

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

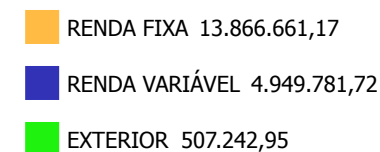
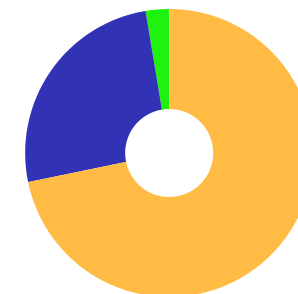
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	860.349,97	4,45%	1.014	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.010.836,83	5,23%	770	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	32.856,13	0,17%	1.140	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.634.487,62	13,63%	964	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.072.063,24	5,55%	1.057	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	757.149,89	3,92%	1.013	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.582.557,72	8,19%	863	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	829.357,39	4,29%	1.264	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	19.633,22	0,10%	66	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	373.201,69	1,93%	800	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.106.784,06	5,73%	193	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	181.972,01	0,94%	215	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	147.576,95	0,76%	173	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.290.820,70	6,68%	143	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	124.364,06	0,64%	305	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	758.732,02	3,93%	697	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	714.305,32	3,70%	249	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	369.612,35	1,91%	136	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	296.648,14	1,54%	906	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	116.437,69	0,60%	27.215	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	238.140,42	1,23%	174	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.460.552,80	7,56%	2.256	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	174.135,52	0,90%	4.416	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	350.658,35	1,81%	36.305	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	449.368,03	2,33%	111	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	184.853,01	0,96%	18.293	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	D+4	Não há	49.177,01	0,25%	1.049	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	504.942,48	2,61%	16.031	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	D+15	Não há	40.686,23	0,21%	7.807	0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.036.153,23	5,36%	15.340	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	48.028,81	0,25%	137	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	43.640,65	0,23%	24.127	0,00%	Artigo 9º - A, Inciso III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	44.061,63	0,23%	51	0,04%	Artigo 9º - A, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	419.540,67	2,17%	494	0,01%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			19.323.685,84				

