

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.491.257,77	1,49%	578	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.328.008,01	5,33%	1.014	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.753.093,80	5,75%	770	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.141.707,23	1,14%	1.140	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.852.588,25	4,85%	964	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.849.690,78	5,85%	1.057	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.836.910,98	7,84%	1.013	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.987.820,36	1,99%	1.264	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	12.429.521,28	12,43%	587	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.601.965,83	1,60%	254	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	6.869.112,89	6,87%	768	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.654.792,45	3,66%	193	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	359.154,63	0,36%	113	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.938.620,55	2,94%	143	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.648.762,30	8,65%	790	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	341.223,37	0,34%	106	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.150.406,82	2,15%	249	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	675.595,01	0,68%	2.466	0,06%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.936.129,30	1,94%	8.214	1,00%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	1.021.208,14	1,02%	53	0,31%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

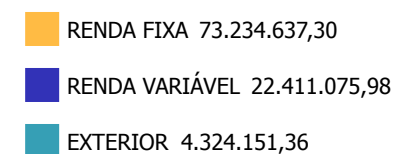
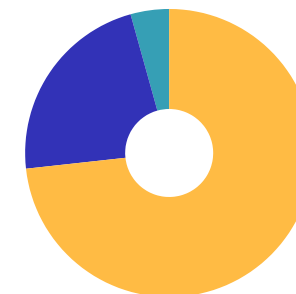
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.467.321,18	2,47%	2.705	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	566.549,59	0,57%	5.723	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.069.004,31	1,07%	27.215	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	684.728,16	0,68%	1.367	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.208.006,70	2,21%	174	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	4.514.440,82	4,52%	137	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	887.416,29	0,89%	40.548	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	299.849,60	0,30%	456	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	500.768,13	0,50%	9	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	499.161,75	0,50%	25	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.523.391,91	2,52%	16.031	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.536.067,31	1,54%	131	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	423.168,68	0,42%	19.023	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	203.396,53	0,20%	15.340	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	394.872,57	0,39%	384	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	707.618,38	0,71%	84	0,06%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	2.110.548,88	2,11%	73	0,15%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	542.526,86	0,54%	114	0,03%	Artigo 9º - A, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	665.833,66	0,67%	494	0,02%	Artigo 9º - A, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	297.623,58	0,30%	1.256	0,01%	Artigo 9º - A, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			99.969.864,64				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.996.986,46
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.241.077,18	34,25%	25,00%	51,00%	90,00%	55.731.801,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.996.986,46
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	38.993.560,12	39,01%	4,07%	21,00%	45,00%	5.992.878,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.998.493,23
Total Renda Fixa	100,00%	73.234.637,30	73,26%	29,07%	72,00%	160,00%	



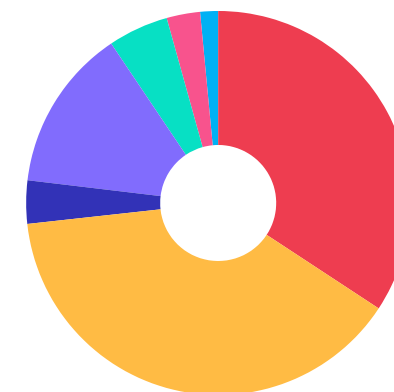
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	35,00%	3.632.932,45	3,63%	1,00%	4,00%	15,00%	11.362.547,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	25,00%	13.697.246,53	13,70%	10,00%	16,00%	25,00%	11.295.219,63
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.080.897,00	5,08%	3,00%	6,00%	10,00%	4.916.089,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.998.493,23
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.998.493,23
Total Renda Variável	35,00%	22.411.075,98	22,42%	14,00%	26,00%	60,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	2.818.167,26	2,82%	0,00%	1,00%	5,00%	2.180.325,97
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.505.984,10	1,51%	0,00%	1,00%	5,00%	3.492.509,13
Total Exterior	10,00%	4.324.151,36	4,33%	0,00%	2,00%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.689.960,32	44,70	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	41.980.692,13	41,99	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	7.927.890,08	7,93	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.379.046,48	3,38	0,00
TRÍGONO CAPITAL	999.929,88	1,00	0,02
SAFRA ASSET MANAGEMENT	992.345,75	0,99	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 ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	34.241.077,18	34,25	25,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	38.993.560,12	39,01	4,07	45,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	3.632.932,45	3,63	1,00	15,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	13.697.246,53	13,70	16,00	25,00
Artigo 8º, Inciso III	5.080.897,00	5,08	6,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	2.818.167,26	2,82	1,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.505.984,10	1,51	1,00	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%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,13%	-2,44%	-1,62%	0,46%	4,43%	6,22%	2,18%	0,06%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,20%	-3,14%	-1,80%	0,31%	3,79%	5,90%	2,08%	0,06%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,26%	-1,84%	-0,98%	1,61%	5,15%	8,50%	2,39%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	2,65%	1,48%	2,31%	3,31%	6,30%	0,13%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	2,64%	1,31%	2,13%	3,23%	6,30%	0,03%	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
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%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,85%	-0,46%	0,90%	2,78%	-	0,67%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,49%	-0,81%	-1,52%	-0,70%	0,74%	-	0,22%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-1,38%	-0,70%	0,51%	1,75%	5,52%	0,80%	0,03%

