

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2021

**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)**

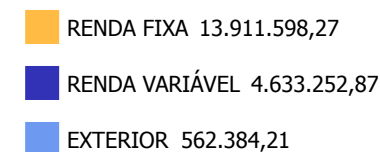
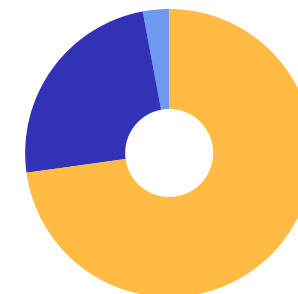
| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência | Saldo        | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922                  |
|---|---------|----------|--------------|--------------------|----------|------------------|------------------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1     | Não há   | 849.571,86   | 4,45%              | 1.026    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1     | Não há   | 997.951,08   | 5,22%              | 778      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0     | Não há   | 32.685,69    | 0,17%              | 1.136    | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | D+0     | Não há   | 2.617.067,60 | 13,70%             | 959      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0     | Não há   | 1.058.209,48 | 5,54%              | 1.062    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há   | 747.730,64   | 3,91%              | 1.018    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0     | Não há   | 1.542.018,32 | 8,07%              | 853      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há   | 824.914,80   | 4,32%              | 1.252    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| ITAU INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA            | D+0     | Não há   | 19.512,15    | 0,10%              | 63       | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO      | D+0     | Não há   | 437.263,99   | 2,29%              | 810      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA           | D+4     | Não há   | 1.098.864,48 | 5,75%              | 195      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA           | D+0     | Não há   | 182.850,86   | 0,96%              | 212      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA        | D+0     | Não há   | 148.259,64   | 0,78%              | 174      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                | D+1     | Não há   | 1.291.583,81 | 6,76%              | 139      | 0,14%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA        | D+0     | Não há   | 63.319,62    | 0,33%              | 306      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA... | D+3     | Não há   | 747.508,13   | 3,91%              | 664      | 0,18%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1     | Não há   | 711.767,40   | 3,73%              | 249      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX... | D+1     | Não há   | 540.518,72   | 2,83%              | 137      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                          | D+4     | Não há   | 276.747,69   | 1,45%              | 888      | 0,06%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                           | D+3     | Não há   | 110.589,70   | 0,58%              | 27.718   | 0,01%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |

**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 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   | 217.619,93           | 1,14%              | 172      | 0,04%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                  | D+25    | Não há   | 1.312.594,17         | 6,87%              | 2.182    | 0,15%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                          | D+4     | Não há   | 166.687,05           | 0,87%              | 4.286    | 0,06%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                             | D+24    | Não há   | 324.231,05           | 1,70%              | 35.951   | 0,01%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES               | D+24    | Não há   | 396.415,10           | 2,07%              | 111      | 0,05%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES                              | D+3     | Não há   | 166.387,83           | 0,87%              | 17.465   | 0,02%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO              | D+4     | Não há   | 52.901,55            | 0,28%              | 1.037    | 0,02%            | Artigo 8º, Inciso III            |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP           | D+4     | Não há   | 500.452,41           | 2,62%              | 15.334   | 0,01%            | Artigo 8º, Inciso III            |
| CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP         | D+15    | Não há   | 40.168,62            | 0,21%              | 7.498    | 0,00%            | Artigo 8º, Inciso III            |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP                     | D+4     | Não há   | 1.020.903,74         | 5,34%              | 14.545   | 0,06%            | Artigo 8º, Inciso III            |
| MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO                 | D+11    | Não há   | 47.554,03            | 0,25%              | 146      | 0,12%            | Artigo 8º, Inciso III            |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I         | D+5     | Não há   | 48.250,49            | 0,25%              | 24.466   | 0,00%            | Artigo 9º - A, Inciso III        |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I        | D+5     | Não há   | 48.742,10            | 0,26%              | 54       | 0,04%            | Artigo 9º - A, Inciso III        |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I           | D+4     | Não há   | 465.391,62           | 2,44%              | 509      | 0,01%            | Artigo 9º - A, Inciso III        |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b> |         |          | <b>19.107.235,35</b> |                    |          |                  |                                  |