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

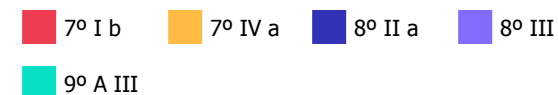
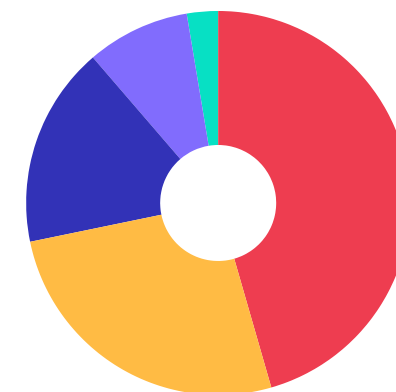
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	8.799.292,01	45,54%	11,51%	51,54%	71,92%	5.098.302,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	5.067.369,16	26,22%	4,06%	20,32%	40,00%	2.662.105,18
Total Renda Fixa	100,00%	13.866.661,17	71,76%	15,57%	71,86%	111,92%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	3.270.793,96	16,93%	3,69%	18,45%	20,00%	593.943,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.678.987,76	8,69%	3,07%	9,07%	10,00%	253.380,82
Total Renda Variável	30,00%	4.949.781,72	25,62%	6,76%	27,52%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	966.184,29
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	507.242,95	2,62%	0,00%	0,31%	5,00%	458.941,34
Total Exterior	10,00%	507.242,95	2,62%	0,00%	0,62%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.833.120,52	66,41	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.733.971,10	14,15	0,00
ITAÚ UNIBANCO	2.088.430,28	10,81	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.620.135,13	8,38	0,00
MULTINVEST CAPITAL	48.028,81	0,25	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	8.799.292,01	45,54	11,51	71,92
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.067.369,16	26,22	4,06	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	3.270.793,96	16,93	18,45	20,00
Artigo 8º, Inciso III	1.678.987,76	8,69	3,07	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	507.242,95	2,62	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	2,79%	1,21%	2,82%	5,92%	13,71%	0,78%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	1,53%	0,87%	1,48%	2,16%	6,42%	0,30%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38%	1,59%	0,89%	1,54%	2,25%	6,68%	0,29%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	2,30%	1,13%	2,53%	5,69%	13,00%	0,81%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,98%	2,29%	1,11%	2,49%	5,70%	13,04%	0,82%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	-2,51%	-1,69%	0,37%	4,45%	6,20%	2,16%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	-0,33%	-2,95%	-1,39%	-0,15%	-1,02%	5,48%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,40%	1,69%	0,91%	1,59%	2,35%	6,63%	0,29%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	2,28%	1,19%	1,90%	2,87%	6,32%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,35%	1,66%	0,90%	1,43%	1,88%	4,33%	0,01%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,26%	3,73%	2,68%	3,59%	4,53%	-	0,45%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,84%	2,32%	1,30%	1,98%	2,72%	6,51%	0,54%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36%	-1,16%	-1,87%	-0,98%	0,86%	7,32%	0,48%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,15%	-1,65%	-0,86%	0,43%	1,30%	4,80%	1,07%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,49%	-0,81%	-1,52%	-0,70%	0,74%	-	0,22%	0,02%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,71%	0,85%	-0,36%	1,20%	4,05%	11,07%	1,20%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,33%	1,77%	0,91%	1,49%	2,04%	4,77%	0,01%	0,00%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,44%	2,42%	1,24%	1,99%	2,77%	5,85%	0,02%	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	2,74%	1,30%	2,74%	6,05%	13,77%	0,73%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	-4,48%	-4,67%	-6,59%	-1,51%	19,58%	7,85%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,58%	-7,47%	-9,12%	-2,23%	15,77%	1,62%	11,60%	0,24%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,98%	-3,26%	-8,58%	-1,61%	23,96%	25,09%	11,83%	0,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,10%	-3,73%	-12,45%	0,03%	13,48%	-13,14%	12,57%	0,22%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-8,29%	-9,84%	-14,73%	-4,60%	8,76%	-5,07%	12,42%	0,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,52%	-0,57%	-11,40%	-1,65%	19,26%	6,71%	10,48%	0,18%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	-7,43%	-8,95%	-12,56%	-3,97%	10,25%	6,65%	12,11%	0,20%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	0,59%	-2,45%	-0,11%	4,85%	8,05%	1,80%	0,04%
CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,76%	1,49%	-1,84%	0,07%	5,67%	-	2,44%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-7,05%	-8,20%	-14,12%	-5,86%	14,97%	0,89%	12,29%	0,23%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,58%	-0,73%	-2,95%	-0,57%	5,51%	6,44%	3,62%	0,06%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,52%	-5,72%	-12,57%	-3,53%	12,03%	9,28%	10,75%	0,19%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

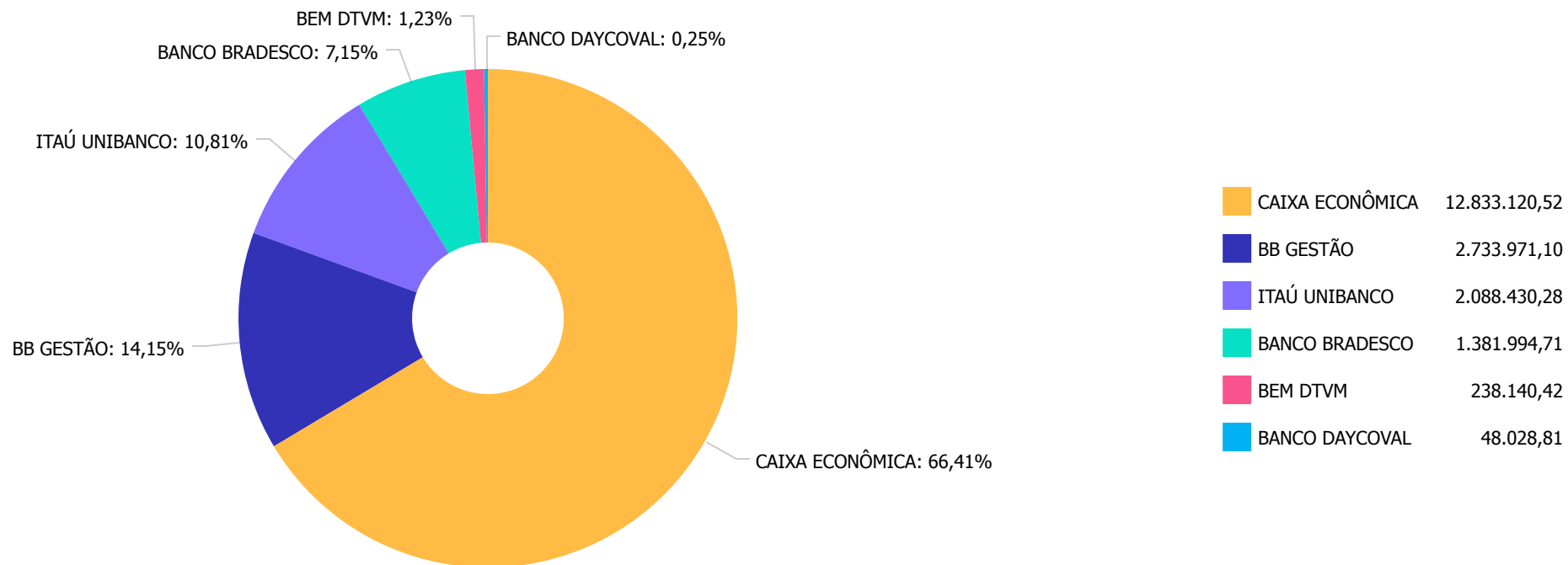
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	-4,70%	16,72%	0,92%	9,55%	30,02%	42,82%	6,12%	0,13%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	-1,53%	-2,56%	-4,16%	-1,76%	1,27%	-0,35%	2,42%	0,05%