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
IBX (Benchmark)	-6,99%	-5,99%	-13,61%	-5,31%	17,82%	7,71%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-3,91%	2,47%	-9,75%	2,89%	17,72%	15,75%	12,89%	0,17%

Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-6,79%	-6,97%	-12,87%	-5,27%	15,48%	6,74%	12,79%	0,22%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-6,62%	-7,01%	-12,57%	-5,04%	16,91%	5,32%	12,58%	0,23%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	-7,86%	-10,21%	-12,60%	-3,70%	6,92%	6,10%	11,93%	0,19%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,98%	-3,26%	-8,58%	-1,61%	23,96%	25,09%	11,83%	0,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,52%	-2,28%	-6,51%	0,33%	29,38%	17,40%	12,52%	0,24%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-8,29%	-9,84%	-14,73%	-4,60%	8,76%	-5,07%	12,42%	0,18%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,49%	51,44%	-1,98%	27,99%	86,00%	-	12,63%	0,21%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,31%	-	-1,11%	-	-	-	14,53%	-

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%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-4,57%	17,12%	1,15%	9,89%	30,43%	43,42%	6,09%	0,13%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-3,96%	0,09%	-8,42%	3,65%	23,99%	17,42%	10,28%	0,21%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,58%	-0,73%	-2,95%	-0,57%	5,51%	6,44%	3,62%	0,06%

