECHAMENTO | 5.404 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 5.412 |
| MÉDIA PONDERADA | 5.410 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 38 |
| BAIXAS | 129 |
| ESTÁVEIS | 3 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 170 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 5.910 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 4.993 - 26 FEV |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,07% |
| ONTEM | -0,85% |
| NA SEMANA | -1,92% |
| EM UMA SEMANA | -1,34% |
| NO MÊS | -3,14% |
| EM UM MÊS | -3,14% |
| NO ANO | +1,87% |
| EM UM ANO | +20,83% |

IGNM**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.343 |
| MÍNIMO | 4.260 |
| MÁXIMO | 4.353 |
| FECHAMENTO | 4.290 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.297 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.294 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 44 |
| BAIXAS | 143 |
| ESTÁVEIS | 5 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 192 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 4.793 - 14 JUL |
| MÍNIMO NO ANO | 4.171 - 24 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,20% |
| ONTEM | -0,82% |
| NA SEMANA | -2,02% |
| EM UMA SEMANA | -1,73% |
| NO MÊS | -4,76% |
| EM UM MÊS | -4,76% |
| NO ANO | -0,29% |
| EM UM ANO | +14,00% |

ITAG**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 27.079 |
| MÍNIMO | 26.608 |
| MÁXIMO | 27.150 |
| FECHAMENTO | 26.780 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 26.822 |
| MÉDIA PONDERADA | 26.812 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 61 |
| BAIXAS | 188 |
| ESTÁVEIS | 7 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 256 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 29.272 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 24.856 - 26 FEV |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,10% |
| ONTEM | -0,82% |
| NA SEMANA | -1,92% |
| EM UMA SEMANA | -1,35% |
| NO MÊS | -3,36% |
| EM UM MÊS | -3,36% |
| NO ANO | +1,92% |
| EM UM ANO | +20,79% |

MIDLARGE CAP**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.354 |
| MÍNIMO | 2.314 |
| MÁXIMO | 2.357 |
| FECHAMENTO | 2.329 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.330 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.330 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 20 |
| BAIXAS | 47 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 67 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 2.546 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 2.139 - 26 FEV |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,03% |
| ONTEM | -0,77% |
| NA SEMANA | -1,80% |
| EM UMA SEMANA | -1,32% |
| NO MÊS | -3,11% |
| EM UM MÊS | -3,11% |
| NO ANO | +2,25% |
| EM UM ANO | +22,64% |

S&P 500 Dados Históricos

Período:

Diário [Baixar dados](#)01/01/2021 - 31/08/2021 

| Data | Último | Abertura | Máxima | Mínima | Vol. | Var% |
|-----------------------|----------|------------------------|--------------------------|------------------------|------|--------------------|
| Ago 21 | 4.522,68 | 4.415,90 | 4.537,80 | 4.369,20 | - | 2,90% |
| Jul 21 | 4.395,26 | 4.304,10 | 4.430,20 | 4.232,80 | - | 2,27% |
| Jun 21 | 4.297,50 | 4.216,52 | 4.302,43 | 4.164,40 | - | 2,22% |
| Mai 21 | 4.204,11 | 4.191,98 | 4.238,04 | 4.056,88 | - | 0,55% |
| Abr 21 | 4.181,17 | 3.992,78 | 4.218,78 | 3.992,78 | - | 5,24% |
| Mar 21 | 3.972,89 | 3.842,51 | 3.994,41 | 3.723,34 | - | 4,24% |
| Fev 21 | 3.811,15 | 3.731,17 | 3.950,43 | 3.725,62 | - | 2,61% |
| Jan 21 | 3.714,24 | 3.764,61 | 3.870,90 | 3.662,71 | - | -1,11% |
| Alta: 4.537,80 | | Baixa: 3.662,71 | Diferença: 875,09 | Média: 4.137,37 | | Var%: 20,41 |

S&P 500 Dados Históricos

Período:

Diário [Baixar dados](#)19/09/2019 - 08/09/2021 

| Data | Último | Abertura | Máxima | Mínima | Vol. | Var% |
|-----------------------|----------|------------------------|----------------------------|------------------------|------|--------------------|
| Set 21 | 4.519,21 | 4.531,04 | 4.544,58 | 4.508,62 | - | -0,08% |
| Ago 21 | 4.522,68 | 4.415,90 | 4.537,80 | 4.369,20 | - | 2,90% |
| Jul 21 | 4.395,26 | 4.304,10 | 4.430,20 | 4.232,80 | - | 2,27% |
| Jun 21 | 4.297,50 | 4.216,52 | 4.302,43 | 4.164,40 | - | 2,22% |
| Mai 21 | 4.204,11 | 4.191,98 | 4.238,04 | 4.056,88 | - | 0,55% |
| Abr 21 | 4.181,17 | 3.992,78 | 4.218,78 | 3.992,78 | - | 5,24% |
| Mar 21 | 3.972,89 | 3.842,51 | 3.994,41 | 3.723,34 | - | 4,24% |
| Fev 21 | 3.811,15 | 3.731,17 | 3.950,43 | 3.725,62 | - | 2,61% |
| Jan 21 | 3.714,24 | 3.764,61 | 3.870,90 | 3.662,71 | - | -1,11% |
| Dez 20 | 3.756,07 | 3.645,87 | 3.760,20 | 3.633,40 | - | 3,71% |
| Nov 20 | 3.621,63 | 3.296,20 | 3.645,99 | 3.279,74 | - | 10,75% |
| Out 20 | 3.269,96 | 3.385,87 | 3.549,85 | 3.233,94 | - | -2,77% |
| Set 20 | 3.363,00 | 3.507,44 | 3.588,11 | 3.209,45 | - | -3,92% |
| Ago 20 | 3.500,31 | 3.288,26 | 3.514,77 | 3.284,53 | - | 7,01% |
| Jul 20 | 3.271,12 | 3.105,92 | 3.279,99 | 3.101,17 | - | 5,51% |
| Jun 20 | 3.100,29 | 3.038,78 | 3.233,13 | 2.965,66 | - | 1,84% |
| Mai 20 | 3.044,31 | 2.869,09 | 3.068,67 | 2.766,64 | - | 4,53% |
| Abr 20 | 2.912,43 | 2.498,08 | 2.954,86 | 2.447,49 | - | 12,68% |
| Mar 20 | 2.584,59 | 2.974,28 | 3.136,72 | 2.191,86 | - | -12,51% |
| Fev 20 | 2.954,22 | 3.235,66 | 3.393,52 | 2.855,84 | - | -8,41% |
| Jan 20 | 3.225,52 | 3.244,67 | 3.337,77 | 3.214,64 | - | -0,16% |
| Dez 19 | 3.230,78 | 3.143,85 | 3.247,93 | 3.070,33 | - | 2,86% |
| Nov 19 | 3.140,98 | 3.050,72 | 3.154,26 | 3.050,72 | - | 3,40% |
| Out 19 | 3.037,56 | 2.983,69 | 3.050,10 | 2.855,94 | - | 2,04% |
| Alta: 4.544,58 | | Baixa: 2.191,86 | Diferença: 2.352,72 | Média: 3.567,96 | | Var%: 51,82 |

IMA - Índice de Mercado ANBIMA

Quadro Resumo



XLS

CSV

TXT

XML

Download

IMA - Índice de Mercado ANBIMA

| Índice | Data de Referência | Número Índice | Variação Diária (%) | Variação no Mês (%) | Variação no Ano (%) | Variação 12 Meses (%) | Variação 24 Meses (%) | Peso (%) | Duration (d.u.) | Carteira a Mercado (R\$ mil) | Número de Operações * | Quant. Negociada (1.000 títulos) * | Valor Negociado (R\$ mil) * | PMR | Convexidade | Yield | Redemption Yield |
|----------------|--------------------|---------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------------|-------|-------------|--------|------------------|
| IRF-M 1 | 31/08/2021 | 11.805,242204 | 0,0193 | 0,3653 | 1,3723 | 2,2369 | 7,4069 | 11,58 | 90 | 591.929.175 | 63 | 9.530,13 | 9.395.682,75 | 130 | 0,4887 | 6,5828 | 7,3657 |
| IRF-M 1+ | 31/08/2021 | 15.633,583097 | -0,3834 | -1,1141 | -5,1770 | -3,3212 | 6,9625 | 21,24 | 629 | 1.085.945.210 | 296 | 15.584,26 | 13.812.272,89 | 948 | 9,4630 | 9,2568 | 9,5570 |
| IRF-M | 31/08/2021 | 14.060,200453 | -0,2417 | -0,5965 | -2,6262 | -1,2470 | 7,3477 | 32,82 | 438 | 1.677.874.384 | 359 | 25.114,39 | 23.207.955,64 | 660 | 6,2970 | 8,3135 | 9,3987 |
| IMA-B 5 | 31/08/2021 | 7.076,617206 | -0,1242 | 0,1512 | 1,4681 | 4,7691 | 14,4510 | 13,87 | 600 | 709.062.284 | 945 | 4.126,67 | 15.845.287,46 | 880 | 9,0835 | 3,6829 | 3,9911 |
| IMA-B 5+ | 31/08/2021 | 9.530,765692 | -0,7030 | -2,2197 | -5,4400 | 1,8028 | 6,5997 | 13,89 | 3.061 | 709.919.582 | 537 | 1.003,28 | 4.192.569,78 | 5.528 | 215,7070 | 4,7333 | 4,7656 |
| IMA-B | 31/08/2021 | 7.951,783869 | -0,4146 | -1,0896 | -2,1704 | 3,2655 | 10,1238 | 27,75 | 1.831 | 1.418.981.866 | 1.482 | 5.129,95 | 20.037.857,24 | 3.205 | 112,4576 | 4,2084 | 4,6388 |
| IMA-S | 31/08/2021 | 4.883,753599 | 0,0235 | 0,4431 | 2,1325 | 2,4338 | 6,3686 | 37,39 | 1 | 1.911.586.634 | 345 | 532,91 | 5.829.058,39 | 1 | 0,0000 | -- | -- |
| IMA-GERAL ex-C | 31/08/2021 | 6.116,836458 | -0,1898 | -0,3401 | -0,7802 | 1,3056 | 7,5469 | 97,96 | 666 | 5.008.442.884 | 2.186 | 30.777,25 | 49.074.871,26 | 1.129 | 33,9708 | -- | -- |
| IMA-GERAL | 31/08/2021 | 6.231,710962 | -0,1848 | -0,4074 | -0,3703 | 1,8704 | 8,5036 | 100,00 | 686 | 5.112.661.638 | 2.186 | 30.777,25 | 49.074.871,26 | 1.158 | 34,3916 | -- | -- |

* Segmento Extragrupo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Quadro Resumo



XLS

CSV

TXT

XML

Download

Resultado Diário - 31/08/2021

| Índices | Nº Índice | Retornos | | | | Volatilidade (% a.a.) * | Taxa de Juros (% a.a.) | |
|------------------|---------------|----------|---------|----------|------------|----------------------------|------------------------|-------------|
| | | % Dia | % Mês | % Ano | % 12 Meses | | Compra (D-1) | Venda (D-0) |
| PREFIXADO | | | | | | | | |
| IDKa Pré 3M | 4.333,967150 | 0,0257 | 0,4407 | 1,8597 | 2,5502 | 0,1072 | 6,4019 | 6,3972 |
| IDKa Pré 1A | 5.177,250622 | -0,0152 | 0,1246 | -0,1528 | 0,9960 | 1,1257 | 8,1821 | 8,2325 |
| IDKa Pré 2A | 6.169,012576 | -0,2373 | -0,5127 | -3,1107 | -1,9133 | 3,2837 | 8,9988 | 9,1473 |
| IDKa Pré 3A | 6.732,708848 | -0,5123 | -1,3637 | -6,0703 | -4,3023 | 6,0721 | 9,3888 | 9,5895 |
| IDKa Pré 5A | 7.402,061291 | -1,0646 | -3,4189 | -11,7029 | -8,0566 | 12,0661 | 9,8823 | 10,1262 |
| IPCA | | | | | | | | |
| IDKa IPCA 2A | 6.670,984205 | -0,0819 | 0,2640 | 1,9529 | 5,0782 | 2,3758 | 3,7650 | 3,8315 |
| IDKa IPCA 3A | 7.079,052343 | -0,2057 | 0,0338 | 0,2507 | 3,3439 | 3,6256 | 4,1031 | 4,1911 |
| IDKa IPCA 5A | 7.352,741559 | -0,4212 | -0,4249 | -2,6847 | 1,7503 | 6,3776 | 4,3604 | 4,4587 |
| IDKa IPCA 10A | 8.113,296942 | -0,7107 | -1,6710 | -6,2782 | 0,8913 | 13,6935 | 4,5884 | 4,6682 |
| IDKa IPCA 15A | 9.649,410957 | -0,8402 | -3,0367 | -7,8350 | 0,8842 | 18,5499 | 4,7106 | 4,7730 |
| IDKa IPCA 20A | 11.822,044203 | -0,9962 | -4,4155 | -9,2113 | 0,6996 | 20,4298 | 4,7924 | 4,8475 |
| IDKa IPCA 30A | 18.022,075289 | -1,5022 | -7,0410 | -12,2990 | -0,3295 | 27,2136 | 4,8888 | 4,9435 |

* Desvio-padrão dos retornos diários em uma janela de 21 dias úteis de análise.