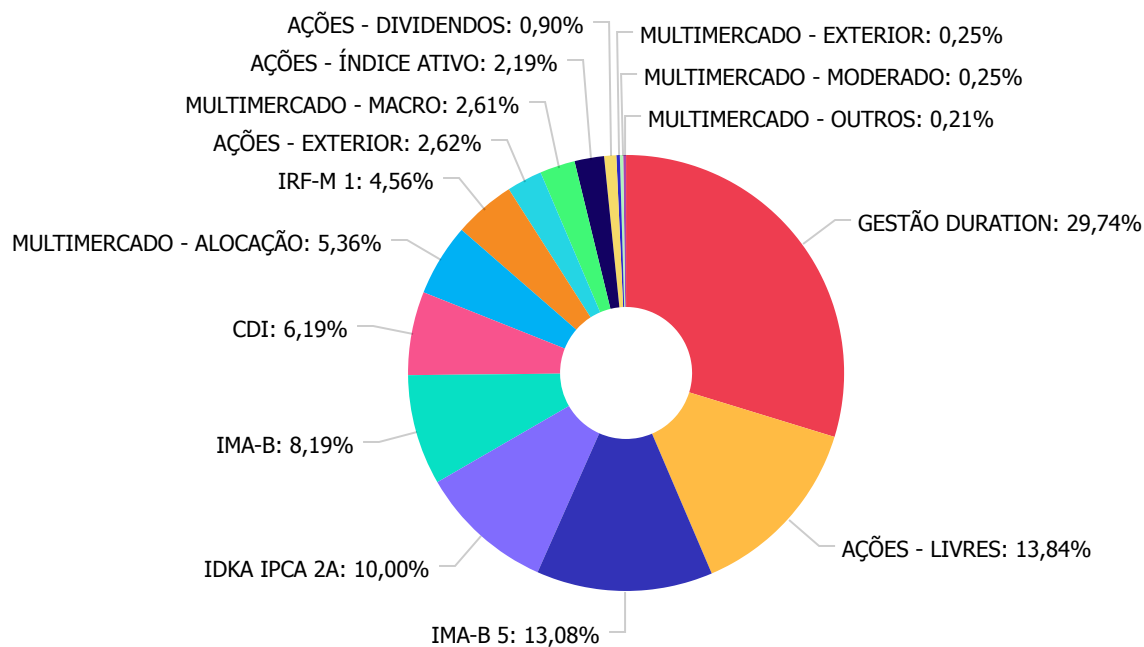
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,62%	17,77%	9,07%	3,96%	18,60%	85,75%	6,92%	0,10%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,71%	19,77%	9,62%	4,52%	20,74%	89,36%	6,78%	0,11%