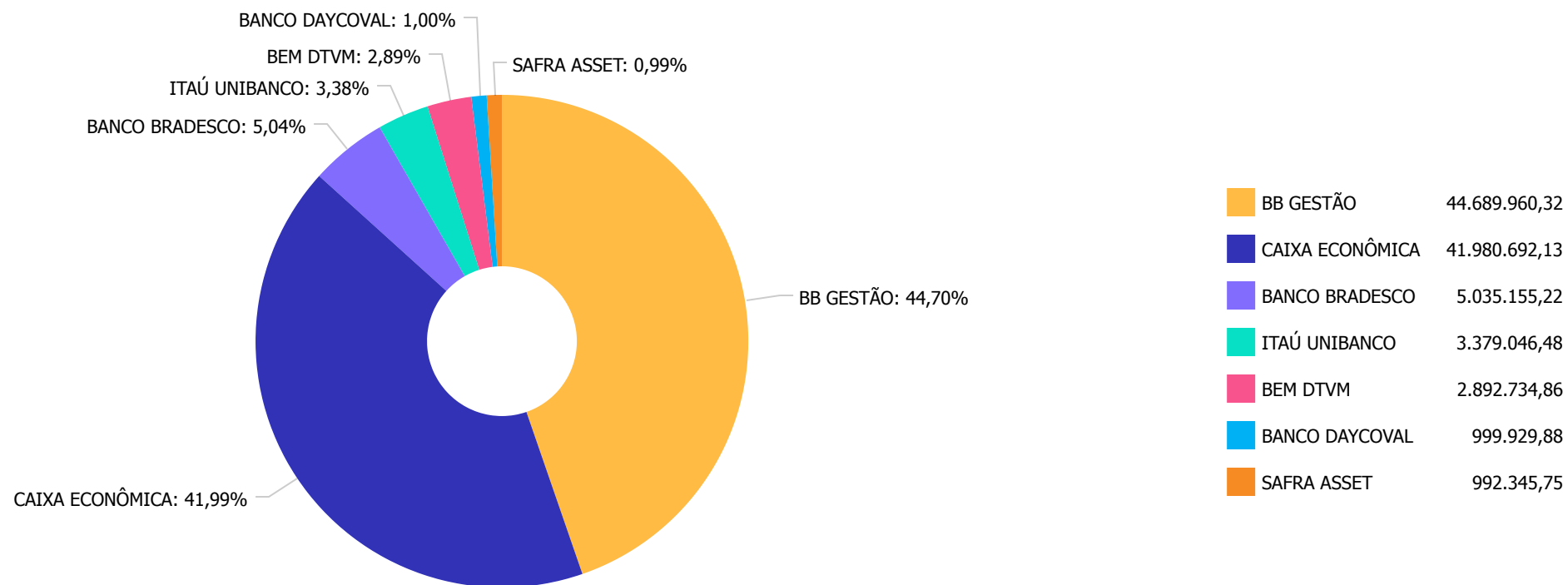
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,64%	17,47%	1,14%	9,99%	30,72%	42,05%	6,15%	0,13%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,75%	6,80%	-10,94%	3,12%	28,12%	29,33%	14,09%	0,20%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,79%	1,44%	-1,87%	0,04%	5,61%	-	2,46%	0,04%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-6,75%	-5,50%	-13,47%	-4,90%	17,56%	7,93%	12,21%	0,22%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-8,34%	-2,12%	-14,86%	-1,90%	16,97%	17,31%	12,04%	0,20%