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

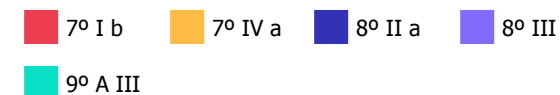
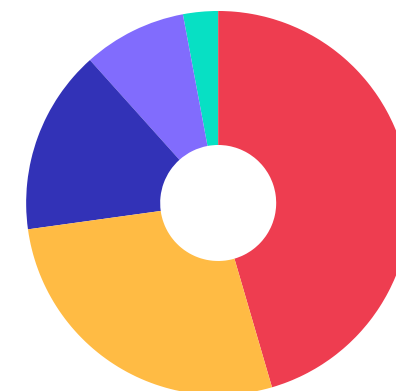
| Artigos - Renda Fixa               | Resolução      | Carteira \$          | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2021 |               |                | GAP Superior |
|------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|--------------|
|                                    |                |                      |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |              |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  | 100,00%        | 8.689.661,62         | 45,48%        | 11,51%                        | 51,54%        | 71,92%         | 5.052.262,04 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 40,00%         | 5.221.936,65         | 27,33%        | 4,06%                         | 20,32%        | 40,00%         | 2.420.957,49 |
| <b>Total Renda Fixa</b>            | <b>100,00%</b> | <b>13.911.598,27</b> | <b>72,81%</b> | <b>15,57%</b>                 | <b>71,86%</b> | <b>111,92%</b> |              |



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

| Artigos - Renda Variável         | Resolução     | Carteira \$         | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2021 |               |               | GAP Superior |
|----------------------------------|---------------|---------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|--------------|
|                                  |               |                     |               | Inf                           | Alvo          | Sup           |              |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 20,00%        | 2.971.272,52        | 15,55%        | 3,69%                         | 18,45%        | 20,00%        | 850.174,55   |
| Artigo 8º, Inciso III            | 10,00%        | 1.661.980,35        | 8,70%         | 3,07%                         | 9,07%         | 10,00%        | 248.743,19   |
| <b>Total Renda Variável</b>      | <b>30,00%</b> | <b>4.633.252,87</b> | <b>24,25%</b> | <b>6,76%</b>                  | <b>27,52%</b> | <b>30,00%</b> |              |

| 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%         | 955.361,77   |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00%        | 562.384,21        | 2,94%        | 0,00%                                  | 0,31%        | 5,00%         | 392.977,56   |
| <b>Total Exterior</b>     | <b>10,00%</b> | <b>562.384,21</b> | <b>2,94%</b> | <b>0,00%</b>                           | <b>0,62%</b> | <b>10,00%</b> |              |



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

| Gestão                     | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL    | 12.546.809,65 | 65,67         | 0,00           |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 2.753.060,50  | 14,41         | 0,00           |
| ITAÚ UNIBANCO              | 2.158.832,25  | 11,30         | 0,00           |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT  | 1.600.978,92  | 8,38          | 0,00           |
| MULTINVEST CAPITAL         | 47.554,03     | 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 '  | 8.689.661,62                  | 45,48      | 11,51               | 71,92               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5.221.936,65                  | 27,33      | 4,06                | 40,00               |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 2.971.272,52                  | 15,55      | 18,45               | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso III              | 1.661.980,35                  | 8,70       | 3,07                | 10,00               |
| Artigo 9º - A, Inciso II           | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 9º - A, Inciso III          | 562.384,21                    | 2,94       | 0,00                | 5,00                |

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

|   | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                         | -1,47% | 1,56%  | -0,12% | 0,25%  | 4,62%  | 11,66% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,29% | 1,46%  | -0,03% | 0,47%  | 4,40%  | 10,83% | 1,97%   | 0,03%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                  | -0,54% | 1,23%  | 0,23%  | 0,83%  | 1,78%  | 5,91%  | -       | -                |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | -0,52% | 1,00%  | 0,18%  | 0,70%  | 1,52%  | 5,24%  | 0,74%   | 0,01%            |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | -0,54% | 1,05%  | 0,18%  | 0,71%  | 1,56%  | 5,47%  | 0,73%   | 0,01%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                  | -1,24% | 1,22%  | -0,10% | 0,49%  | 4,43%  | 10,39% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | -1,24% | 1,03%  | -0,14% | 0,39%  | 4,19%  | 9,79%  | 1,99%   | 0,03%            |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                 | -1,28% | 0,98%  | -0,21% | 0,31%  | 4,16%  | 9,80%  | 2,00%   | 0,03%            |
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>                                    | -2,54% | -4,79% | -3,73% | -2,67% | 1,83%  | 0,81%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | -2,56% | -5,00% | -3,82% | -2,82% | 1,58%  | 0,15%  | 3,57%   | 0,07%            |
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                                    | -2,63% | -5,50% | -3,53% | -3,59% | -3,30% | 0,99%  | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                    | -0,62% | 1,07%  | 0,06%  | 0,70%  | 1,60%  | 5,28%  | 0,70%   | 0,01%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                      | 0,48%  | 3,00%  | 1,35%  | 2,29%  | 3,32%  | 6,65%  | -       | -                |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                | 0,46%  | 2,75%  | 1,29%  | 2,24%  | 3,14%  | 6,28%  | 0,01%   | 0,00%            |
| BRANCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA                     | 0,48%  | 2,92%  | 1,35%  | 2,30%  | 3,23%  | 5,88%  | 0,02%   | 0,00%            |