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



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

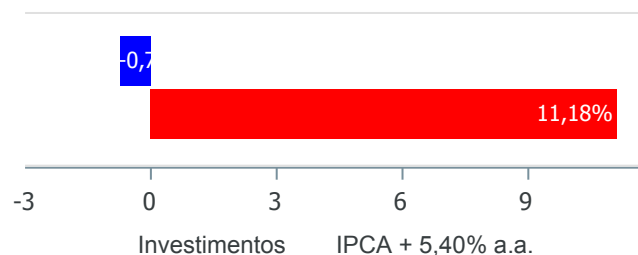


GESTÃO DURATION	5.746.397,70
AÇÕES - LIVRES	2.673.665,01
IMA-B 5	2.526.718,74
IDKA IPCA 2A	1.932.413,21
IMA-B	1.582.557,72
CDI	1.196.727,06
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.036.153,23
IRF-M 1	881.846,74
AÇÕES - EXTERIOR	507.242,95
MULTIMERCADO - MACRO	504.942,48
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	422.993,43
AÇÕES - DIVIDENDOS	174.135,52
MULTIMERCADO - EXTERIOR	49.177,01
MULTIMERCADO - MODERADO	48.028,81
MULTIMERCADO - OUTROS	40.686,23

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

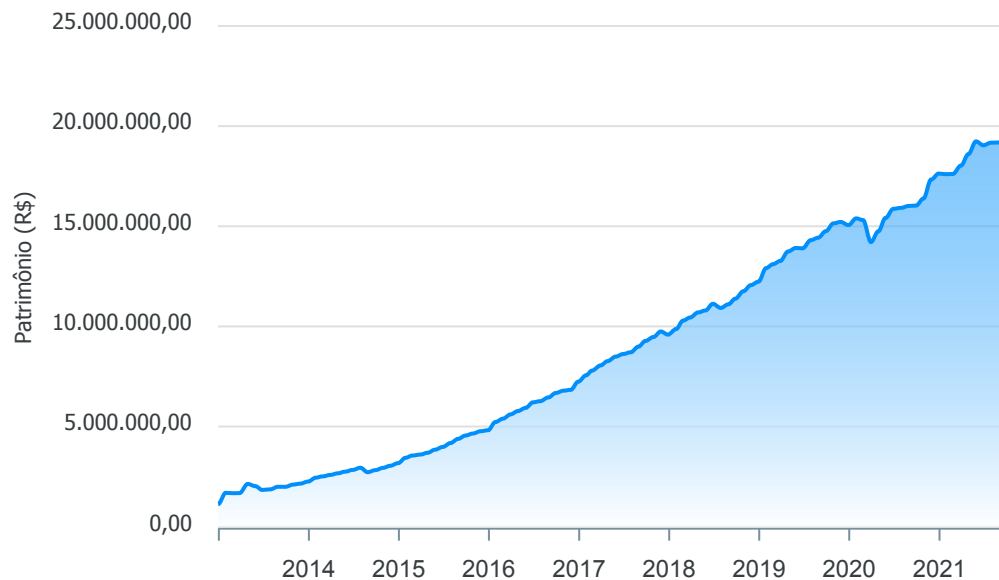
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	17.631.536,64	331.293,75	236.873,60	17.599.214,68	-126.742,11	-126.742,11	-0,72%	-0,72%	0,67%	0,67%	-106,83%	3,40%
Fevereiro	17.599.214,68	451.983,09	250.000,00	17.610.770,99	-190.426,78	-317.168,89	-1,07%	-1,78%	1,24%	1,92%	-92,69%	3,12%
Março	17.610.770,99	402.450,71	133.048,96	18.028.404,82	148.232,08	-168.936,81	0,83%	-0,96%	1,42%	3,36%	-28,65%	3,53%
Abril	18.028.404,82	599.224,46	234.676,41	18.600.853,00	207.900,13	38.963,32	1,13%	0,16%	0,73%	4,11%	3,81%	1,94%
Mai	18.600.853,00	511.700,30	181.914,63	19.239.249,15	308.610,48	347.573,80	1,63%	1,79%	1,27%	5,44%	32,90%	2,43%
Junho	19.239.249,15	593.521,41	845.058,13	19.044.019,99	56.307,56	403.881,36	0,29%	2,09%	0,97%	6,46%	32,29%	1,93%
Julho	19.044.019,99	444.302,18	129.522,43	19.172.460,89	-186.338,85	217.542,51	-0,96%	1,10%	1,42%	7,98%	13,84%	2,71%
Agosto	19.172.460,89	294.136,85	106.053,63	19.183.319,29	-177.224,82	40.317,69	-0,92%	0,18%	1,33%	9,42%	1,90%	2,98%
Setembro	19.183.319,29	512.926,85	197.026,74	19.323.685,84	-175.533,56	-135.215,87	-0,90%	-0,72%	1,60%	11,18%	-6,47%	2,93%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