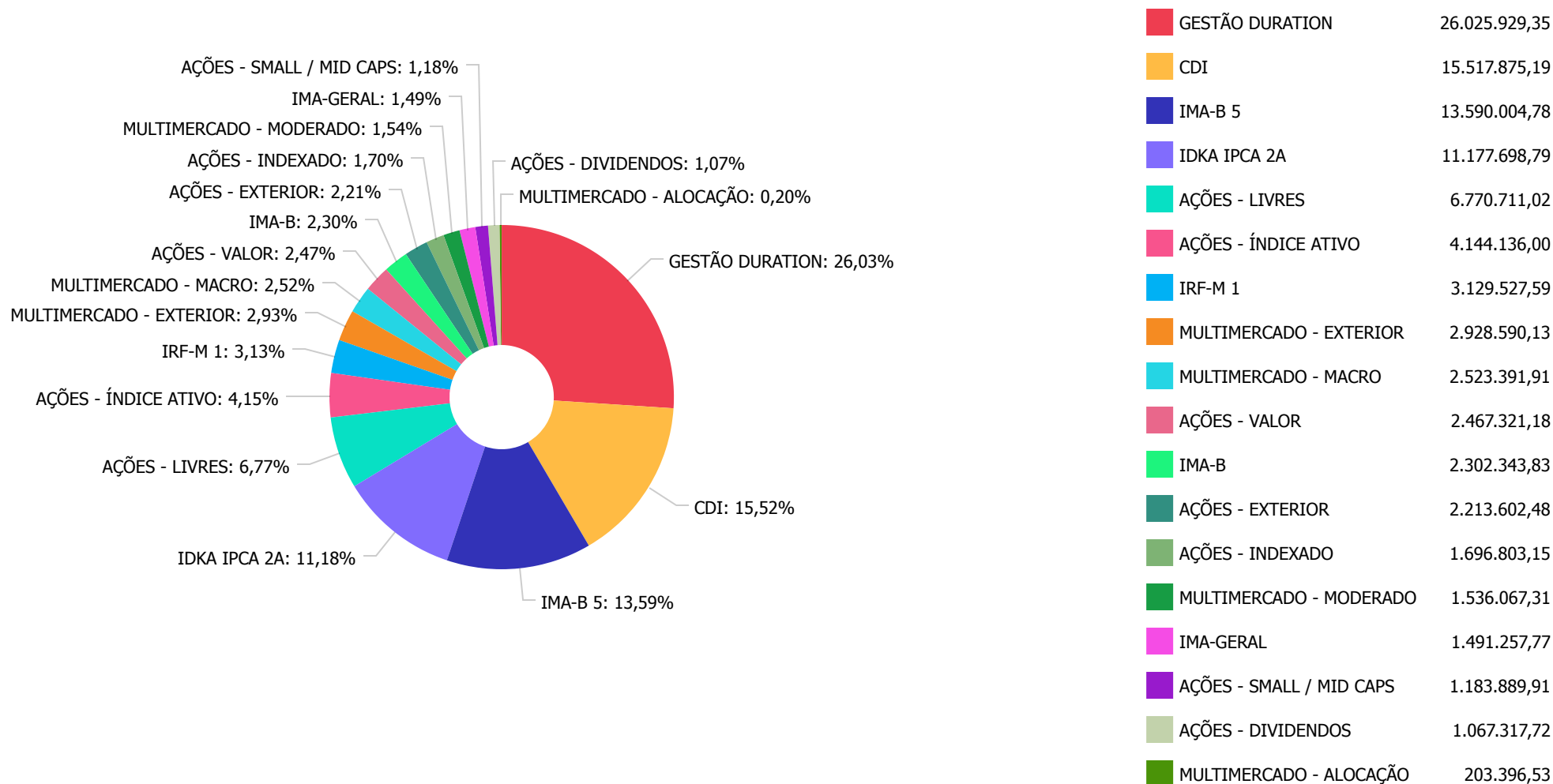
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,71%	18,67%	9,36%	4,49%	19,87%	90,75%	6,92%	0,10%
MSCI WORLD (Benchmark)	1,22%	16,99%	8,36%	2,09%	22,47%	80,14%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,95%	22,08%	10,00%	6,17%	27,02%	102,50%	6,41%	0,09%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,30%	19,63%	11,29%	4,48%	29,53%	110,87%	6,19%	0,12%
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,81%	19,04%	7,72%	6,60%	20,62%	79,55%	7,15%	0,10%

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



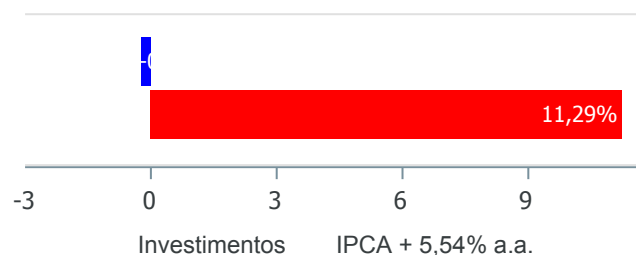
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	74.602.048,07	1.445.030,02	99.142,02	75.492.986,48	-454.949,59	-454.949,59	-0,60%	-0,60%	0,68%	0,68%	-88,10%	2,74%
Fevereiro	75.492.986,48	1.931.954,10	102.920,28	76.557.360,53	-764.659,77	-1.219.609,36	-0,99%	-1,58%	1,25%	1,94%	-81,65%	2,64%
Março	76.557.360,53	9.259.888,18	2.827.480,49	83.493.966,39	504.198,17	-715.411,19	0,61%	-0,98%	1,43%	3,39%	-29,00%	2,89%
Abril	83.493.966,39	3.647.896,01	1.727.808,59	86.350.207,28	936.153,47	220.742,28	1,10%	0,10%	0,74%	4,16%	2,43%	1,93%
Mai	86.350.207,28	6.771.351,33	4.398.164,93	89.972.365,32	1.248.971,64	1.469.713,92	1,41%	1,51%	1,28%	5,50%	27,48%	2,19%
Junho	89.972.365,32	4.028.622,87	1.883.871,28	92.192.899,76	75.782,85	1.545.496,77	0,08%	1,59%	0,98%	6,53%	24,40%	1,93%
Julho	92.192.899,76	4.158.925,62	2.034.225,14	93.643.066,55	-674.533,69	870.963,08	-0,72%	0,87%	1,44%	8,06%	10,76%	2,62%
Agosto	93.643.066,55	6.412.455,00	3.543.414,31	95.958.370,49	-553.736,75	317.226,33	-0,57%	0,29%	1,35%	9,52%	3,03%	2,79%
Setembro	95.958.370,49	13.053.941,42	8.533.345,77	99.969.864,64	-509.101,50	-191.875,17	-0,51%	-0,22%	1,62%	11,29%	-1,95%	3,10%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