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

|   | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO          | 0,40%  | 2,07%  | 1,05%  | 1,72%  | 2,23%  | 4,34%  | 0,01%   | 0,00%            |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA            | 0,38%  | 2,16%  | 1,03%  | 1,73%  | 2,33%  | 4,75%  | 0,01%   | 0,00%            |
| ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP    | 0,84%  | 4,60%  | 2,82%  | 4,40%  | 5,13%  | 10,08% | 0,52%   | 0,01%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                 | 1,25%  | 8,24%  | 3,32%  | 5,73%  | 10,67% | 15,01% | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA     | -0,36% | 1,96%  | 0,79%  | 1,51%  | 2,27%  | 5,61%  | 1,17%   | 0,01%            |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA          | -0,66% | -1,82% | -1,75% | -2,29% | 0,30%  | 4,82%  | 0,96%   | 0,03%            |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                | -0,72% | -2,35% | -1,37% | -0,82% | 0,85%  | 2,10%  | 1,48%   | 0,03%            |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                    | 0,06%  | -0,75% | -0,86% | -1,16% | 0,92%  | -      | 0,50%   | 0,02%            |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>                        | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP     | -1,48% | -0,64% | -1,40% | -1,28% | 2,35%  | 7,67%  | 2,38%   | 0,03%            |
| <b>Não definido (Benchmark)</b>                         | -      | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -1,25% | 1,45%  | -0,05% | 0,61%  | 4,38%  | 10,97% | 1,89%   | 0,03%            |



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

|  | Mês     | Ano     | 3M      | 6M      | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|---------|---------|---------|---------|--------|---------|---------|------------------|
| <b>IDIV (Benchmark)</b>                    | -4,23%  | -8,71%  | -8,99%  | -7,55%  | 13,78% | 1,74%   | -       | -                |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                  | -4,28%  | -11,43% | -9,92%  | -7,83%  | 10,79% | -4,15%  | 11,94%  | 0,25%            |
| <b>Ibovespa (Benchmark)</b>                | -6,74%  | -13,04% | -15,02% | -12,95% | 10,16% | -3,47%  | -       | -                |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                  | -5,02%  | -8,12%  | -10,68% | -8,86%  | 18,52% | 15,82%  | 10,48%  | 0,25%            |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES       | -11,78% | -15,07% | -22,25% | -15,35% | 4,46%  | -24,06% | 13,42%  | 0,26%            |
| BRDESCO SELECTION FI AÇÕES                 | -8,62%  | -17,61% | -18,09% | -15,68% | -3,82% | -16,16% | 13,27%  | 0,20%            |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                     | -7,54%  | -8,06%  | -15,47% | -11,98% | 9,73%  | -3,63%  | 9,84%   | 0,20%            |
| ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES                      | -9,99%  | -18,05% | -18,14% | -16,12% | 0,69%  | -6,40%  | 13,96%  | 0,23%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                     | 0,48%   | 3,00%   | 1,35%   | 2,29%   | 3,32%  | 6,65%   | -       | -                |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP   | -0,89%  | -0,30%  | -2,96%  | -2,10%  | 4,27%  | 6,17%   | 1,70%   | 0,04%            |
| CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | -1,27%  | 0,20%   | -2,63%  | -1,74%  | 4,90%  | 6,12%   | 2,48%   | 0,05%            |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>           | -       | -       | -       | -       | -      | -       | -       | -                |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                 | -6,71%  | -14,36% | -16,18% | -15,55% | 8,19%  | -8,26%  | 11,88%  | 0,24%            |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP             | -1,47%  | -2,19%  | -3,57%  | -2,17%  | 4,35%  | 3,64%   | 3,41%   | 0,06%            |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES          | -10,13% | -15,27% | -17,46% | -16,11% | 2,63%  | -4,49%  | 12,63%  | 0,22%            |
| <b>Não definido (Benchmark)</b>            | -       | -       | -       | -       | -      | -       | -       | -                |