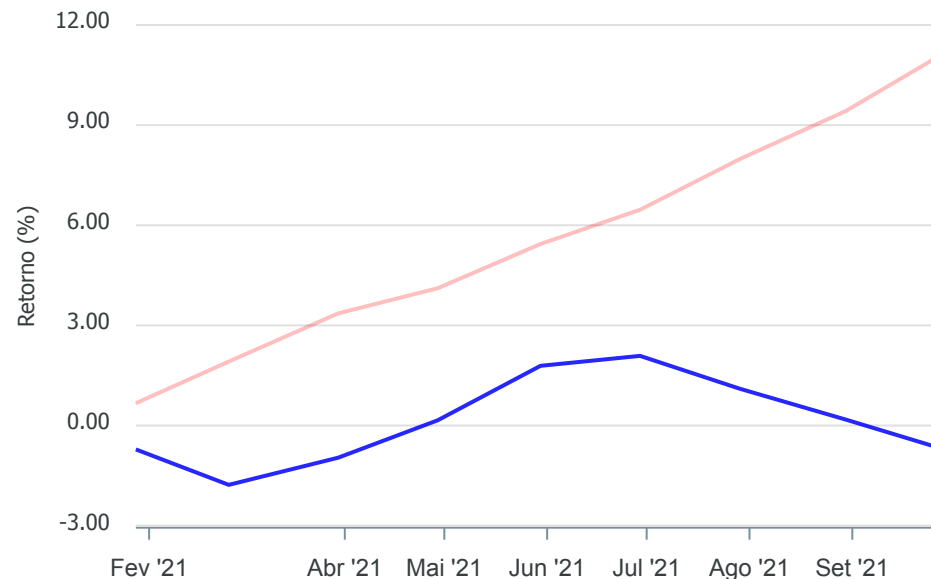


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	365.024,43	0,00	0,00	369.612,35	4.587,92	1,26%	1,26%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.060.626,35	0,00	0,00	1.072.063,24	11.436,89	1,08%	1,08%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	851.549,66	0,00	0,00	860.349,97	8.800,31	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	749.793,91	0,00	0,00	757.149,89	7.355,98	0,98%	0,98%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.001.050,71	0,00	0,00	1.010.836,83	9.786,12	0,98%	0,98%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	708.376,76	0,00	0,00	714.305,32	5.928,56	0,84%	0,84%	0,54%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	753.358,01	0,00	0,00	758.732,02	5.374,01	0,71%	0,71%	1,20%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.275.293,32	9.196,48	0,00	1.290.820,70	6.330,90	0,49%	0,49%	0,22%
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	181.168,07	0,00	0,00	181.972,01	803,94	0,44%	0,44%	0,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	146.962,29	0,00	0,00	147.576,95	614,66	0,42%	0,42%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	19.555,55	0,00	0,00	19.633,22	77,67	0,40%	0,40%	0,29%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	826.232,59	0,00	0,00	829.357,39	3.124,80	0,38%	0,38%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	32.736,21	0,00	0,00	32.856,13	119,92	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.625.169,48	0,00	0,00	2.634.487,62	9.318,14	0,35%	0,35%	0,48%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	279.317,96	92.661,21	0,00	373.201,69	1.222,52	0,33%	0,35%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	64.988,12	156.100,71	97.026,74	124.364,06	301,97	0,14%	0,33%	0,01%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.108.491,06	0,00	0,00	1.106.784,06	-1.707,00	-0,15%	-0,15%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.585.026,81	0,00	0,00	1.582.557,72	-2.469,09	-0,16%	-0,16%	2,16%
Total Renda Fixa	13.634.721,29	257.958,40	97.026,74	13.866.661,17	71.008,22	0,51%		0,78%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2021**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	508.705,85	0,00	0,00	504.942,48	-3.763,37	-0,74%	-0,74%	1,80%
CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	41.008,90	0,00	0,00	40.686,23	-322,67	-0,79%	-0,76%	2,44%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	48.776,35	0,00	0,00	48.028,81	-747,54	-1,53%	-1,53%	2,42%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.052.757,40	0,00	0,00	1.036.153,23	-16.604,17	-1,58%	-1,58%	3,62%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	121.266,55	0,00	0,00	116.437,69	-4.828,86	-3,98%	-3,98%	11,83%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	182.483,78	0,00	0,00	174.135,52	-8.348,26	-4,57%	-4,57%	11,60%
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	51.602,90	0,00	0,00	49.177,01	-2.425,89	-4,70%	-4,70%	6,12%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.647.720,53	0,00	100.000,00	1.460.552,80	-87.167,73	-5,29%	-5,52%	10,75%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	375.123,04	0,00	0,00	350.658,35	-24.464,69	-6,52%	-6,52%	10,48%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	319.155,10	0,00	0,00	296.648,14	-22.506,96	-7,05%	-7,05%	12,29%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	199.682,37	0,00	0,00	184.853,01	-14.829,36	-7,43%	-7,43%	12,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	488.954,20	0,00	0,00	449.368,03	-39.586,17	-8,10%	-8,10%	12,57%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	259.652,14	0,00	0,00	238.140,42	-21.511,72	-8,28%	-8,28%	12,42%