Fonte: **Anbima**.

Títulos Públicos Federais

31/Ago/2021

| Papel IPCA | | NTN-B - Taxa (% a.a.)/252 | | | | | | | | |
|--------------|-------------------|---------------------------|------------|-----------|-----------------|--------------|----------------------|-------------|--------------|--------------|
| Código SELIC | Data Base/Emissão | Data de Vencimento | Tx. Compra | Tx. Venda | Tx. Indicativas | PU | Intervalo Indicativo | | | |
| | | | | | | | Mínimo (D0) | Máximo (D0) | Mínimo (D+1) | Máximo (D+1) |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/08/2022 | 2,5412 | 2,5152 | 2,5278 | 3.745,602847 | 2,1473 | 3,5318 | 2,1551 | 3,5393 |
| 760100 | 15/07/2000 | 15/03/2023 | 3,5380 | 3,5020 | 3,5177 | 3.850,328497 | 3,1059 | 4,4969 | 3,1503 | 4,5416 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/05/2023 | 3,5330 | 3,5070 | 3,5193 | 3.829,102429 | 3,1229 | 4,5018 | 3,1680 | 4,5472 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/08/2024 | 4,1531 | 4,1282 | 4,1414 | 3.812,304039 | 3,6862 | 5,0891 | 3,7648 | 5,1675 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/05/2025 | 4,2920 | 4,2631 | 4,2773 | 3.892,462045 | 3,7773 | 5,1873 | 3,8677 | 5,2777 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/08/2026 | 4,4112 | 4,3851 | 4,4000 | 3.880,156500 | 3,8756 | 5,2358 | 3,9737 | 5,3340 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/08/2028 | 4,5401 | 4,5138 | 4,5274 | 3.940,058689 | 4,0236 | 5,2475 | 4,1167 | 5,3408 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/08/2030 | 4,6076 | 4,5688 | 4,5921 | 3.996,546895 | 4,1205 | 5,2208 | 4,2050 | 5,3056 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/05/2035 | 4,6454 | 4,6132 | 4,6296 | 4.177,795727 | 4,1790 | 5,1367 | 4,2501 | 5,2080 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/08/2040 | 4,7916 | 4,7543 | 4,7755 | 4.173,512862 | 4,3332 | 5,2965 | 4,4010 | 5,3649 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/05/2045 | 4,8231 | 4,7903 | 4,8069 | 4.286,652189 | 4,3722 | 5,3051 | 4,4354 | 5,3692 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/08/2050 | 4,8346 | 4,7967 | 4,8183 | 4.290,163921 | 4,3878 | 5,2990 | 4,4489 | 5,3613 |
| 760199 | 15/07/2000 | 15/05/2055 | 4,8605 | 4,8175 | 4,8369 | 4.377,323670 | 4,4161 | 5,3137 | 4,4691 | 5,3680 |

Quando uma taxa for interpolada será apresentada em negrito.

Os preços unitários são calculados a partir da projeção para o IPCA apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA

para o mês, à exceção do período entre o dia de divulgação do IPCA final e o dia 15 do mês corrente, caso em que é utilizado o próprio índice do

mês anterior, divulgado pelo IBGE.

Projeção IPCA para Agosto:

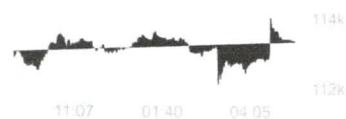
Média apurada pela Comitê de Acompanhamento Macroeconômico da ANBIMA: 0,66%

Ibovespa ↑ 0.27% 113.583 pts

Fech. Ant: 113.283 • Abertura: 113.283

Ativo ou í

search

**DÓLAR** +0,64% R\$ 5,38**BITCOIN** -5,28% R\$ 226541,72↑ MAIORES ALTAS**MRFG3** +7.14% R\$ 24,28**BRFS3** +7.00% R\$ 26,28**PRIQ3** +5.09% R\$ 23,11**SANB11** +3.78% R\$ 36,49**CSNA3** +3.23% R\$ 29,97↓ MAIORES BAIXAS**CASH3** -5.17% R\$ 6,59**VIA3** -4.70% R\$ 8,10**MGLU3** -3.96% R\$ 15,01**BID11** -3.88% R\$ 58,71**BID14** -3.68% R\$ 19,58

access_time 27/9/2021. Delay 15 min

[Confira mais Altas e Baixas >](#)

[Inflação](#)[Tx CDI](#)[Câmbio](#)[Poup - A](#)[Poup - N](#)[Tx Refer.](#)[Tx Básica](#)

| www.portaldefinancas.com | | | | | | |
|--------------------------|----------|--------|-----------|--------|-------------|----------|
| Taxa CDI | | | | | | |
| Data | Taxa % | | | | | |
| | Diária | | Acumulada | | | |
| | Do dia | No ano | No | | Nos últimos | |
| | | | Mês | Ano | 30 dias | 12 meses |
| 27/09/2021 | 0,023687 | 6,15 | 0,3707 | 2,4511 | 0,4107 | 2,9574 |
| 24/09/2021 | 0,023687 | 6,15 | 0,3469 | 2,4268 | 0,4469 | 2,9407 |
| 23/09/2021 | 0,023687 | 6,15 | 0,3231 | 2,4026 | 0,4431 | 2,9240 |
| 22/09/2021 | 0,019930 | 5,15 | 0,2994 | 2,3783 | 0,4394 | 2,9073 |
| 21/09/2021 | 0,019930 | 5,15 | 0,2794 | 2,3579 | 0,4194 | 2,8945 |
| 20/09/2021 | 0,019930 | 5,15 | 0,2594 | 2,3375 | 0,3993 | 2,8817 |
| 17/09/2021 | 0,019930 | 5,15 | 0,2394 | 2,3171 | 0,4394 | 2,8688 |

[Outros períodos desde 1986, click aqui](#)

←

Anúncios Google

REFERENTE A SEGUNDA-FEIRA - 27 DE SETEMBRO 2021 - Nº 183

FECHAMENTO DO IBOVESPA: 113.583 +0,26%

DERIVATIVOS

CONTRATOS COM MINIS
CONTRATOS SEM MINIS

AÇÕES

VOLUME NEGOCIADO 30.661.978.781,20
QUANTIDADE DE NEGÓCIOS 3.796.395

DERIVATIVOS - MÉDIAS DIÁRIAS DE CONTRATOS NEGOCIADOS

| | TOTAL COM MINIS | TOTAL SEM MINIS |
|--------------------|-----------------|-----------------|
| DIA | 40.561.794 | 20.639.724 |
| MÊS | 53.536.034 | 30.220.459 |
| MÊS ANTERIOR | 51.561.103 | 27.481.321 |
| TRIMESTRE | 52.016.939 | 28.661.086 |
| TRIMESTRE ANTERIOR | 46.162.098 | 26.149.055 |
| SEMESTRE | 52.016.939 | 28.661.086 |
| SEMESTRE ANTERIOR | 51.699.045 | 30.894.413 |
| ANO | 51.803.845 | 30.158.152 |
| ANO ANTERIOR | 39.522.808 | 24.972.665 |

AÇÕES - MÉDIAS DIÁRIAS DE NEGOCIAÇÃO

| | VOLUME R\$ MILHÕES | NÚMERO DE NEGÓCIOS |
|--------------------|--------------------|--------------------|
| DIA | 30.661,97 | 3.796.395 |
| MES | 33.776,71 | 4.088.695 |
| MES ANTERIOR | 32.969,85 | 4.103.055 |
| TRIMESTRE | 31.565,90 | 3.876.807 |
| TRIMESTRE ANTERIOR | 33.594,94 | 3.841.743 |
| SEMESTRE | 31.565,90 | 3.876.807 |
| SEMESTRE ANTERIOR | 35.386,55 | 3.979.994 |
| ANO | 34.113,00 | 3.945.598 |
| ANO ANTERIOR | 29.716,83 | 3.572.869 |

SUMÁRIO

Evolução do Ibovespa.....2
Derivativos - Resumo das Operações.....3
Ações - Resumo das Operações.....5

INDICADORES E INFORMATIVOS

Indicadores econômicos.....6
Informações agropecuárias.....8
Evolução dos Índices.....11
Ações - Maiores Oscilações e Mais Negociadas.....15
Participação dos Investidores Informativos.....16

COTAÇÕES

Derivativos - Resumo Estatístico A1
A vista, termo e opções.....B1
After Market.....C1

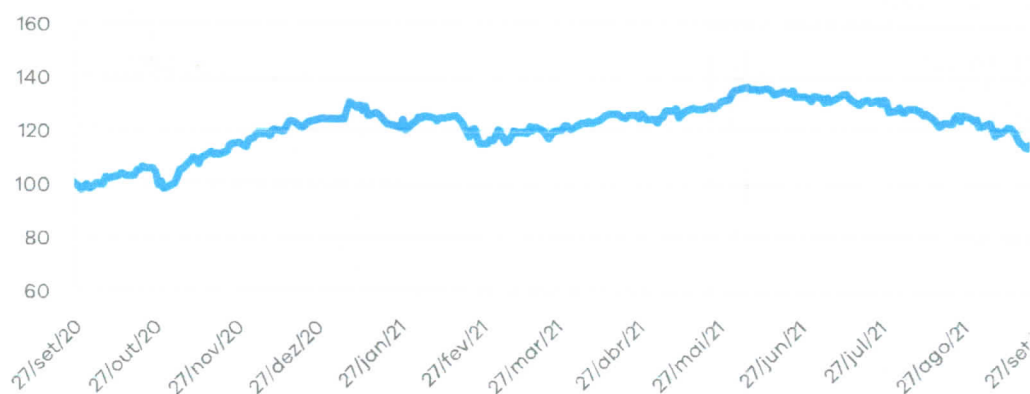
RENDA FIXA

Renda Fixa Privada.....D1
Tesouro Direto.....D3

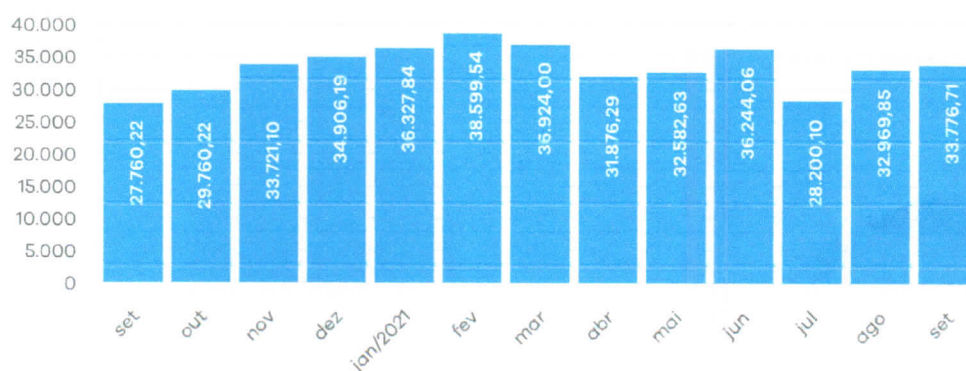
CLEARING

Câmbio.....D5
Quadro analítico das posições em aberto.....D7
Custódia.....D10
Banco de Títulos.....D13

IBOVESPA - EM UM ANO



MÉDIAS DIÁRIAS - VOLUME EM UM ANO R\$ MILHÕES



Evolução dos Índices

IFIX L B3

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 1.202 |
| MÍNIMO | 1.202 |
| MÁXIMO | 1.208 |
| FECHAMENTO | 1.204 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 1.206 |
| MÉDIA PONDERADA | 1.206 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 34 |
| BAIXAS | 28 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 62 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 1.288 - 05 FEV |
| MÍNIMO NO ANO | 1.193 - 19 AGO |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | +0,10% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,10% |
| EM UMA SEMANA | +0,41% |
| NO MÊS | -1,37% |
| EM UM MÊS | -0,60% |
| NO ANO | -5,94% |
| EM UM ANO | -2,83% |

IBRX100

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 48.343 |
| MÍNIMO | 47.977 |
| MÁXIMO | 48.816 |
| FECHAMENTO | 48.482 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 48.386 |
| MÉDIA PONDERADA | 48.357 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 37 |
| BAIXAS | 62 |
| ESTÁVEIS | 1 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 100 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 56.006 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 46.488 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | +0,28% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,29% |
| EM UMA SEMANA | +4,29% |
| NO MÊS | -4,79% |
| EM UM MÊS | -6,38% |
| NO ANO | -3,77% |
| EM UM ANO | +17,63% |