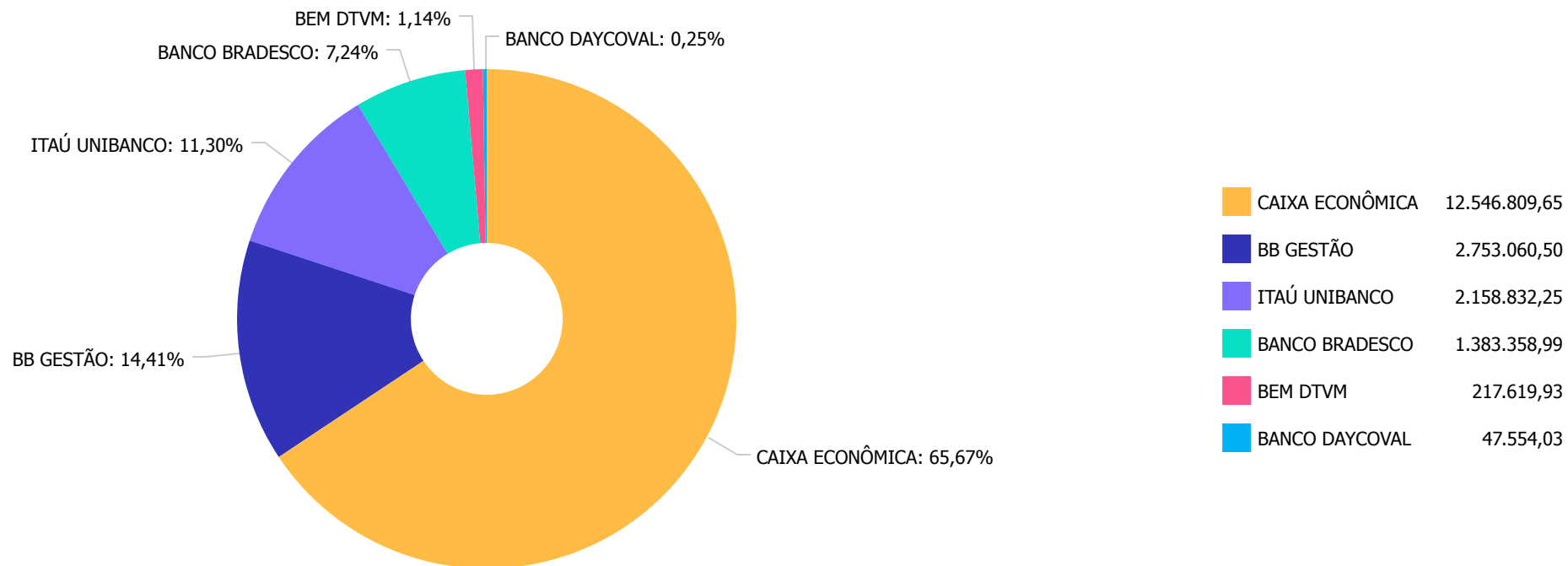
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA VARIÁVEL**

|                                       | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO | 7,57%  | 25,56% | 5,89%  | 11,78% | 43,17% | 50,43% | 5,85%   | 0,13%            |
| MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO    | -0,99% | -3,52% | -3,85% | -3,12% | -0,41% | -2,35% | 2,11%   | 0,05%            |