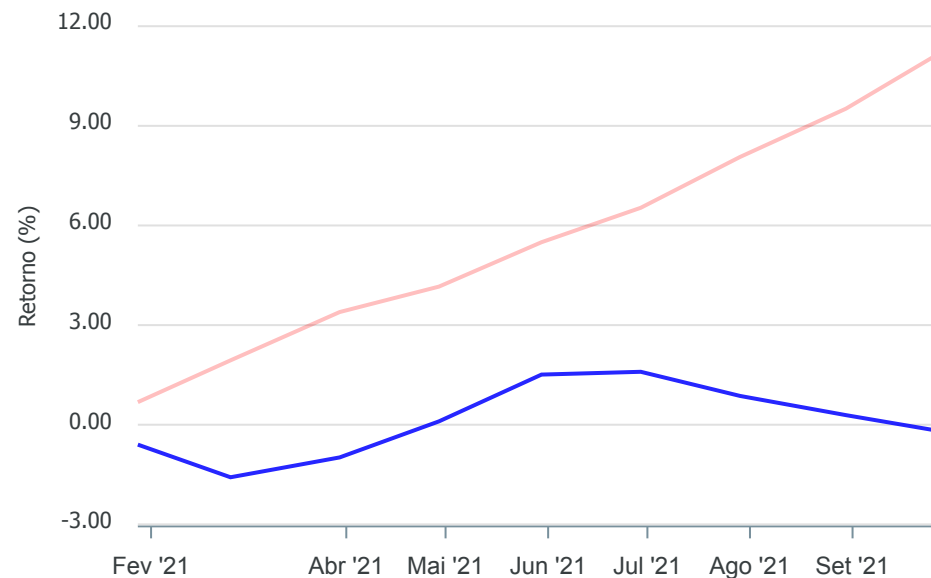
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Setembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.411.179,24	378.739,39	0,00	5.849.690,78	59.772,15	1,03%	1,08%	0,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.697.396,89	0,00	0,00	5.753.093,80	55.696,91	0,98%	0,98%	0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.379.600,21	384.449,57	0,00	7.836.910,98	72.861,20	0,94%	0,98%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.283.501,30	1.000.000,00	0,00	5.328.008,01	44.506,71	0,84%	1,03%	0,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.132.558,95	0,00	0,00	2.150.406,82	17.847,87	0,84%	0,84%	0,54%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.924.207,18	0,00	0,00	2.938.620,55	14.413,37	0,49%	0,49%	0,22%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.865.798,62	2.073.812,82	98.063,19	6.869.112,89	27.564,64	0,40%	0,46%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.980.330,76	0,00	0,00	1.987.820,36	7.489,60	0,38%	0,38%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.137.540,24	0,00	0,00	1.141.707,23	4.166,99	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.821.037,49	0,00	5.000.000,00	4.852.588,25	31.550,76	0,32%	0,35%	0,48%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	340.332,61	0,00	0,00	341.223,37	890,76	0,26%	0,26%	2,39%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.848.115,24	7.216.939,64	435.282,58	8.648.762,30	18.990,00	0,21%	0,53%	0,13%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	12.416.209,30	0,00	0,00	12.429.521,28	13.311,98	0,11%	0,11%	0,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.490.713,25	0,00	3.000.000,00	1.491.257,77	544,52	0,01%	-0,01%	0,80%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.604.053,86	0,00	0,00	1.601.965,83	-2.088,03	-0,13%	-0,13%	2,18%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.660.429,27	0,00	0,00	3.654.792,45	-5.636,82	-0,15%	-0,15%	1,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	359.885,24	0,00	0,00	359.154,63	-730,61	-0,20%	-0,20%	2,08%
Total Renda Fixa	70.352.889,65	11.053.941,42	8.533.345,77	73.234.637,30	361.152,00	0,50%		0,61%