IBRASIL

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.568 |
| MÍNIMO | 4.534 |
| MÁXIMO | 4.611 |
| FECHAMENTO | 4.580 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.572 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.569 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 73 |
| BAIXAS | 127 |
| ESTÁVEIS | 3 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 203 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 5.266 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 4.392 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | +0,26% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,26% |
| EM UMA SEMANA | +4,30% |
| NO MÊS | -4,65% |
| EM UM MÊS | -6,44% |
| NO ANO | -2,64% |
| EM UM ANO | +18,98% |

ISE

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 3.938 |
| MÍNIMO | 3.908 |
| MÁXIMO | 3.982 |
| FECHAMENTO | 3.951 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 3.945 |
| MÉDIA PONDERADA | 3.943 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 24 |
| BAIXAS | 23 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 47 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 4.393 - 15 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 3.777 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | +0,32% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,33% |
| EM UMA SEMANA | +4,60% |
| NO MÊS | -1,64% |
| EM UM MÊS | -3,35% |
| NO ANO | -4,87% |
| EM UM ANO | +7,70% |

ICO2

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.279 |
| MÍNIMO | 2.258 |
| MÁXIMO | 2.301 |
| FECHAMENTO | 2.282 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.276 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.276 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 25 |
| BAIXAS | 36 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 61 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 2.655 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 2.201 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | +0,10% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,10% |
| EM UMA SEMANA | +3,64% |
| NO MÊS | -3,74% |
| EM UM MÊS | -5,07% |
| NO ANO | -10,10% |
| EM UM ANO | +7,33% |

IEE

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 80.079 |
| MÍNIMO | 79.245 |
| MÁXIMO | 80.244 |
| FECHAMENTO | 79.902 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 79.848 |
| MÉDIA PONDERADA | 79.813 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 8 |
| BAIXAS | 10 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 18 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 85.292 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 72.997 - 08 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -0,19% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | -0,20% |
| EM UMA SEMANA | +1,09% |
| NO MÊS | -0,05% |
| EM UM MÊS | -0,85% |
| NO ANO | -3,55% |
| EM UM ANO | +13,16% |

BDI**IVBX2****COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 15.752 |
| MÍNIMO | 15.503 |
| MÁXIMO | 15.797 |
| FECHAMENTO | 15.684 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 15.670 |
| MÉDIA PONDERADA | 15.664 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 16 |
| BAIXAS | 34 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 50 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 17.808 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 15.118 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -0,43% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | -0,43% |
| EM UMA SEMANA | +3,74% |
| NO MÊS | -2,22% |
| EM UM MÊS | -3,54% |
| NO ANO | -1,95% |
| EM UM ANO | +10,71% |

IGC**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 18.685 |
| MÍNIMO | 18.508 |
| MÁXIMO | 18.812 |
| FECHAMENTO | 18.694 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 18.669 |
| MÉDIA PONDERADA | 18.658 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 100 |
| BAIXAS | 159 |
| ESTÁVEIS | 8 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 267 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 21.435 - 14 JUL |
| MÍNIMO NO ANO | 17.972 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | +0,05% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,05% |
| EM UMA SEMANA | +4,02% |
| NO MÊS | -4,35% |
| EM UM MÊS | -6,25% |
| NO ANO | -2,24% |
| EM UM ANO | +17,38% |

IGC TRADE**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 5.149 |
| MÍNIMO | 5.108 |
| MÁXIMO | 5.195 |
| FECHAMENTO | 5.161 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 5.152 |
| MÉDIA PONDERADA | 5.149 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 66 |
| BAIXAS | 123 |
| ESTÁVEIS | 2 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 191 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 5.910 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 4.945 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | +0,23% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,24% |
| EM UMA SEMANA | +4,38% |
| NO MÊS | -4,48% |
| EM UM MÊS | -6,32% |
| NO ANO | -2,69% |
| EM UM ANO | +18,41% |

IGNM**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.144 |
| MÍNIMO | 4.088 |
| MÁXIMO | 4.153 |
| FECHAMENTO | 4.127 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.125 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.122 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 59 |
| BAIXAS | 130 |
| ESTÁVEIS | 4 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 193 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 4.793 - 14 JUL |
| MÍNIMO NO ANO | 4.011 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -0,40% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | -0,41% |
| EM UMA SEMANA | +2,91% |
| NO MÊS | -3,80% |
| EM UM MÊS | -5,74% |
| NO ANO | -4,08% |
| EM UM ANO | +11,43% |

ITAG**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 25.452 |
| MÍNIMO | 25.258 |
| MÁXIMO | 25.681 |
| FECHAMENTO | 25.517 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 25.468 |
| MÉDIA PONDERADA | 25.453 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 96 |
| BAIXAS | 153 |
| ESTÁVEIS | 7 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 256 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 29.272 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 24.454 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | +0,25% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,25% |
| EM UMA SEMANA | +4,35% |
| NO MÊS | -4,72% |
| EM UM MÊS | -6,55% |
| NO ANO | -2,88% |
| EM UM ANO | +18,12% |

MIDLARGE CAP**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.207 |
| MÍNIMO | 2.192 |
| MÁXIMO | 2.231 |
| FECHAMENTO | 2.216 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.211 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.209 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 31 |
| BAIXAS | 41 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 72 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 2.546 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 2.122 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | +0,39% |
| ONTEM | 0% |
| NA SEMANA | +0,39% |
| EM UMA SEMANA | +4,42% |
| NO MÊS | -4,88% |
| EM UM MÊS | -6,59% |
| NO ANO | -2,74% |
| EM UM ANO | +19,31% |

S&P 500 Dados Históricos

Período:

Diário

[Baixar dados](#)



30/08/2021 - 28/09/2021



| Data | Último | Abertura | Máxima | Mínima | Vol. | Var% |
|-----------------------|------------------------|--------------------------|------------------------|--------------------|------|--------|
| 27.09.2021 | 4.443,11 | 4.442,12 | 4.457,30 | 4.436,19 | - | -0,28% |
| 24.09.2021 | 4.455,48 | 4.438,04 | 4.463,12 | 4.430,27 | - | 0,15% |
| 23.09.2021 | 4.448,98 | 4.406,75 | 4.465,40 | 4.406,75 | - | 1,21% |
| 22.09.2021 | 4.395,64 | 4.367,43 | 4.416,75 | 4.367,43 | - | 0,95% |
| 21.09.2021 | 4.354,18 | 4.374,45 | 4.394,87 | 4.347,96 | - | -0,08% |
| 20.09.2021 | 4.357,73 | 4.402,95 | 4.402,95 | 4.305,91 | - | -1,70% |
| 17.09.2021 | 4.432,99 | 4.469,74 | 4.471,52 | 4.427,76 | - | -0,91% |
| 16.09.2021 | 4.473,76 | 4.477,09 | 4.485,87 | 4.443,80 | - | -0,15% |
| 15.09.2021 | 4.480,70 | 4.447,49 | 4.486,87 | 4.438,37 | - | 0,85% |
| 14.09.2021 | 4.443,05 | 4.479,33 | 4.485,68 | 4.435,46 | - | -0,57% |
| 13.09.2021 | 4.468,73 | 4.474,81 | 4.492,99 | 4.445,70 | - | 0,23% |
| 10.09.2021 | 4.458,58 | 4.506,92 | 4.520,47 | 4.457,66 | - | -0,77% |
| 09.09.2021 | 4.493,28 | 4.513,02 | 4.529,90 | 4.492,07 | - | -0,46% |
| 08.09.2021 | 4.514,07 | 4.518,09 | 4.521,79 | 4.493,95 | - | -0,13% |
| 07.09.2021 | 4.520,03 | 4.535,38 | 4.535,38 | 4.513,00 | - | -0,34% |
| 03.09.2021 | 4.535,43 | 4.532,42 | 4.541,45 | 4.521,30 | - | -0,03% |
| 02.09.2021 | 4.536,95 | 4.534,48 | 4.545,85 | 4.524,66 | - | 0,28% |
| 01.09.2021 | 4.524,09 | 4.528,80 | 4.537,11 | 4.522,02 | - | 0,03% |
| 31.08.2021 | 4.522,68 | 4.529,75 | 4.531,39 | 4.515,80 | - | -0,13% |
| 30.08.2021 | 4.528,79 | 4.513,76 | 4.537,36 | 4.513,76 | - | 0,43% |
| Alta: 4.545,85 | Baixa: 4.305,91 | Diferença: 239,94 | Média: 4.469,41 | Var%: -1,47 | | |

S&P 500 Dados Históricos

Período:

Diário [Baixar dados](#)01/01/2021 - 28/09/2021 

| Data | Último | Abertura | Máxima | Mínima | Vol. | Var% |
|-----------------------|----------|------------------------|--------------------------|------------------------|------|--------------------|
| Set 21 | 4.443,11 | 4.531,04 | 4.544,58 | 4.305,61 | - | -1,76% |
| Ago 21 | 4.522,68 | 4.415,90 | 4.537,80 | 4.369,20 | - | 2,90% |
| Jul 21 | 4.395,26 | 4.304,10 | 4.430,20 | 4.232,80 | - | 2,27% |
| Jun 21 | 4.297,50 | 4.216,52 | 4.302,43 | 4.164,40 | - | 2,22% |
| Mai 21 | 4.204,11 | 4.191,98 | 4.238,04 | 4.056,88 | - | 0,55% |
| Abr 21 | 4.181,17 | 3.992,78 | 4.218,78 | 3.992,78 | - | 5,24% |
| Mar 21 | 3.972,89 | 3.842,51 | 3.994,41 | 3.723,34 | - | 4,24% |
| Fev 21 | 3.811,15 | 3.731,17 | 3.950,43 | 3.725,62 | - | 2,61% |
| Jan 21 | 3.714,24 | 3.764,61 | 3.870,90 | 3.662,71 | - | -1,11% |
| Alta: 4.544,58 | | Baixa: 3.662,71 | Diferença: 881,87 | Média: 4.171,35 | | Var%: 18,29 |

IMA - Índice de Mercado ANBIMA

Quadro Resumo



XLS

CSV

TXT

XML

Download

IMA - Índice de Mercado ANBIMA

| Índice | Data de Referência | Número Índice | Variação Diária (%) | Variação no Mês (%) | Variação no Ano (%) | Variação 12 Meses (%) | Variação 24 Meses (%) | Peso (%) | Duration (d.u.) | Carteira a Mercado (R\$ mil) | Número de Operações * | Quant. Negociada (1.000 títulos) * | Valor Negociado (R\$ mil) * | PMR | Convexidade | Yield | Redemption Yield |
|----------------|--------------------|---------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------------|-------|-------------|--------|------------------|
| IRF-M 1 | 27/09/2021 | 11.843,969387 | 0,0153 | 0,3281 | 1,7049 | 2,3971 | 7,0940 | 12,04 | 72 | 597.840.261 | -- | -- | -- | 104 | 0,3844 | 7,2820 | 8,0437 |
| IRF-M 1+ | 27/09/2021 | 15.543,533962 | -0,1694 | -0,5760 | -5,7232 | -3,5679 | 4,4357 | 21,97 | 608 | 1.091.298.812 | -- | -- | -- | 919 | 8,9439 | 9,8066 | 10,1108 |
| IRF-M | 27/09/2021 | 14.023,941051 | -0,1041 | -0,2579 | -2,8773 | -1,3483 | 5,5876 | 34,01 | 419 | 1.689.139.073 | -- | -- | -- | 631 | 5,9144 | 8,9131 | 9,9848 |
| IMA-B 5 | 27/09/2021 | 7.144,286243 | 0,0235 | 0,9562 | 2,4384 | 5,6148 | 13,5929 | 14,47 | 582 | 718.799.963 | -- | -- | -- | 853 | 8,6918 | 3,7736 | 4,1343 |
| IMA-B 5+ | 27/09/2021 | 9.477,451471 | -0,0056 | -0,5594 | -5,9689 | 2,9208 | 2,1888 | 14,36 | 3.015 | 713.348.998 | -- | -- | -- | 5.490 | 210,2862 | 4,9077 | 4,9292 |
| IMA-B | 27/09/2021 | 7.967,346240 | 0,0090 | 0,1957 | -1,9790 | 4,3607 | 7,2754 | 28,83 | 1.794 | 1.432.148.962 | -- | -- | -- | 3.163 | 109,1054 | 4,3385 | 4,7997 |
| IMA-S | 27/09/2021 | 4.904,096681 | 0,0243 | 0,4165 | 2,5579 | 2,9773 | 6,3373 | 35,09 | 1 | 1.742.757.899 | -- | -- | -- | 1 | 0,0000 | -- | -- |
| IMA-GERAL ex-C | 27/09/2021 | 6.123,862064 | -0,0248 | 0,1149 | -0,6662 | 1,7618 | 6,1474 | 97,93 | 674 | 4.864.045.933 | -- | -- | -- | 1.151 | 34,1784 | -- | -- |
| IMA-GERAL | 27/09/2021 | 6.236,865731 | -0,0224 | 0,0827 | -0,2879 | 2,2058 | 7,0468 | 100,00 | 694 | 4.966.799.522 | -- | -- | -- | 1.179 | 34,5727 | -- | -- |

* Segmento Extragruppo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Quadro Resumo