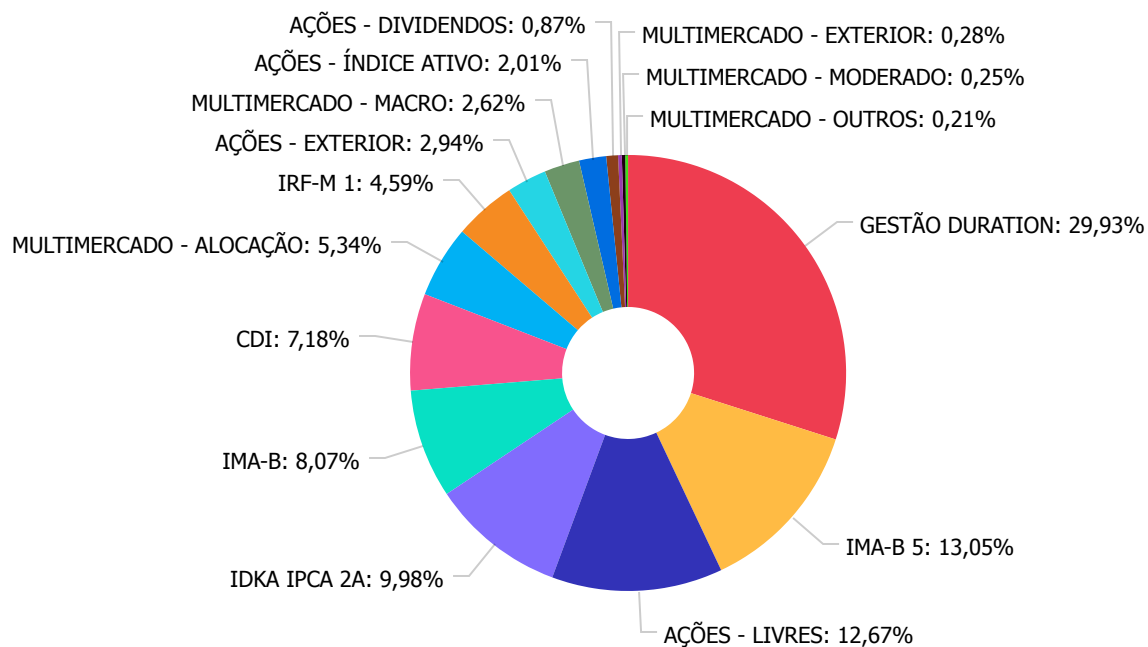
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

|  | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| <b>Global BDRX (Benchmark)</b>             | 11,15% | 32,29% | 13,49% | 15,25% | 36,93% | 118,76% | -       | -                |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 10,56% | 30,22% | 14,59% | 14,59% | 33,62% | 105,85% | 7,50%   | 0,13%            |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>           | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -       | -                |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I   | 10,93% | 29,48% | 13,35% | 13,59% | 33,55% | 114,42% | 7,94%   | 0,13%            |
| <b>Não definido (Benchmark)</b>            | -      | -      | -      | -      | -      | -       | -       | -                |
| BRDESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 10,62% | 32,49% | 14,10% | 14,73% | 35,85% | 112,63% | 7,70%   | 0,13%            |

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



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

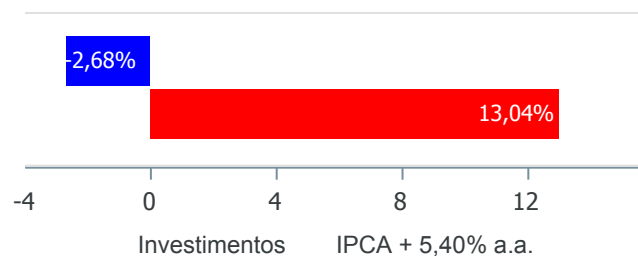


|                         |              |
|-------------------------|--------------|
| GESTÃO DURATION         | 5.719.283,29 |
| IMA-B 5                 | 2.493.189,85 |
| AÇÕES - LIVRES          | 2.420.577,71 |
| IDKA IPCA 2A            | 1.907.781,34 |
| IMA-B                   | 1.542.018,32 |
| CDI                     | 1.372.212,83 |
| MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO | 1.020.903,74 |
| IRF-M 1                 | 877.112,64   |
| AÇÕES - EXTERIOR        | 562.384,21   |
| MULTIMERCADO - MACRO    | 500.452,41   |
| AÇÕES - ÍNDICE ATIVO    | 384.007,76   |
| AÇÕES - DIVIDENDOS      | 166.687,05   |
| MULTIMERCADO - EXTERIOR | 52.901,55    |
| MULTIMERCADO - MODERADO | 47.554,03    |
| MULTIMERCADO - OUTROS   | 40.168,62    |