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
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	500.768,13	768,13	0,15%	-4,31%	14,53%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	299.849,60	-150,40	-0,05%	-8,34%	12,04%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	499.161,75	-838,25	-0,17%	-5,49%	12,63%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.542.198,92	0,00	0,00	2.523.391,91	-18.807,01	-0,74%	-0,74%	1,80%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.548.249,44	0,00	0,00	1.536.067,31	-12.182,13	-0,79%	-0,79%	2,46%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	400.000,00	0,00	394.872,57	-5.127,43	-1,28%	-4,57%	6,09%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	206.655,92	0,00	0,00	203.396,53	-3.259,39	-1,58%	-1,58%	3,62%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.531.147,12	0,00	0,00	2.467.321,18	-63.825,94	-2,52%	-2,52%	12,52%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	4.690.119,36	0,00	0,00	4.514.440,82	-175.678,54	-3,75%	-3,75%	14,09%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	712.564,64	0,00	0,00	684.728,16	-27.836,48	-3,91%	-3,91%	12,89%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	589.899,15	0,00	0,00	566.549,59	-23.349,56	-3,96%	-3,96%	10,28%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.113.337,61	0,00	0,00	1.069.004,31	-44.333,30	-3,98%	-3,98%	11,83%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	443.751,22	0,00	0,00	423.168,68	-20.582,54	-4,64%	-4,64%	6,15%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1.093.566,99	0,00	0,00	1.021.208,14	-72.358,85	-6,62%	-6,62%	12,58%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	724.509,97	0,00	0,00	675.595,01	-48.914,96	-6,75%	-6,75%	12,21%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.077.061,16	0,00	0,00	1.936.129,30	-140.931,86	-6,79%	-6,79%	12,79%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	963.063,34	0,00	0,00	887.416,29	-75.647,05	-7,85%	-7,85%	11,93%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.407.460,57	0,00	0,00	2.208.006,70	-199.453,87	-8,28%	-8,28%	12,42%
Total Renda Variável	21.643.585,41	1.700.000,00	0,00	22.411.075,98	-932.509,43	-3,99%		10,57%