XLS

CSV

TXT

XML

Download

| Resultado Diário - 27/09/2021 | | | | | | | | |
|-------------------------------|---------------|----------|---------|----------|------------|----------------------------|------------------------|-------------|
| Índices | Nº Índice | Retornos | | | | Volatilidade (% a.a.) * | Taxa de Juros (% a.a.) | |
| | | % Dia | % Mês | % Ano | % 12 Meses | | Compra (D-1) | Venda (D-0) |
| PREFIXADO | | | | | | | | |
| IDkA Pré 3M | 4.349,700991 | 0,0189 | 0,3630 | 2,2295 | 2,7762 | 0,3529 | 7,1158 | 7,1524 |
| IDkA Pré 1A | 5.183,893411 | -0,0231 | 0,1283 | -0,0247 | 0,8909 | 2,1541 | 8,7812 | 8,8429 |
| IDkA Pré 2A | 6.144,305048 | -0,1326 | -0,4005 | -3,4987 | -2,2714 | 3,6866 | 9,6725 | 9,7656 |
| IDkA Pré 3A | 6.675,240284 | -0,2524 | -0,8536 | -6,8721 | -4,6807 | 5,6630 | 10,0703 | 10,1772 |
| IDkA Pré 5A | 7.288,118593 | -0,4332 | -1,5393 | -13,0621 | -8,5296 | 10,0791 | 10,5364 | 10,6413 |
| IPCA | | | | | | | | |
| IDkA IPCA 2A | 6.737,915956 | 0,0337 | 1,0033 | 2,9758 | 5,9157 | 1,8348 | 3,9492 | 4,0112 |
| IDkA IPCA 3A | 7.135,488676 | 0,0353 | 0,7972 | 1,0499 | 4,2211 | 2,8017 | 4,3388 | 4,3802 |
| IDkA IPCA 5A | 7.375,157679 | 0,0270 | 0,3049 | -2,3880 | 2,5410 | 4,9085 | 4,6471 | 4,6740 |
| IDkA IPCA 10A | 8.047,063227 | 0,0047 | -0,8164 | -7,0434 | 1,8535 | 9,2002 | 4,8782 | 4,8941 |
| IDkA IPCA 15A | 9.510,972090 | -0,0163 | -1,4347 | -9,1573 | 1,8685 | 11,7317 | 4,9553 | 4,9674 |
| IDkA IPCA 20A | 11.629,089782 | -0,0395 | -1,6322 | -10,6931 | 1,9057 | 13,3896 | 4,9938 | 5,0041 |
| IDkA IPCA 30A | 17.764,693862 | -0,0830 | -1,4281 | -13,5515 | 1,8387 | 20,9545 | 5,0323 | 5,0407 |

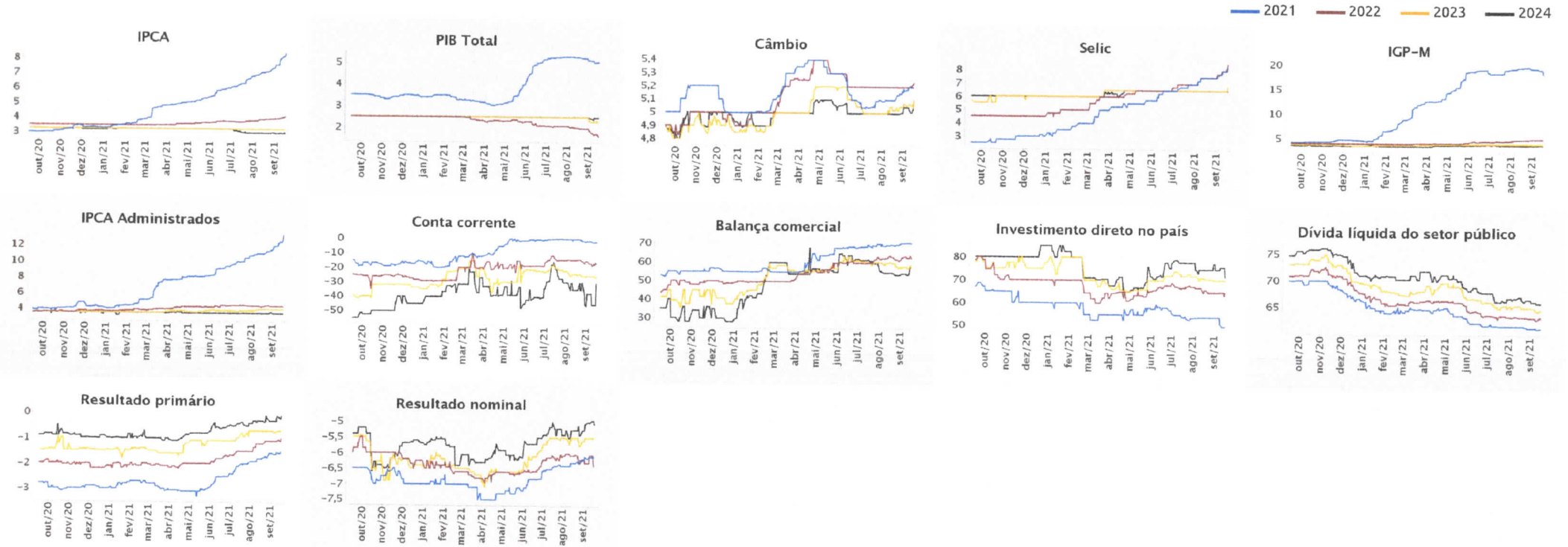
* Desvio-padrão dos retornos diários em uma janela de 21 dias úteis de análise.

Fonte: **Anbima**.

Mediana - Agregado

| | 2021 | | | | | | 2022 | | | | | | 2023 | | | | | 2024 | | | | | | |
|--|--------------|-------------|-------|-----------------|----------|--------------|-----------|--------------|-------------|--------|-----------------|----------|--------------|-----------|--------------|-------------|--------|-----------------|----------|--------------|-------------|--------|-----------------|----------|
| | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** | 5 dias úteis | Resp. *** | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** | 5 dias úteis | Resp. *** | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** |
| IPCA (variação %) | 7,11 | 8,00 | 8,35 | ▲ (24) | 133 | 8,40 | 107 | 3,93 | 4,03 | 4,10 | ▲ (9) | 131 | 4,10 | 105 | 3,25 | 3,25 | 3,25 | = (62) | 102 | 3,00 | 3,03 | 3,00 | ▼ (1) | 86 |
| PIB Total (variação % sobre ano anterior) | 5,27 | 5,04 | 5,04 | = (1) | 82 | 5,04 | 53 | 2,00 | 1,72 | 1,63 | ▼ (3) | 81 | 1,55 | 53 | 2,50 | 2,30 | 2,30 | = (1) | 57 | 2,50 | 2,50 | 2,50 | = (80) | 53 |
| Câmbio (R\$/US\$) | 5,10 | 5,20 | 5,20 | = (1) | 111 | 5,20 | 86 | 5,20 | 5,20 | 5,23 | ▲ (1) | 108 | 5,23 | 84 | 5,03 | 5,07 | 5,10 | ▲ (1) | 79 | 5,00 | 5,03 | 5,10 | ▲ (1) | 75 |
| Selic (% a.a.) | 7,50 | 8,00 | 8,25 | ▲ (3) | 121 | 8,25 | 98 | 7,50 | 8,00 | 8,50 | ▲ (3) | 118 | 8,50 | 97 | 6,50 | 6,50 | 6,75 | ▲ (1) | 97 | 6,50 | 6,50 | 6,50 | = (21) | 87 |
| IGP-M (variação %) | 19,52 | 19,22 | 18,21 | ▼ (3) | 78 | 18,17 | 64 | 4,88 | 4,99 | 5,00 | ▲ (1) | 76 | 4,98 | 64 | 4,00 | 4,00 | 4,00 | = (22) | 60 | 3,75 | 3,78 | 3,78 | = (1) | 55 |
| IPCA Administrados (variação %) | 11,00 | 12,35 | 13,30 | ▲ (4) | 59 | 13,54 | 43 | 4,40 | 4,40 | 4,37 | ▼ (1) | 55 | 4,17 | 40 | 4,00 | 4,00 | 4,00 | = (5) | 42 | 3,50 | 3,50 | 3,50 | = (21) | 38 |
| Conta corrente (US\$ bilhões) | 0,00 | -1,58 | -2,00 | ▼ (2) | 26 | -2,50 | 18 | -14,15 | -18,10 | -16,50 | ▲ (1) | 24 | -17,00 | 17 | -24,50 | -25,40 | -25,54 | ▼ (2) | 18 | -35,00 | -45,00 | -30,10 | ▲ (1) | 14 |
| Balança comercial (US\$ bilhões) | 70,00 | 71,00 | 70,70 | ▼ (1) | 27 | 69,75 | 18 | 63,50 | 63,00 | 63,00 | = (2) | 26 | 65,00 | 17 | 60,00 | 57,55 | 58,00 | ▲ (1) | 15 | 55,00 | 54,20 | 58,00 | ▲ (1) | 12 |
| Investimento direto no país (US\$ bilhões) | 54,00 | 51,15 | 50,00 | ▼ (2) | 26 | 50,00 | 16 | 66,00 | 65,00 | 65,00 | = (3) | 24 | 65,00 | 15 | 70,59 | 70,18 | 70,00 | ▼ (1) | 16 | 75,00 | 75,91 | 71,82 | ▼ (1) | 13 |
| Dívida líquida do setor público (% do PIB) | 61,50 | 61,00 | 61,00 | = (1) | 23 | 61,00 | 15 | 63,20 | 62,60 | 62,97 | ▲ (1) | 22 | 62,97 | 14 | 65,00 | 64,30 | 64,40 | ▲ (1) | 17 | 66,50 | 65,80 | 65,80 | = (1) | 15 |
| Resultado primário (% do PIB) | -1,74 | -1,53 | -1,50 | ▲ (3) | 27 | -1,40 | 17 | -1,20 | -1,10 | -1,00 | ▲ (1) | 26 | -0,95 | 16 | -0,70 | -0,70 | -0,65 | ▲ (1) | 22 | -0,30 | -0,10 | -0,10 | = (1) | 19 |
| Resultado nominal (% do PIB) | -6,30 | -6,10 | -6,10 | = (2) | 23 | -6,10 | 16 | -6,04 | -6,05 | -6,40 | ▼ (1) | 21 | -6,50 | 15 | -5,50 | -5,50 | -5,50 | = (2) | 18 | -5,25 | -5,00 | -5,05 | ▼ (1) | 16 |

* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias *** respondentes nos últimos 5 dias úteis

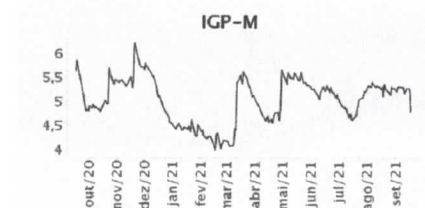
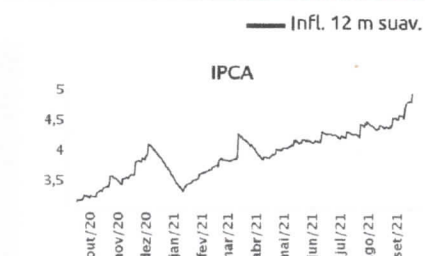
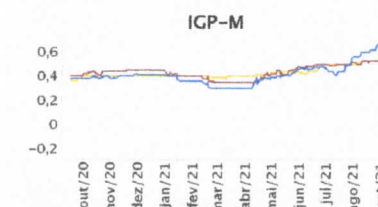
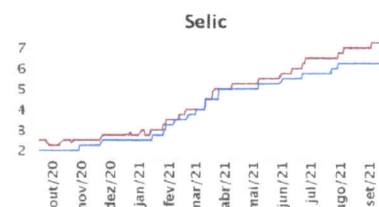
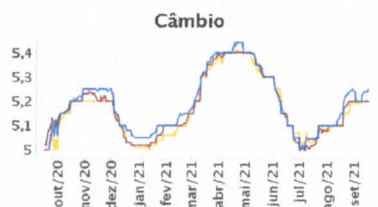
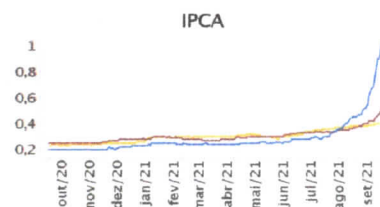