**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% |
| Outubro   | 19.323.685,84  | 283.807,66 | 115.955,31 | 19.107.235,35 | -384.302,84 | -519.518,71  | -1,97%      | -2,68%       | 1,67%    | 13,04%    | -20,56%  | 3,51% |

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**



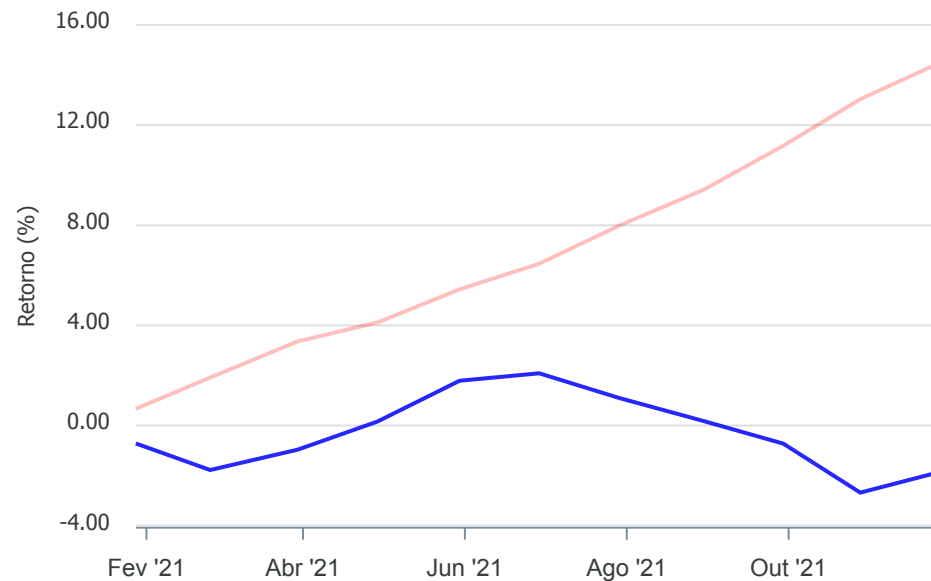
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/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 ... | 369.612,35           | 166.840,81        | 0,00              | 540.518,72           | 4.065,56           | 0,76%         | 0,84%      | 0,52%        |
| BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA              | 181.972,01           | 0,00              | 0,00              | 182.850,86           | 878,85             | 0,48%         | 0,48%      | 0,02%        |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA          | 147.576,95           | 0,00              | 0,00              | 148.259,64           | 682,69             | 0,46%         | 0,46%      | 0,01%        |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 373.201,69           | 62.389,22         | 0,00              | 437.263,99           | 1.673,08           | 0,38%         | 0,40%      | 0,01%        |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA          | 124.364,06           | 54.577,63         | 115.955,31        | 63.319,62            | 333,24             | 0,19%         | 0,38%      | 0,01%        |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                  | 1.290.820,70         | 0,00              | 0,00              | 1.291.583,81         | 763,11             | 0,06%         | 0,06%      | 0,50%        |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 714.305,32           | 0,00              | 0,00              | 711.767,40           | -2.537,92          | -0,36%        | -0,36%     | 1,17%        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 32.856,13            | 0,00              | 0,00              | 32.685,69            | -170,44            | -0,52%        | -0,52%     | 0,74%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 829.357,39           | 0,00              | 0,00              | 824.914,80           | -4.442,59          | -0,54%        | -0,54%     | 0,73%        |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA              | 19.633,22            | 0,00              | 0,00              | 19.512,15            | -121,07            | -0,62%        | -0,62%     | 0,70%        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 2.634.487,62         | 0,00              | 0,00              | 2.617.067,60         | -17.420,02         | -0,66%        | -0,66%     | 0,96%        |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA              | 1.106.784,06         | 0,00              | 0,00              | 1.098.864,48         | -7.919,58          | -0,72%        | -0,72%     | 1,48%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 757.149,89           | 0,00              | 0,00              | 747.730,64           | -9.419,25          | -1,24%        | -1,24%     | 1,99%        |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 860.349,97           | 0,00              | 0,00              | 849.571,86           | -10.778,11         | -1,25%        | -1,25%     | 1,89%        |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 1.010.836,83         | 0,00              | 0,00              | 997.951,08           | -12.885,75         | -1,27%        | -1,27%     | 2,00%        |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 1.072.063,24         | 0,00              | 0,00              | 1.058.209,48         | -13.853,76         | -1,29%        | -1,29%     | 1,97%        |
| CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L... | 758.732,02           | 0,00              | 0,00              | 747.508,13           | -11.223,89         | -1,48%        | -1,48%     | 2,38%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.582.557,72         | 0,00              | 0,00              | 1.542.018,32         | -40.539,40         | -2,56%        | -2,56%     | 3,57%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>13.866.661,17</b> | <b>283.807,66</b> | <b>115.955,31</b> | <b>13.911.598,27</b> | <b>-122.915,25</b> | <b>-0,88%</b> |            | <b>1,51%</b> |