Total Renda Variável	5.296.889,11	0,00	100.000,00	4.949.781,72	-247.107,39	-4,67%		8,57%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Setembro / 2021)**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	43.750,06	0,00	0,00	44.061,63	311,57	0,71%	0,71%	6,78%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	43.371,52	0,00	0,00	43.640,65	269,13	0,62%	0,62%	6,92%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	164.587,31	254.968,45	0,00	419.540,67	-15,09	0,00%	-0,25%	6,75%
Total Exterior	251.708,89	254.968,45	0,00	507.242,95	565,61	0,11%		6,77%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.059.257,15	0,00	0,00	1.072.063,24	12.806,09	1,21%	1,21%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	999.788,96	0,00	0,00	1.010.836,83	11.047,87	1,11%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	849.323,79	0,00	0,00	860.349,97	11.026,18	1,30%	1,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	359.982,75	0,00	0,00	369.612,35	9.629,60	2,68%	2,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	705.112,94	0,00	0,00	714.305,32	9.192,38	1,30%	1,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	748.687,65	0,00	0,00	757.149,89	8.462,24	1,13%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	822.033,37	0,00	0,00	829.357,39	7.324,02	0,89%	0,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	92.823,12	277.983,63	0,00	373.201,69	2.394,94	0,65%	0,90%
BRANCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	179.746,52	0,00	0,00	181.972,01	2.225,49	1,24%	1,24%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	145.848,72	0,00	0,00	147.576,95	1.728,23	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	96.366,96	358.773,55	331.602,80	124.364,06	826,35	0,18%	0,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	32.573,56	0,00	0,00	32.856,13	282,57	0,87%	0,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.022,65	19.439,61	1.000,00	19.633,22	170,96	0,84%	0,91%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	761.453,84	0,00	0,00	758.732,02	-2.721,82	-0,36%	-0,36%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.116.337,65	0,00	0,00	1.106.784,06	-9.553,59	-0,86%	-0,86%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.184.509,84	124.488,27	0,00	1.290.820,70	-18.177,41	-1,39%	-1,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.609.674,67	0,00	0,00	1.582.557,72	-27.116,95	-1,68%	-1,68%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.684.605,61	0,00	0,00	2.634.487,62	-50.117,99	-1,87%	-1,87%
				Total Renda Fixa	-30.570,84	-0,22%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	41.459,81	0,00	0,00	40.686,23	-773,58	-1,87%	-1,84%
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	0,00	50.000,00	0,00	49.177,01	-822,99	-1,65%	0,92%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	0,00	50.000,00	0,00	48.028,81	-1.971,19	-3,94%	-4,16%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	127.358,54	0,00	0,00	116.437,69	-10.920,85	-8,57%	-8,57%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	517.627,77	0,00	0,00	504.942,48	-12.685,29	-2,45%	-2,45%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	191.599,30	0,00	0,00	174.135,52	-17.463,78	-9,11%	-9,11%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	211.393,07	0,00	0,00	184.853,01	-26.540,06	-12,55%	-12,55%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.067.629,42	0,00	0,00	1.036.153,23	-31.476,19	-2,95%	-2,95%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	279.283,62	0,00	0,00	238.140,42	-41.143,20	-14,73%	-14,73%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	395.756,82	0,00	0,00	350.658,35	-45.098,47	-11,40%	-11,40%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	345.419,95	0,00	0,00	296.648,14	-48.771,81	-14,12%	-14,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	513.257,91	0,00	0,00	449.368,03	-63.889,88	-12,45%	-12,45%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.780.516,94	0,00	100.000,00	1.460.552,80	-219.964,14	-12,35%	-12,57%
				Total Renda Variável	-521.521,43	-9,36%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