Mediana - Agregado

| | set/2021 | | | | | | out/2021 | | | | | | nov/2021 | | | | | | Infl. 12 m suav. | | | | | |
|--------------------|--------------|-------------|-------|-----------------|----------|--------------|--------------|-------------|------|-----------------|----------|--------------|--------------|-------------|------|-----------------|----------|--------------|------------------|-------------|------|-----------------|----------|--------------|
| | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** | 5 dias úteis | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** | 5 dias úteis | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** | 5 dias úteis | Há 4 semanas | Há 1 semana | Hoje | Comp. semanal * | Resp. ** | 5 dias úteis |
| IPCA (variação %) | 0,45 | 0,77 | 1,03 | ▲ (9) | 130 | 1,05 | 0,37 | 0,44 | 0,52 | ▲ (6) | 129 | 0,53 | 0,38 | 0,40 | 0,40 | = (1) | 129 | 0,40 | 4,39 | 4,75 | 4,93 | ▲ (4) | 119 | 4,95 |
| Câmbio (R\$/US\$) | 5,20 | 5,23 | 5,25 | ▲ (2) | 105 | 5,25 | 5,17 | 5,20 | 5,20 | = (3) | 105 | 5,22 | 5,15 | 5,20 | 5,20 | = (1) | 105 | 5,20 | | | | | | |
| Selic (% a.a.) | 6,25 | 6,25 | 6,25 | = (7) | 119 | 6,25 | 7,00 | 7,25 | 7,25 | = (2) | 118 | 7,25 | - | - | - | | | | | | | | | |
| IGP-M (variação %) | 0,62 | 0,50 | -0,22 | ▼ (3) | 77 | -0,29 | 0,53 | 0,50 | 0,43 | ▼ (3) | 77 | 0,40 | 0,53 | 0,55 | 0,52 | ▼ (1) | 77 | 0,53 | 5,29 | 5,18 | 4,79 | ▼ (2) | 72 | 4,66 |

* comportamento dos indicadores desde o Focus-Relatório de Mercado anterior; os valores entre parênteses expressam o número de semanas em que vem ocorrendo o último comportamento ** respondentes nos últimos 30 dias

— set/2021 — out/2021 — nov/2021



[Inflação](#)[Tx CDI](#)[Câmbio](#)[Poup - A](#)[Poup - N](#)[Tx Refer.](#)[Tx Básica](#)

| www.portaldefinancas.com | | | | | | |
|--------------------------|----------|--------|-----------|--------|-------------|----------|
| Taxa CDI | | | | | | |
| Data | Taxa % | | | | | |
| | Diária | | Acumulada | | | |
| | Do dia | No ano | No | | Nos últimos | |
| | | | Mês | Ano | 30 dias | 12 meses |
| 28/09/2021 | 0,023687 | 6,15 | 0,3944 | 2,4754 | 0,4344 | 2,9741 |
| 27/09/2021 | 0,023687 | 6,15 | 0,3707 | 2,4511 | 0,4107 | 2,9574 |
| 24/09/2021 | 0,023687 | 6,15 | 0,3469 | 2,4268 | 0,4469 | 2,9407 |
| 23/09/2021 | 0,023687 | 6,15 | 0,3231 | 2,4026 | 0,4431 | 2,9240 |
| 22/09/2021 | 0,019930 | 5,15 | 0,2994 | 2,3783 | 0,4394 | 2,9073 |
| 21/09/2021 | 0,019930 | 5,15 | 0,2794 | 2,3579 | 0,4194 | 2,8945 |
| 20/09/2021 | 0,019930 | 5,15 | 0,2594 | 2,3375 | 0,3993 | 2,8817 |

[Outros períodos desde 1986, click aqui](#)

Uma Contabilidade incomp

Segeti Consultoria



IMA - Índice de Mercado ANBIMA

Quadro Resumo



XLS

CSV

TXT

XML

Download

IMA - Índice de Mercado ANBIMA

| Índice | Data de Referência | Número Índice | Variação Diária (%) | Variação no Mês (%) | Variação no Ano (%) | Variação 12 Meses (%) | Variação 24 Meses (%) | Peso (%) | Duration (d.u.) | Carteira a Mercado (R\$ mil) | Número de Operações * | Quant. Negociada (1.000 títulos) * | Valor Negociado (R\$ mil) * | PMR | Convexidade | Yield | Redemption Yield |
|----------------|--------------------|---------------|---------------------|---------------------|---------------------|-----------------------|-----------------------|----------|-----------------|------------------------------|-----------------------|------------------------------------|-----------------------------|-------|-------------|--------|------------------|
| IRF-M 1 | 28/09/2021 | 11.845,645189 | 0,0141 | 0,3422 | 1,7193 | 2,4370 | 7,1091 | 12,05 | 71 | 597.924.849 | -- | -- | -- | 103 | 0,3785 | 7,3165 | 8,1071 |
| IRF-M 1+ | 28/09/2021 | 15.513,537818 | -0,1930 | -0,7679 | -5,9051 | -2,9273 | 4,2342 | 21,94 | 607 | 1.089.192.807 | -- | -- | -- | 918 | 8,8943 | 9,9155 | 10,2158 |
| IRF-M | 28/09/2021 | 14.007,158404 | -0,1197 | -0,3772 | -2,9935 | -0,8918 | 5,4612 | 33,99 | 417 | 1.687.117.656 | -- | -- | -- | 629 | 5,8763 | 8,9944 | 10,0883 |
| IMA-B 5 | 28/09/2021 | 7.146,399165 | 0,0296 | 0,9861 | 2,4687 | 6,1208 | 13,6265 | 14,49 | 581 | 719.012.548 | -- | -- | -- | 852 | 8,6664 | 3,7899 | 4,1544 |
| IMA-B 5+ | 28/09/2021 | 9.455,151780 | -0,2353 | -0,7934 | -6,1902 | 4,8338 | 1,9483 | 14,34 | 3.008 | 711.670.545 | -- | -- | -- | 5.486 | 209,3447 | 4,9331 | 4,9566 |
| IMA-B | 28/09/2021 | 7.959,191305 | -0,1024 | 0,0932 | -2,0793 | 5,6688 | 7,1656 | 28,82 | 1.788 | 1.430.683.093 | -- | -- | -- | 3.157 | 108,4907 | 4,3586 | 4,8255 |
| IMA-S | 28/09/2021 | 4.905,303485 | 0,0246 | 0,4413 | 2,5831 | 3,0428 | 6,3635 | 35,12 | 1 | 1.743.186.758 | -- | -- | -- | 1 | 0,0000 | -- | -- |
| IMA-GERAL ex-C | 28/09/2021 | 6.120,011489 | -0,0629 | 0,0519 | -0,7287 | 2,2834 | 6,0806 | 97,93 | 671 | 4.860.987.508 | -- | -- | -- | 1.148 | 33,9704 | -- | -- |
| IMA-GERAL | 28/09/2021 | 6.233,025779 | -0,0616 | 0,0211 | -0,3493 | 2,7288 | 6,9809 | 100,00 | 691 | 4.963.741.532 | -- | -- | -- | 1.176 | 34,3683 | -- | -- |

* Segmento Extragruppo. Dados Provisórios

Fonte: ANBIMA

Quadro Resumo



XLS

CSV

TXT

XML

Download

Resultado Diário - 28/09/2021

| Índices | Nº Índice | Retornos | | | | Volatilidade (% a.a.) * | Taxa de Juros (% a.a.) | |
|------------------|---------------|----------|---------|----------|------------|----------------------------|------------------------|-------------|
| | | % Dia | % Mês | % Ano | % 12 Meses | | Compra (D-1) | Venda (D-0) |
| PREFIXADO | | | | | | | | |
| IDkA Pré 3M | 4.350,744867 | 0,0240 | 0,3871 | 2,2540 | 2,7988 | 0,3531 | 7,1656 | 7,1807 |
| IDkA Pré 1A | 5.181,029667 | -0,0552 | 0,0730 | -0,0799 | 0,9907 | 2,1610 | 8,8486 | 8,9458 |
| IDkA Pré 2A | 6.133,410177 | -0,1773 | -0,5771 | -3,6698 | -1,9569 | 3,6839 | 9,7679 | 9,8859 |
| IDkA Pré 3A | 6.657,331064 | -0,2683 | -1,1196 | -7,1220 | -4,0628 | 5,6186 | 10,1784 | 10,2914 |
| IDkA Pré 5A | 7.259,651319 | -0,3906 | -1,9239 | -13,4016 | -7,2052 | 9,9365 | 10,6421 | 10,7377 |
| IPCA | | | | | | | | |
| IDkA IPCA 2A | 6.740,654319 | 0,0406 | 1,0444 | 3,0176 | 6,3173 | 1,7095 | 4,0134 | 4,0307 |
| IDkA IPCA 3A | 7.136,515263 | 0,0144 | 0,8117 | 1,0645 | 4,9485 | 2,6567 | 4,3812 | 4,4024 |
| IDkA IPCA 5A | 7.372,200579 | -0,0401 | 0,2646 | -2,4271 | 3,7251 | 4,5783 | 4,6743 | 4,6987 |
| IDkA IPCA 10A | 8.032,966824 | -0,1752 | -0,9901 | -7,2062 | 3,6703 | 8,2444 | 4,8942 | 4,9207 |
| IDkA IPCA 15A | 9.481,430750 | -0,3106 | -1,7408 | -9,4395 | 4,2006 | 10,8178 | 4,9675 | 4,9947 |
| IDkA IPCA 20A | 11.577,336546 | -0,4450 | -2,0699 | -11,0905 | 4,7507 | 13,0432 | 5,0041 | 5,0316 |
| IDkA IPCA 30A | 17.637,946285 | -0,7135 | -2,1314 | -14,1683 | 5,7184 | 20,8303 | 5,0408 | 5,0686 |

* Desvio-padrão dos retornos diários em uma janela de 21 dias úteis de análise.

S&P 500 (SPX)

Dados derivados atuais ▾

★ Adicionar à carteira

↓ **4.352,63 -90,48 (-2,04%)**

🕒 28/09 - Fechado. Moeda em USD ([Declaração de Riscos](#))

| | |
|----------------------|---------------------|
| Fechamento Anterior: | 4.352,63 |
| Compra/Venda: | 4.355,65 / 4.356,15 |
| Var. Diária: | 4.346,33 - 4.419,54 |

S&P 500 Dados Históricos

Período:

Diário ▾

[Baixar dados](#)

10/10/2019 - 29/09/2021



| Data | Último | Abertura | Máxima | Mínima | Vol. | Var% |
|-----------------------|----------|------------------------|----------------------------|------------------------|------|--------------------|
| Set 21 | 4.352,63 | 4.531,04 | 4.544,58 | 4.305,61 | - | -3,76% |
| Ago 21 | 4.522,68 | 4.415,90 | 4.537,80 | 4.369,20 | - | 2,90% |
| Jul 21 | 4.395,26 | 4.304,10 | 4.430,20 | 4.232,80 | - | 2,27% |
| Jun 21 | 4.297,50 | 4.216,52 | 4.302,43 | 4.164,40 | - | 2,22% |
| Mai 21 | 4.204,11 | 4.191,98 | 4.238,04 | 4.056,88 | - | 0,55% |
| Abr 21 | 4.181,17 | 3.992,78 | 4.218,78 | 3.992,78 | - | 5,24% |
| Mar 21 | 3.972,89 | 3.842,51 | 3.994,41 | 3.723,34 | - | 4,24% |
| Fev 21 | 3.811,15 | 3.731,17 | 3.950,43 | 3.725,62 | - | 2,61% |
| Jan 21 | 3.714,24 | 3.764,61 | 3.870,90 | 3.662,71 | - | -1,11% |
| Dez 20 | 3.756,07 | 3.645,87 | 3.760,20 | 3.633,40 | - | 3,71% |
| Nov 20 | 3.621,63 | 3.296,20 | 3.645,99 | 3.279,74 | - | 10,75% |
| Out 20 | 3.269,96 | 3.385,87 | 3.549,85 | 3.233,94 | - | -2,77% |
| Set 20 | 3.363,00 | 3.507,44 | 3.588,11 | 3.209,45 | - | -3,92% |
| Ago 20 | 3.500,31 | 3.288,26 | 3.514,77 | 3.284,53 | - | 7,01% |
| Jul 20 | 3.271,12 | 3.105,92 | 3.279,99 | 3.101,17 | - | 5,51% |
| Jun 20 | 3.100,29 | 3.038,78 | 3.233,13 | 2.965,66 | - | 1,84% |
| Mai 20 | 3.044,31 | 2.869,09 | 3.068,67 | 2.766,64 | - | 4,53% |
| Abr 20 | 2.912,43 | 2.498,08 | 2.954,86 | 2.447,49 | - | 12,68% |
| Mar 20 | 2.584,59 | 2.974,28 | 3.136,72 | 2.191,86 | - | -12,51% |
| Fev 20 | 2.954,22 | 3.235,66 | 3.393,52 | 2.855,84 | - | -8,41% |
| Jan 20 | 3.225,52 | 3.244,67 | 3.337,77 | 3.214,64 | - | -0,16% |
| Dez 19 | 3.230,78 | 3.143,85 | 3.247,93 | 3.070,33 | - | 2,86% |
| Nov 19 | 3.140,98 | 3.050,72 | 3.154,26 | 3.050,72 | - | 3,40% |
| Alta: 4.544,58 | | Baixa: 2.191,86 | Diferença: 2.352,72 | Média: 3.583,78 | | Var%: 43,29 |