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável                      | Saldo Anterior      | Aplicações  | Resgates    | Saldo Atual         | Retorno (R\$)      | Retorno (%)   | (%) Instit | Var - Mês    |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|--------------------|---------------|------------|--------------|
| BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO      | 49.177,01           | 0,00        | 0,00        | 52.901,55           | 3.724,54           | 7,57%         | 7,57%      | 5,85%        |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP   | 504.942,48          | 0,00        | 0,00        | 500.452,41          | -4.490,07          | -0,89%        | -0,89%     | 1,70%        |
| MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO         | 48.028,81           | 0,00        | 0,00        | 47.554,03           | -474,78            | -0,99%        | -0,99%     | 2,11%        |
| CAIXA ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP | 40.686,23           | 0,00        | 0,00        | 40.168,62           | -517,61            | -1,27%        | -1,27%     | 2,48%        |
| CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP             | 1.036.153,23        | 0,00        | 0,00        | 1.020.903,74        | -15.249,49         | -1,47%        | -1,47%     | 3,41%        |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                  | 174.135,52          | 0,00        | 0,00        | 166.687,05          | -7.448,47          | -4,28%        | -4,28%     | 11,94%       |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                  | 116.437,69          | 0,00        | 0,00        | 110.589,70          | -5.847,99          | -5,02%        | -5,02%     | 10,48%       |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                 | 296.648,14          | 0,00        | 0,00        | 276.747,69          | -19.900,45         | -6,71%        | -6,71%     | 11,88%       |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                     | 350.658,35          | 0,00        | 0,00        | 324.231,05          | -26.427,30         | -7,54%        | -7,54%     | 9,84%        |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                | 238.140,42          | 0,00        | 0,00        | 217.619,93          | -20.520,49         | -8,62%        | -8,62%     | 13,27%       |
| ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES                      | 184.853,01          | 0,00        | 0,00        | 166.387,83          | -18.465,18         | -9,99%        | -9,99%     | 13,96%       |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES          | 1.460.552,80        | 0,00        | 0,00        | 1.312.594,17        | -147.958,63        | -10,13%       | -10,13%    | 12,63%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES       | 449.368,03          | 0,00        | 0,00        | 396.415,10          | -52.952,93         | -11,78%       | -11,78%    | 13,42%       |
| <b>Total Renda Variável</b>                | <b>4.949.781,72</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>4.633.252,87</b> | <b>-316.528,85</b> | <b>-6,39%</b> |            | <b>8,97%</b> |

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

| <b>Ativos Exterior</b>                      | <b>Saldo Anterior</b> | <b>Aplicações</b> | <b>Resgates</b> | <b>Saldo Atual</b> | <b>Retorno (R\$)</b> | <b>Retorno (%)</b> | <b>(%) Instit</b> | <b>Var - Mês</b> |
|---|-----------------------|-------------------|-----------------|--------------------|----------------------|--------------------|-------------------|------------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I    | 419.540,67            | 0,00              | 0,00            | 465.391,62         | 45.850,95            | 10,93%             | 10,93%            | 7,94%            |
| BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 44.061,63             | 0,00              | 0,00            | 48.742,10          | 4.680,47             | 10,62%             | 10,62%            | 7,70%            |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I  | 43.640,65             | 0,00              | 0,00            | 48.250,49          | 4.609,84             | 10,56%             | 10,56%            | 7,50%            |
| <b>Total Exterior</b>                       | <b>507.242,95</b>     | <b>0,00</b>       | <b>0,00</b>     | <b>562.384,21</b>  | <b>55.141,26</b>     | <b>10,87%</b>      |                   | <b>7,88%</b>     |

## Disclaimer

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

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

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

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

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

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

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

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