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
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.050.180,43	0,00	0,00	2.110.548,88	60.368,45	2,94%	2,94%	6,41%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	538.701,99	0,00	0,00	542.526,86	3.824,87	0,71%	0,71%	6,92%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	705.509,94	0,00	0,00	707.618,38	2.108,44	0,30%	0,30%	6,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	667.503,07	0,00	0,00	665.833,66	-1.669,41	-0,25%	-0,25%	6,75%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	300.000,00	0,00	297.623,58	-2.376,42	-0,79%	-0,81%	7,15%
Total Exterior	3.961.895,43	300.000,00	0,00	4.324.151,36	62.255,93	1,46%		6,54%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.368.712,20	384.449,57	0,00	7.836.910,98	83.749,21	1,08%	1,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.121.133,40	1.656.175,10	0,00	5.849.690,78	72.382,28	1,25%	1,21%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.101.312,88	2.837.048,93	1.132.915,29	6.869.112,89	63.666,37	0,80%	1,31%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.690.215,75	0,00	0,00	5.753.093,80	62.878,05	1,11%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.272.304,60	1.000.000,00	0,00	5.328.008,01	55.703,41	1,06%	1,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	883.078,88	8.282.207,00	545.810,86	8.648.762,30	29.287,28	0,32%	1,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.122.733,28	0,00	0,00	2.150.406,82	27.673,54	1,30%	1,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.970.265,96	0,00	0,00	1.987.820,36	17.554,40	0,89%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.131.888,13	0,00	0,00	1.141.707,23	9.819,10	0,87%	0,87%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	618.836,21	0,00	619.293,26	0,00	457,05	0,07%	-1,51%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	414.354,30	0,00	414.700,04	0,00	345,74	0,08%	-1,46%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	344.611,71	0,00	0,00	341.223,37	-3.388,34	-0,98%	-0,98%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	365.733,07	0,00	0,00	359.154,63	-6.578,44	-1,80%	-1,80%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.628.408,16	0,00	0,00	1.601.965,83	-26.442,33	-1,62%	-1,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.522.252,00	0,00	3.000.000,00	1.491.257,77	-30.994,23	-0,69%	-0,70%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.686.340,03	0,00	0,00	3.654.792,45	-31.547,58	-0,86%	-0,86%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.600.827,32	384.379,03	0,00	2.938.620,55	-46.585,80	-1,56%	-1,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.496.721,91	989.004,84	0,00	12.429.521,28	-56.205,47	-0,45%	-0,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.043.394,35	0,00	5.000.000,00	4.852.588,25	-190.806,10	-1,90%	-1,87%

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
				Total Renda Fixa	30.968,14	0,04%	

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 INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	414.700,04	0,00	423.168,68	8.468,64	2,04%	1,14%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.396.606,90	0,00	1.398.265,77	0,00	1.658,87	0,12%	0,32%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	500.768,13	768,13	0,15%	-1,11%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	0,00	300.000,00	0,00	299.849,60	-150,40	-0,05%	-14,86%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	499.161,75	-838,25	-0,17%	-1,98%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	400.000,00	0,00	394.872,57	-5.127,43	-1,28%	1,15%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	209.575,29	0,00	0,00	203.396,53	-6.178,76	-2,95%	-2,95%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.565.273,03	0,00	0,00	1.536.067,31	-29.205,72	-1,87%	-1,87%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	618.640,64	0,00	0,00	566.549,59	-52.091,05	-8,42%	-8,42%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.586.785,19	0,00	0,00	2.523.391,91	-63.393,28	-2,45%	-2,45%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	758.715,31	0,00	0,00	684.728,16	-73.987,15	-9,75%	-9,75%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.169.267,64	0,00	0,00	1.069.004,31	-100.263,33	-8,57%	-8,57%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	517.940,15	263.000,00	0,00	675.595,01	-105.345,14	-13,49%	-13,47%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	1.167.988,47	0,00	0,00	1.021.208,14	-146.780,33	-12,57%	-12,57%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	3.056.731,45	0,00	2.000.000,00	887.416,29	-169.315,16	-5,54%	-12,60%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.391.307,41	247.000,00	0,00	2.467.321,18	-170.986,23	-6,48%	-6,51%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.975.324,41	247.000,00	0,00	1.936.129,30	-286.195,11	-12,88%	-12,87%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.589.481,00	0,00	0,00	2.208.006,70	-381.474,30	-14,73%	-14,73%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.056.079,80	2.902.798,50	0,00	4.514.440,82	-444.437,48	-8,96%	-10,94%

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
				Total Renda Variável	-2.024.873,48	-8,29%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	0,00	2.017.559,03	0,00	2.110.548,88	92.989,85	4,61%	10,00%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	635.843,74	0,00	0,00	707.618,38	71.774,64	11,29%	11,29%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	618.128,33	0,00	0,00	665.833,66	47.705,33	7,72%	7,72%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	496.086,86	0,00	0,00	542.526,86	46.440,00	9,36%	9,36%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	300.000,00	0,00	297.623,58	-2.376,42	-0,79%	7,72%
				Total Exterior	256.533,40	6,31%	

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.