REFERENTE A TERÇA-FEIRA - 28 DE SETEMBRO 2021 - Nº 184

FECHAMENTO DO IBOVESPA: 110.123 -3,04%

DERIVATIVOS

CONTRATOS COM MINIS 42.029.042
CONTRATOS SEM MINIS 18.261.972

AÇÕES

VOLUME NEGOCIADO 36.260.592.313,34
QUANTIDADE DE NEGÓCIOS 4.533.999

DERIVATIVOS - MÉDIAS DIÁRIAS DE CONTRATOS NEGOCIADOS

| | TOTAL COM MINIS | TOTAL SEM MINIS |
|--------------------|-----------------|-----------------|
| DIA | 42.029.042 | 18.261.972 |
| MÊS | 52.896.756 | 29.556.099 |
| MÊS ANTERIOR | 51.561.103 | 27.481.321 |
| TRIMESTRE | 51.853.203 | 28.490.609 |
| TRIMESTRE ANTERIOR | 46.162.098 | 26.149.055 |
| SEMESTRE | 51.853.203 | 28.490.609 |
| SEMESTRE ANTERIOR | 51.699.045 | 30.894.413 |
| ANO | 51.750.431 | 30.093.145 |
| ANO ANTERIOR | 39.522.808 | 24.972.665 |

AÇÕES - MÉDIAS DIÁRIAS DE NEGOCIAÇÃO

| | VOLUME R\$ MILHÕES | NÚMERO DE NEGÓCIOS |
|--------------------|--------------------|--------------------|
| DIA | 36.260,59 | 4.533.999 |
| MES | 33.914,30 | 4.113.107 |
| MES ANTERIOR | 32.969,85 | 4.103.055 |
| TRIMESTRE | 31.643,72 | 3.887.706 |
| TRIMESTRE ANTERIOR | 33.594,94 | 3.841.743 |
| SEMESTRE | 31.643,72 | 3.887.706 |
| SEMESTRE ANTERIOR | 35.386,55 | 3.979.994 |
| ANO | 34.125,38 | 3.948.897 |
| ANO ANTERIOR | 29.716,83 | 3.572.869 |

SUMÁRIO

Evolução do Ibovespa.....2
Derivativos - Resumo das Operações.....3
Ações - Resumo das Operações.....5

INDICADORES E INFORMATIVOS

Indicadores econômicos.....6
Informações agropecuárias.....8
Evolução dos Índices.....11
Ações - Maiores Oscilações e Mais Negociadas.....15
Participação dos Investidores Informativos.....16

COTAÇÕES

Derivativos - Resumo Estatístico A1
A vista, termo e opções.....B1
After Market.....C1

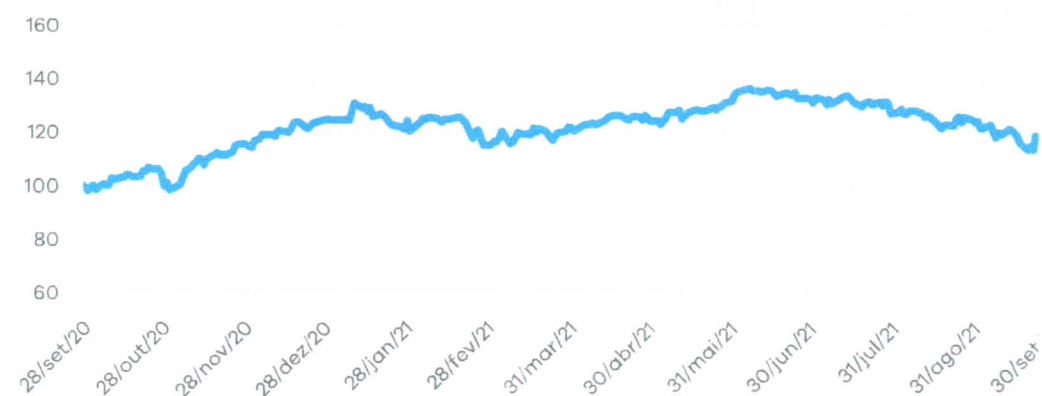
RENDA FIXA

Renda Fixa Privada.....D1
Tesouro Direto.....D3

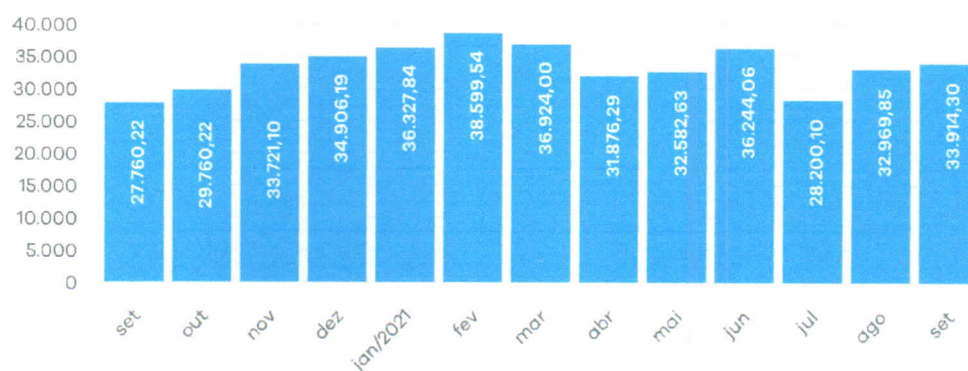
CLEARING

Câmbio.....D5
Quadro analítico das posições em aberto.....D7
Custódia.....D10
Banco de Títulos.....D13

IBOVESPA - EM UM ANO



MÉDIAS DIÁRIAS - VOLUME EM UM ANO R\$ MILHÕES



Evolução do Ibovespa

COMPORTAMENTO NO DIA

| | IBOVESPA | IBrX 50 |
|----------------------------------|----------|---------|
| | PONTOS | PONTOS |
| ABERTURA | 113.584 | 18.760 |
| MÍNIMO | 109.980 | 18.129 |
| MÁXIMO | 113.584 | 18.764 |
| FECHAMENTO | 110.123 | 18.139 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 111.161 | 18.329 |
| MÉDIA PONDERADA | 111.155 | 18.328 |
| ÍNDICE PARA LIQUIDAÇÃO | 110.440 | 18.204 |
| MINI IBOV ÍNDICE PARA LIQUIDAÇÃO | | 0 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | IBOVESPA | IBrX 50 |
|---------------|------------------|-----------------|
| | AÇÕES | AÇÕES |
| ALTAS | 4 | 2 |
| BAIXAS | 87 | 48 |
| ESTÁVEIS | - | - |
| SEM NEG. | - | - |
| TOTAL | 91 | 50 |
| MÁXIMO NO ANO | 130.776 - 07 JUN | 21.819 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 108.843 - 20 SET | 17.891 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | IBOVESPA | IBrX 50 |
|---------------|----------|---------|
| NO DIA | -3,04% | -3,30% |
| ONTEM | +0,27% | +0,48% |
| NA SEMANA | -2,79% | -2,84% |
| EM UMA SEMANA | -0,11% | +0,14% |
| NO MÊS | -7,29% | -8,42% |
| EM UM MÊS | -8,75% | -9,97% |
| NO ANO | -7,47% | -7,29% |
| EM UM ANO | +16,33% | +17,14% |

Evolução dos Índices

IFIX L B3

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 1.204 |
| MÍNIMO | 1.198 |
| MÁXIMO | 1.206 |
| FECHAMENTO | 1.199 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 1.201 |
| MÉDIA PONDERADA | 1.201 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 22 |
| BAIXAS | 40 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 62 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 1.288 - 05 FEV |
| MÍNIMO NO ANO | 1.193 - 19 AGO |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | -0,37% |
| ONTEM | +0,10% |
| NA SEMANA | -0,27% |
| EM UMA SEMANA | +0,04% |
| NO MÊS | -1,74% |
| EM UM MÊS | -0,97% |
| NO ANO | -6,29% |
| EM UM ANO | -3,03% |

IBRX100

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 48.482 |
| MÍNIMO | 46.921 |
| MÁXIMO | 48.482 |
| FECHAMENTO | 46.969 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 47.414 |
| MÉDIA PONDERADA | 47.405 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 5 |
| BAIXAS | 95 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 100 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 56.006 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 46.488 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,11% |
| ONTEM | +0,29% |
| NA SEMANA | -2,84% |
| EM UMA SEMANA | -0,26% |
| NO MÊS | -7,76% |
| EM UM MÊS | -9,30% |
| NO ANO | -6,77% |
| EM UM ANO | +16,76% |

IBRASIL

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.580 |
| MÍNIMO | 4.432 |
| MÁXIMO | 4.580 |
| FECHAMENTO | 4.437 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.478 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.477 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 9 |
| BAIXAS | 194 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 203 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 5.266 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 4.392 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,12% |
| ONTEM | +0,26% |
| NA SEMANA | -2,87% |
| EM UMA SEMANA | -0,29% |
| NO MÊS | -7,63% |
| EM UM MÊS | -9,36% |
| NO ANO | -5,69% |
| EM UM ANO | +18,06% |

ISE

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 3.950 |
| MÍNIMO | 3.865 |
| MÁXIMO | 3.950 |
| FECHAMENTO | 3.873 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 3.898 |
| MÉDIA PONDERADA | 3.898 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 4 |
| BAIXAS | 43 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 47 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 4.393 - 15 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 3.777 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | -1,97% |
| ONTEM | +0,33% |
| NA SEMANA | -1,65% |
| EM UMA SEMANA | +0,92% |
| NO MÊS | -3,58% |
| EM UM MÊS | -5,26% |
| NO ANO | -6,74% |
| EM UM ANO | +8,40% |

ICO2

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.282 |
| MÍNIMO | 2.212 |
| MÁXIMO | 2.282 |
| FECHAMENTO | 2.216 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.236 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.236 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 4 |
| BAIXAS | 57 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 61 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 2.655 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 2.201 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -2,88% |
| ONTEM | +0,10% |
| NA SEMANA | -2,78% |
| EM UMA SEMANA | -0,59% |
| NO MÊS | -6,51% |
| EM UM MÊS | -7,80% |
| NO ANO | -12,69% |
| EM UM ANO | +6,97% |

IEE

COMPORTAMENTO NO DIA

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 79.747 |
| MÍNIMO | 78.712 |
| MÁXIMO | 79.891 |
| FECHAMENTO | 78.845 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 79.243 |
| MÉDIA PONDERADA | 79.160 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 2 |
| BAIXAS | 16 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 18 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 85.292 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 72.997 - 08 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,32% |
| ONTEM | -0,20% |
| NA SEMANA | -1,52% |
| EM UMA SEMANA | -1,66% |
| NO MÊS | -1,38% |
| EM UM MÊS | -2,16% |
| NO ANO | -4,83% |
| EM UM ANO | +14,62% |

BDI**INDX****COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 25.881 |
| MÍNIMO | 25.221 |
| MÁXIMO | 25.881 |
| FECHAMENTO | 25.272 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 25.425 |
| MÉDIA PONDERADA | 25.426 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 4 |
| BAIXAS | 38 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 42 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 27.661 - 14 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 23.250 - 29 JAN |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -2,35% |
| ONTEM | +0,12% |
| NA SEMANA | -2,23% |
| EM UMA SEMANA | +1,72% |
| NO MÊS | -4,14% |
| EM UM MÊS | -5,49% |
| NO ANO | +8,05% |
| EM UM ANO | +31,06% |

ICONSUMO**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.835 |
| MÍNIMO | 4.661 |
| MÁXIMO | 4.835 |
| FECHAMENTO | 4.684 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.696 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.695 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 6 |
| BAIXAS | 71 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 77 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 5.665 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 4.684 - 28 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,12% |
| ONTEM | -1,02% |
| NA SEMANA | -4,11% |
| EM UMA SEMANA | -4,26% |
| NO MÊS | -6,45% |
| EM UM MÊS | -8,80% |
| NO ANO | -11,96% |
| EM UM ANO | -0,95% |

IMOBILIARIO**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 793 |
| MÍNIMO | 761 |
| MÁXIMO | 793 |
| FECHAMENTO | 762 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 768 |
| MÉDIA PONDERADA | 767 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | - |
| BAIXAS | 26 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 26 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 1.080 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 762 - 28 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,95% |
| ONTEM | -1,08% |
| NA SEMANA | -4,99% |
| EM UMA SEMANA | -7,04% |
| NO MÊS | -9,56% |
| EM UM MÊS | -11,75% |
| NO ANO | -27,54% |
| EM UM ANO | -13,20% |

IFINANCEIRO**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 10.751 |
| MÍNIMO | 10.367 |
| MÁXIMO | 10.800 |
| FECHAMENTO | 10.381 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 10.526 |
| MÉDIA PONDERADA | 10.530 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | - |
| BAIXAS | 22 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 22 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 12.911 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 10.235 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,44% |
| ONTEM | +1,20% |
| NA SEMANA | -2,29% |
| EM UMA SEMANA | +0,86% |
| NO MÊS | -9,29% |
| EM UM MÊS | -9,74% |
| NO ANO | -15,43% |
| EM UM ANO | +9,94% |

IMAT BASICOS**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 5.882 |
| MÍNIMO | 5.624 |
| MÁXIMO | 5.882 |
| FECHAMENTO | 5.638 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 5.707 |
| MÉDIA PONDERADA | 5.700 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | - |
| BAIXAS | 17 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 17 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 7.544 - 11 MAI |
| MÍNIMO NO ANO | 5.449 - 29 JAN |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -4,15% |
| ONTEM | +0,46% |
| NA SEMANA | -3,71% |
| EM UMA SEMANA | +1,28% |
| NO MÊS | -13,40% |
| EM UM MÊS | -14,83% |
| NO ANO | +3,69% |
| EM UM ANO | +39,60% |

UTILITIES**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 8.753 |
| MÍNIMO | 8.621 |
| MÁXIMO | 8.759 |
| FECHAMENTO | 8.634 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 8.684 |
| MÉDIA PONDERADA | 8.676 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 2 |
| BAIXAS | 23 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 25 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 9.220 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 7.631 - 08 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,35% |
| ONTEM | -0,04% |
| NA SEMANA | -1,39% |
| EM UMA SEMANA | -0,40% |
| NO MÊS | +0,71% |
| EM UM MÊS | -0,40% |
| NO ANO | -1,42% |
| EM UM ANO | +16,54% |

BDI**IVBX2****COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 15.684 |
| MÍNIMO | 15.139 |
| MÁXIMO | 15.684 |
| FECHAMENTO | 15.187 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 15.288 |
| MÉDIA PONDERADA | 15.277 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 3 |
| BAIXAS | 47 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 50 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 17.808 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 15.118 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,16% |
| ONTEM | -0,43% |
| NA SEMANA | -3,59% |
| EM UMA SEMANA | -0,78% |
| NO MÊS | -5,32% |
| EM UM MÊS | -6,59% |
| NO ANO | -5,06% |
| EM UM ANO | +10,74% |

IGC**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 18.694 |
| MÍNIMO | 18.070 |
| MÁXIMO | 18.694 |
| FECHAMENTO | 18.097 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 18.250 |
| MÉDIA PONDERADA | 18.243 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 12 |
| BAIXAS | 253 |
| ESTÁVEIS | 2 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 267 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 21.435 - 14 JUL |
| MÍNIMO NO ANO | 17.972 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,19% |
| ONTEM | +0,05% |
| NA SEMANA | -3,14% |
| EM UMA SEMANA | -0,78% |
| NO MÊS | -7,40% |
| EM UM MÊS | -9,25% |
| NO ANO | -5,36% |
| EM UM ANO | +16,58% |

IGC TRADE**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 5.161 |
| MÍNIMO | 4.994 |
| MÁXIMO | 5.161 |
| FECHAMENTO | 5.000 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 5.046 |
| MÉDIA PONDERADA | 5.045 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 9 |
| BAIXAS | 182 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 191 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 5.910 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 4.945 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,11% |
| ONTEM | +0,24% |
| NA SEMANA | -2,89% |
| EM UMA SEMANA | -0,26% |
| NO MÊS | -7,46% |
| EM UM MÊS | -9,24% |
| NO ANO | -5,73% |
| EM UM ANO | +17,52% |

IGNM**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 4.127 |
| MÍNIMO | 3.982 |
| MÁXIMO | 4.127 |
| FECHAMENTO | 3.990 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 4.017 |
| MÉDIA PONDERADA | 4.014 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 10 |
| BAIXAS | 182 |
| ESTÁVEIS | 1 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 193 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 4.793 - 14 JUL |
| MÍNIMO NO ANO | 3.990 - 28 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,32% |
| ONTEM | -0,41% |
| NA SEMANA | -3,72% |
| EM UMA SEMANA | -2,11% |
| NO MÊS | -7,00% |
| EM UM MÊS | -8,88% |
| NO ANO | -7,27% |
| EM UM ANO | +10,82% |

ITAG**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 25.516 |
| MÍNIMO | 24.685 |
| MÁXIMO | 25.516 |
| FECHAMENTO | 24.718 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 24.945 |
| MÉDIA PONDERADA | 24.940 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 13 |
| BAIXAS | 238 |
| ESTÁVEIS | 5 |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 256 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 29.272 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 24.454 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,13% |
| ONTEM | +0,25% |
| NA SEMANA | -2,89% |
| EM UMA SEMANA | -0,31% |
| NO MÊS | -7,70% |
| EM UM MÊS | -9,47% |
| NO ANO | -5,93% |
| EM UM ANO | +17,17% |

MIDLARGE CAP**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.216 |
| MÍNIMO | 2.145 |
| MÁXIMO | 2.216 |
| FECHAMENTO | 2.147 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.168 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.168 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 1 |
| BAIXAS | 71 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 72 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 2.546 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 2.122 - 20 SET |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,08% |
| ONTEM | +0,39% |
| NA SEMANA | -2,70% |
| EM UMA SEMANA | -0,03% |
| NO MÊS | -7,82% |
| EM UM MÊS | -9,47% |
| NO ANO | -5,74% |
| EM UM ANO | +18,45% |

BDI**SMALL CAP****COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.761 |
| MÍNIMO | 2.659 |
| MÁXIMO | 2.761 |
| FECHAMENTO | 2.666 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.684 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.682 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 8 |
| BAIXAS | 120 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 128 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 3.224 - 21 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 2.586 - 09 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -3,42% |
| ONTEM | -0,57% |
| NA SEMANA | -3,98% |
| EM UMA SEMANA | -2,04% |
| NO MÊS | -6,40% |
| EM UM MÊS | -8,58% |
| NO ANO | -5,51% |
| EM UM ANO | +15,73% |

I DIVIDENDOS**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 6.628 |
| MÍNIMO | 6.462 |
| MÁXIMO | 6.628 |
| FECHAMENTO | 6.472 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 6.527 |
| MÉDIA PONDERADA | 6.525 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 1 |
| BAIXAS | 44 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 45 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 7.362 - 07 JUN |
| MÍNIMO NO ANO | 6.039 - 01 MAR |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -2,35% |
| ONTEM | +0,75% |
| NA SEMANA | -1,62% |
| EM UMA SEMANA | +0,49% |
| NO MÊS | -4,43% |
| EM UM MÊS | -5,15% |
| NO ANO | -4,62% |
| EM UM ANO | +19,44% |

IFIX**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 2.711 |
| MÍNIMO | 2.698 |
| MÁXIMO | 2.716 |
| FECHAMENTO | 2.700 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 2.705 |
| MÉDIA PONDERADA | 2.704 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | 33 |
| BAIXAS | 70 |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 103 |

| | |
|---------------|----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 2.897 - 12 FEV |
| MÍNIMO NO ANO | 2.690 - 19 AGO |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|--------|
| NO DIA | -0,42% |
| ONTEM | +0,09% |
| NA SEMANA | -0,34% |
| EM UMA SEMANA | +0,04% |
| NO MÊS | -1,80% |
| EM UM MÊS | -1,13% |
| NO ANO | -5,92% |
| EM UM ANO | -2,94% |

BDRX**COMPORTAMENTO NO DIA**

| | PONTOS |
|------------------|--------|
| ABERTURA | 13.959 |
| MÍNIMO | 13.723 |
| MÁXIMO | 13.959 |
| FECHAMENTO | 13.723 |
| MÉDIA ARITMÉTICA | 13.782 |

COMPORTAMENTO DAS AÇÕES

| | AÇÕES |
|----------|-------|
| ALTAS | - |
| BAIXAS | - |
| ESTÁVEIS | - |
| SEM NEG. | - |
| TOTAL | 215 |

| | |
|---------------|-----------------|
| MÁXIMO NO ANO | 14.080 - 23 AÇO |
| MÍNIMO NO ANO | 11.601 - 04 JAN |

EVOLUÇÃO DOS FECHAMENTOS

| | |
|---------------|---------|
| NO DIA | -1,63% |
| ONTEM | +0,36% |
| NA SEMANA | -1,29% |
| EM UMA SEMANA | +1,79% |
| NO MÊS | +0,02% |
| EM UM MÊS | +0,23% |
| NO ANO | +19,25% |
| EM UM ANO | +22,77% |

Copom justifica ritmo de elevação da Selic, mas economistas alertam para persistência inflacionária e ciclo maior de altas

Mercado estima novas altas de um ponto da Selic nas próximas reuniões do Copom este ano



Por **Mariana Zonta d'Ávila**

28 set 2021 11h23 - Atualizado 17 horas atrás



(Crédito: Getty Images)

SÃO PAULO – O Banco Central divulgou nesta terça-feira (28) a **ata** da última reunião do Comitê de Política Monetária (Copom), que elevou a taxa Selic em um ponto percentual, para 6,25% ao ano.

Segundo o documento, a autoridade monetária ponderou subir os juros para além do ajuste de 1 ponto, mas chegou à conclusão de que o aumento era adequado para garantir a convergência da inflação para a meta definida pelo Conselho Monetário Nacional (CMN) em 2022, de 3,50%.

Na avaliação de economistas do mercado financeiro, o Copom reforçou cautela, mesmo adicionando que pretende levar a Selic para o patamar “significativamente” contracionista.

PUBLICIDADE

“Com uma série de incertezas no radar, tanto na atividade econômica, quanto na persistência dos choques na inflação, o Comitê justificou a alta da Selic não ser mais do que 100 pontos-base. Ao mesmo tempo, reafirmou que não haveria limite para a taxa básica de juros e que o foco será ainda o cumprimento da meta de 2022”, destaca João Leal, economista da Rio Bravo Investimentos.

Na avaliação dele, contudo, faltaram pontos no comunicado sobre o risco da persistência inflacionária, com alta de 7,02% do Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo – 15 (IPCA-15) no ano até setembro.

“É uma ameaça que tem ficado mais clara nos últimos indicadores divulgados e que pode representar um risco para as expectativas de inflação em 2022 e 2023”, diz.

Ainda segundo Leal, o tom do comunicado parece indicar que o mercado está mais preocupado com a inflação do que o BC – e isso pode representar um risco se não houver um controle nas expectativas. “Por ora, o cenário não muda, porque o Copom afirmou que levará a Selic para onde for necessário, mas o mercado pode testar o BC estressando ainda mais a curva de juros.”

Entre as novidades da ata divulgada nesta terça, Gustavo Cruz, estrategista da RB Investimentos, cita que o Banco Central deixou aberta uma porta para altas acima de 1 ponto, embora reforce que o pensamento hoje é de fazer mais altas de mesma magnitude.

“O BC não está olhando só para inflação, mas acha que 1 ponto é interessante para não penalizar tanto a atividade e o mercado de trabalho”, avalia.

PUBLICIDADE

Neste cenário, Cruz estima mais duas altas da Selic em 1 ponto percentual até o fim do ano. “Com esse texto de hoje, o BC deixou mais aberto para que, se as coisas até o final de outubro piorarem em termos de inflação, expectativas e riscos fiscais, ele pode fazer uma alta maior”, diz.

Rumos da Selic

Em relatório, a XP escreve que a mensagem da ata é de que o Copom está quase descartando uma futura aceleração do ritmo de aperto monetário e que pode começar a pensar em uma desaceleração a partir da reunião de dezembro.

“O Copom acrescentou que a Selic precisa atingir um nível ‘significativamente contracionista’. É difícil avaliar o que significa ‘significativamente’, mas, a nosso ver, é de 8,50% – que é a taxa esperada pela pesquisa Focus para dezembro deste ano

– ou um pouco mais, considerando o viés de alta do balanço de riscos”, escrevem os economistas.

Para a XP, a taxa Selic atinge 8,50% ao final do ciclo de aperto monetário. Segundo a casa, perspectivas fiscais continuam sendo o principal risco e uma nova expansão da política fiscal poderia exercer pressão adicional sobre o Copom.

Já o Goldman Sachs estima outro aumento de 1 ponto percentual da Selic na próxima reunião, em outubro, e uma subida constante e relativamente rápida para 8,25% ao ano, acima do neutro no final de 2021. O banco vê ainda uma taxa básica de juros de 8,75% no primeiro trimestre de 2022.

Na avaliação do Itaú BBA, a ata do Copom sugere que a autoridade monetária ainda está focada em garantir a convergência para a meta da inflação em 2022, mesmo que à custa de um aperto monetário adicional.

Neste cenário, o banco espera que o Copom mantenha o ritmo de 100 pontos-base até o final do ano, podendo continuar nesse ritmo até o primeiro trimestre de 2022. O Itaú projeta o fim do ciclo de aperto monetário com a Selic em 9%, mas com viés de alta.

Tom mais “dovish”

Para o Credit Suisse, a ata divulgada nesta manhã trouxe um tom mais “dovish”, isto é, uma postura mais favorável a taxas de juros mais baixas e menor preocupação com a inflação, ao indicar que manterá o ritmo de aperto monetário de um ponto percentual nos próximos encontros do Copom.

PUBLICIDADE

O banco destaca o discurso do BC de uma política monetária “significativamente contracionista” ser a estratégia adequada para garantir a convergência da inflação para as metas de 2022 e 2023.

“Isso poderia ser visto como um indicativo de taxas de juros mais elevadas do que o modelo atual, de Selic a 8,25%, em 2021 e a 8,5% em 2022, pois o balanço de risco para a inflação permanece negativo e as projeções do mercado e do Banco Central para a inflação em 2022, de 4,1% e 3,7%, respectivamente, são superiores à meta de 3,5%”, escreve o Credit Suisse, em relatório.

A expectativa do Credit Suisse é de que a autoridade monetária siga aumentando a Selic até 8,25%, em 2021, e até 9,75%, em 2022, com altas consecutivas de 100 pontos-base nas próximas três reuniões e, em seguida, uma alta final de 50 pontos-base. Isso acontece porque o banco projeta uma inflação acima da mediana do mercado, de 8,7%, para 2021, e de 5,2%, para o próximo ano.

“Apesar disso, vemos os riscos de alta para as taxas nominais, dado que o processo desinflacionário no país tem sido muito difícil e nosso cenário atual para as taxas reais pode não ser suficiente para reduzir o nível de inflação em direção à meta em 2023”, escrevem os economistas.

arrow_forward Mais sobre

[Economia](#)

[Banco Central](#)

[Copom](#)

[Inflação](#)

[Juros](#)

[Selic](#)

Ibovespa fecha no 2º pior nível do ano em queda de 3%; dólar sobe a R\$ 5,42

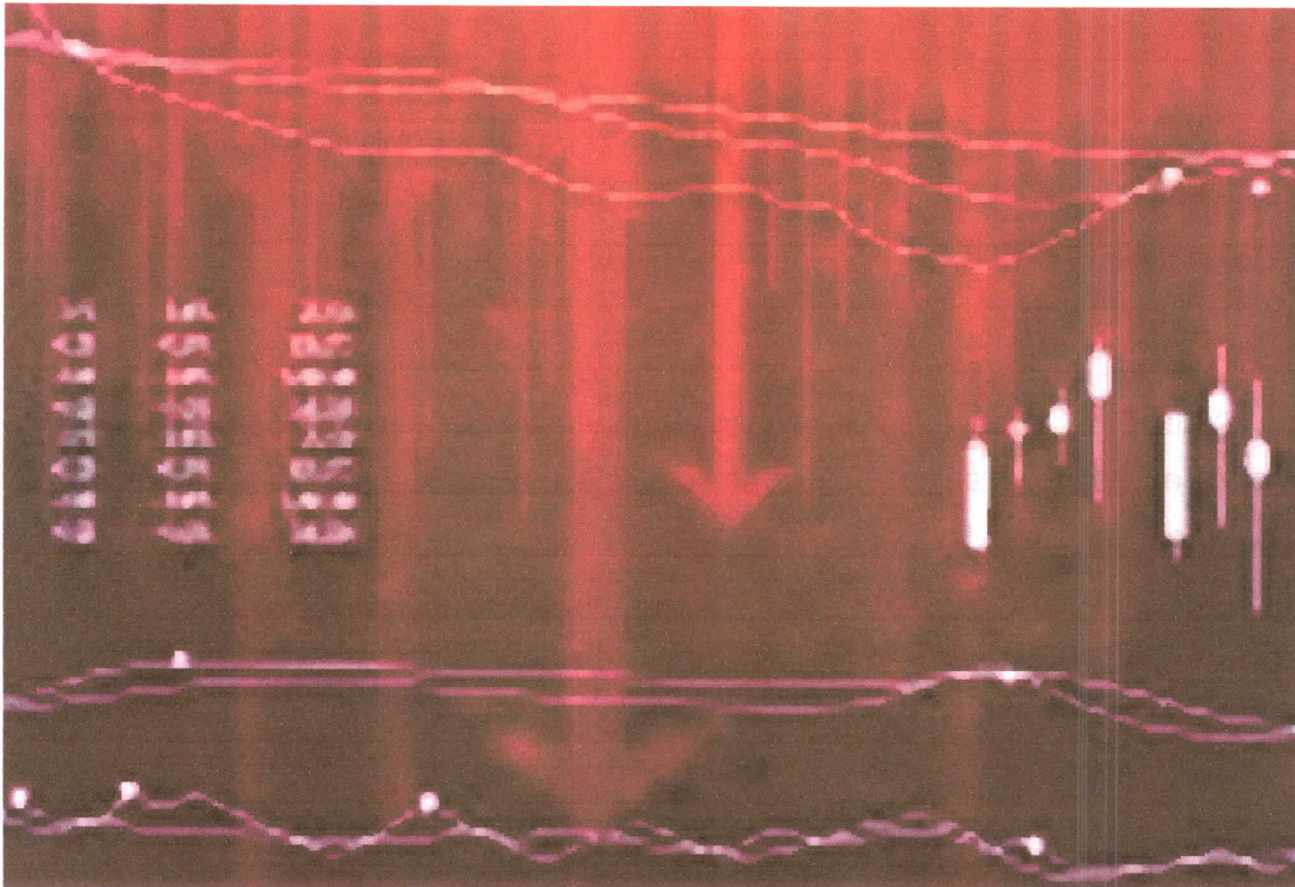
Mercado tem sessão de muito pessimismo com soma de fatores externos e internos como alta dos juros dos treasuries e falas de Lira sobre combustíveis



Por **Ricardo Bomfim**

28 set 2021 17h36

lylqer ● ● ● ● ● ●



SÃO PAULO – O **Ibovespa** fechou em forte queda na sessão desta terça-feira (28), encerrando o dia em seu segundo pior nível de fechamento do ano pressionado pelo dia bastante negativo em Wall Street. Os índices Dow Jones, S&P 500 e Nasdaq encerraram o dia com perdas entre 1,6% e 2,9%.

As ações que mais contribuíram para o desempenho negativo aqui foram Vale (**VALE3**), que caiu 5%, e bancos. Esses papéis empurraram o índice para baixo junto com questões como a pressão sobre a Petrobras (**PETR3**; **PETR4**) por conta dos preços de combustíveis. As ações da estatal recuaram perto de 0,7%.

Segundo Roberto Attuch, CEO da Ohmresearch, o desempenho fortemente negativo da Bolsa hoje se deveu a uma série de fatores, que vão do ambiente ruim na Europa, com o aumento dos preços do gás natural, à possibilidade de paralisação do governo americano e a continuidade dos ruídos vindos de Brasília.

PUBLICIDADE

“Os estoques de gás europeus estão baixos, algumas energias renováveis tiveram problema este ano, e o fato é que vários governos como de Itália, Espanha e Grécia anunciaram que darão subsídio ao consumidor na conta de gás”, explica o economista.

Em relação à Vale, o papel reagiu às preocupações com a oferta de energia da China conforme as restrições ao uso do carvão no país começam a impactar indústrias como a siderúrgica. Importante lembrar que diversas empresas reduziram suas projeções para o Produto Interno Bruto (PIB) da China. Na segunda, o Goldman Sachs cortou sua expectativa sobre o crescimento do PIB do país de 8,2% para 7,8%. O Nomura reduziu sua previsão de 8,2% para 7,7%.

Hoje foi um dia negativo também em Wall Street, onde os índices Dow Jones, S&P 500 e Nasdaq recuaram na esteira do aumento nos rendimentos dos títulos do Tesouro americano de 10 anos, que chegaram a 1,558% saindo de 1,482%. As apostas são de que o banco central americano realmente irá cortar seu programa mensal de estímulos.

Também no radar, o petróleo virou para queda após o barril do Brent bater brevemente os US\$ 80 durante a sessão em meio a preocupações com a oferta devido aos furacões Ida e Nicholas, e com possibilidade cada vez maior de uma **crise global de energia**.

Houve atenção ainda para discursos de Janet Yellen, secretária do Tesouro dos EUA, e de Jerome Powell, presidente do Federal Reserve, no Senado americano. Powell disse que a economia dos EUA está longe de alcançar o pleno emprego, e que este é um componente importante dos critérios para elevar as taxas de juros.

Já Yellen avisou a parlamentares que o governo pode ficar sem dinheiro até 18 de outubro a menos que o Congresso aja para elevar o teto da dívida federal.

PUBLICIDADE

Os EUA passam por um risco de paralisação do governo se um novo orçamento não for aprovado até quinta-feira, quando deve ser votado na Câmara o projeto de US\$ 1 trilhão em investimentos em infraestrutura proposto pelo presidente Joe Biden e já aprovado no Senado.

Por aqui, os investidores repercutiram a pressão sobre a Petrobras devido aos preços de combustíveis. Depois de 85 dias a estatal **aumentou o valor do diesel** nas refinarias de R\$ 2,81 para R\$ 3,06 por litro, refletindo reajuste médio de R\$ 0,25 por litro, ou uma alta de 8,90%.

Arthur Lira (PP-AL), presidente da Câmara dos Deputados, afirmou que os deputados buscarão alternativas para evitar novos reajustes em combustíveis e no gás de cozinha. O tema será discutido na reunião do Colégio de Líderes prevista para a próxima quinta-feira. Segundo Lira, o Brasil não pode tolerar gasolina a quase R\$ 7 e o gás a R\$ 120.

Mais tarde, ele afirmou que o **Congresso vai discutir um projeto sobre um valor fixo para o ICMS dos combustíveis** como forma de buscar uma redução do preço do insumo. Em evento em Alagoas, Lira repetiu argumento do presidente Jair Bolsonaro, que também estava presente, ao afirmar que o imposto estadual é o responsável pelo preço caro dos combustíveis.

Para Attuch, há pouco risco de mudança na política de preços da Petrobras, uma vez que o estatuto é bem diferente do que era em gestões passadas e os conselheiros poderiam ir embora se houver intervenção do Estado. No entanto, ele acredita que é mais um ruído para prejudicar o ambiente de investimentos.

“A soma de tudo isso obriga no Brasil o investidor a estar diversificado interna e internacionalmente”, sentencia.

Outro fator que impactou o mercado hoje foi a **ata da última reunião do Comitê de Política Monetária (Copom)**, segundo a qual o Banco Central ponderou subir os juros para além do ajuste de 1 ponto que acabou adotando, mas chegou à conclusão que a dose era adequada.

De acordo com Gustavo Cruz, estrategista da RB, a novidade do documento é deixar o cenário um pouco mais aberto para elevações da Selic em mais de um ponto. Para ele, quando a ata diz que “essa decisão também implica suavização das flutuações do nível de atividade econômica e fomento do pleno emprego” o BC mostra que não está olhando só para a inflação, mas também para como não penalizar tanto a atividade e o mercado de trabalho.

“Entendo que ele faça duas altas de 1 ponto até o final do ano. Porém, com esse texto de hoje ele deixou mais aberto para que se as coisas até exatamente daqui um mês, no final de outubro, piorarem bastante em termos de inflação, expectativas e riscos fiscais, ele possa fazer uma alta maior”, avalia.

Depois do fechamento, o ministro da Economia, Paulo Guedes, participa de dois eventos, e às 14h30 (horário de Brasília) sai o resultado consolidado do governo central.

O Ibovespa teve queda de 3,05%, a 110.123 pontos com volume financeiro negociado de R\$ 36,134 bilhões. Foi a maior baixa do índice em um único dia desde 8 de setembro, quando o benchmark despencou 3,78% na esteira dos atos pró-governo do dia 7.

Também foi o segundo pior patamar de fechamento do Ibovespa no ano, atrás apenas do dia 20 de setembro, quando a Bolsa encerrou a sessão cotada a 108.844 pontos.

Enquanto isso, o dólar comercial subiu 0,85% a R\$ 5,424 na compra e a R\$ 5,424 na venda. Já o dólar futuro com vencimento em outubro registra ganhos de 0,66% a R\$ 5,432 no *after-market*.

No mercado de juros futuros, o DI para janeiro de 2022 subiu três pontos-base a 7,18%, DI para janeiro de 2023 teve alta de nove pontos-base a 9,17%, DI para janeiro de 2025 avançou 12 pontos-base a 10,29% e DI para janeiro de 2027 registrou variação positiva de 10 pontos-base a 10,68%.

Os mercados europeus também refletiram as incertezas em relação às eleições na Alemanha, após a votação no domingo. O Partido Social Democrata (SPD na sigla em alemão) obteve a maior parcela dos votos, 25,7%, enquanto que o bloco de

tendências de direita de Angela Merkel, formado por União Democrática Cristã e União Social Cristã, obteve 24,1% dos votos.

Agora, é provável que as negociações entre esses dois grandes partidos e dois partidos menores, o Verde e os Democratas Livres, levem semanas, ou mesmo meses.

PUBLICIDADE

Anteriormente, o SPD rejeitou a possibilidade de formar uma nova grande coalizão com o bloco de direita. Ambos os partidos afirmam que ganharam as eleições, após os resultados.

arrow_forward Mais sobre

[Mercados](#)

[Ações](#)

[China](#)

[Combustíveis](#)

[Dólar](#)

[Ibovespa](#)

[Treasuries](#)