

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos
em setembro e 3º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

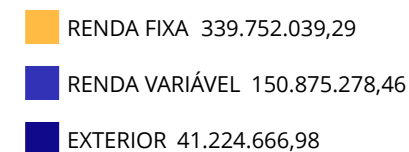
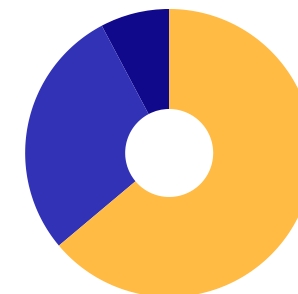
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	49.799.670,58	9,36%	1.014	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	28.236.810,90	5,31%	650	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	8.701.797,00	1,64%	165	3,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.140.445,90	1,72%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	17.962.816,97	3,38%	74	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	75.226.130,74	14,14%	964	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	15.256.894,26	2,87%	1.057	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	36.139.914,56	6,80%	202	0,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.687.994,92	0,32%	790	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	73.755.377,16	13,87%	249	2,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	22.653.822,43	4,26%	98	2,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.190.363,87	0,22%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	8.266.994,15	1,55%	2.466	0,74%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	14.509.424,35	2,73%	5.979	0,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	10.107.142,95	1,90%	56.614	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	8.215.782,79	1,54%	1.102	3,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.529.721,60	1,23%	1.367	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	13.195.177,58	2,48%	174	2,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	13.457.417,90	2,53%	5.641	0,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	11.738.623,63	2,21%	53	1,21%	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
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	8.465.182,21	1,59%	7.251	1,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	6.103.890,98	1,15%	37	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.299.012,36	1,37%	15.340	0,41%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	24.092.756,58	4,53%	384	1,28%	Artigo 8º, Inciso III
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	10.334.830,70	1,94%	54.781	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	8.523.106,48	1,60%	58.919	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA F...	Não se ...	Não se aplica	36.214,20	0,01%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	9.360.555,98	1,76%	89	0,40%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	9.585.291,13	1,80%	13.296	0,47%	Artigo 9º - A, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	22.278.819,87	4,19%	1.256	0,64%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			531.851.984,73				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	204.324.566,35	38,42%	35,00%	54,75%	65,00%	141.379.223,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	79.777.797,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	134.237.109,07	25,24%	10,00%	15,00%	30,00%	25.318.486,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.190.363,87	0,22%	0,00%	0,25%	0,25%	139.266,09
Total Renda Fixa	100,00%	339.752.039,29	63,88%	45,00%	70,00%	110,25%	



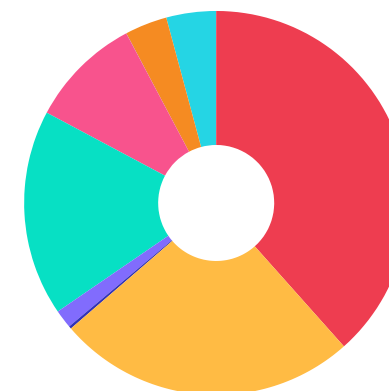
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	8.266.994,15	1,55%	0,00%	1,50%	2,50%	5.029.305,47
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	92.322.363,99	17,36%	6,00%	13,50%	20,00%	14.048.032,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	50.249.706,12	9,45%	5,00%	9,75%	10,00%	2.935.492,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	36.214,20	0,01%	0,00%	0,25%	0,25%	1.293.415,76
Total Renda Variável	35,00%	150.875.278,46	28,37%	11,00%	25,00%	32,75%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	18.945.847,11	3,56%	0,00%	3,00%	10,00%	34.239.351,36
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	22.278.819,87	4,19%	0,00%	2,00%	10,00%	30.906.378,60
Total Exterior	10,00%	41.224.666,98	7,75%	0,00%	5,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	117.469.063,45	22,09	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	114.472.971,56	21,52	0,01
ITAÚ UNIBANCO	73.755.377,16	13,87	0,00
BRANCO ASSET MANAGEMENT	55.864.813,74	10,50	0,01
SAFRA ASSET MANAGEMENT	46.371.576,45	8,72	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	32.239.113,56	6,06	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	22.597.863,80	4,25	0,01
VINCI PARTNERS	16.438.721,68	3,09	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	14.509.424,35	2,73	0,05
ITAÚ DTVM	11.738.623,63	2,21	0,00
WESTERN ASSET	8.523.106,48	1,60	0,02
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	8.465.182,21	1,59	0,03
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.215.782,79	1,54	0,01
PETRA CAPITAL	1.190.363,87	0,22	0,02

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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)

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%
IMA-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,96%	-4,13%	-1,90%	-0,24%	-0,36%	2,37%	1,08%	0,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	-2,47%	-1,66%	0,40%	4,49%	6,40%	2,18%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	4,66%	2,42%	3,97%	7,69%	13,21%	0,59%	0,01%
Selic (Benchmark)	0,44%	2,50%	1,21%	2,01%	2,99%	6,64%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	2,84%	1,38%	2,28%	3,26%	6,25%	0,05%	0,00%
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%
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%
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,18%	-4,86%	-0,68%	-4,29%	-5,30%	-9,94%	0,01%	0,03%

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
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,31%	1,63%	0,82%	1,63%	2,40%	6,83%	0,25%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	-2,26%	-1,05%	0,67%	1,29%	-27,95%	0,68%	0,05%
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
S&P 500 (Benchmark)	-4,76%	14,68%	0,23%	8,42%	28,09%	44,71%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,60%	17,21%	1,13%	9,92%	30,75%	43,09%	6,16%	0,13%
IPCA + 10,00% ao ano (Benchmark)	1,97%	14,78%	5,58%	9,90%	21,23%	37,53%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIELABORAÇÃO FIP	-6,03%	-94,34%	-61,49%	-85,86%	-94,41%	-95,05%	6,20%	0,95%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	1,33%	3,30%	1,89%	2,86%	5,48%	13,19%	0,57%	0,02%
IBX (Benchmark)	-6,99%	-5,99%	-13,61%	-5,31%	17,82%	7,71%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-4,19%	-1,53%	-13,08%	-1,14%	15,16%	14,06%	7,51%	0,18%
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%	-	-
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-6,97%	-8,19%	-12,76%	-6,02%	11,25%	12,61%	11,57%	0,20%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-6,14%	-9,32%	-14,04%	-6,06%	11,21%	2,43%	11,54%	0,22%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-7,31%	-9,02%	-13,82%	-4,95%	6,68%	-9,83%	13,50%	0,21%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,84%	-15,32%	-18,94%	-14,07%	-4,83%	0,46%	13,25%	0,17%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-6,60%	-8,41%	-13,64%	-6,12%	11,40%	5,54%	11,68%	0,21%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-8,29%	-9,84%	-14,73%	-4,60%	8,76%	-5,07%	12,42%	0,18%

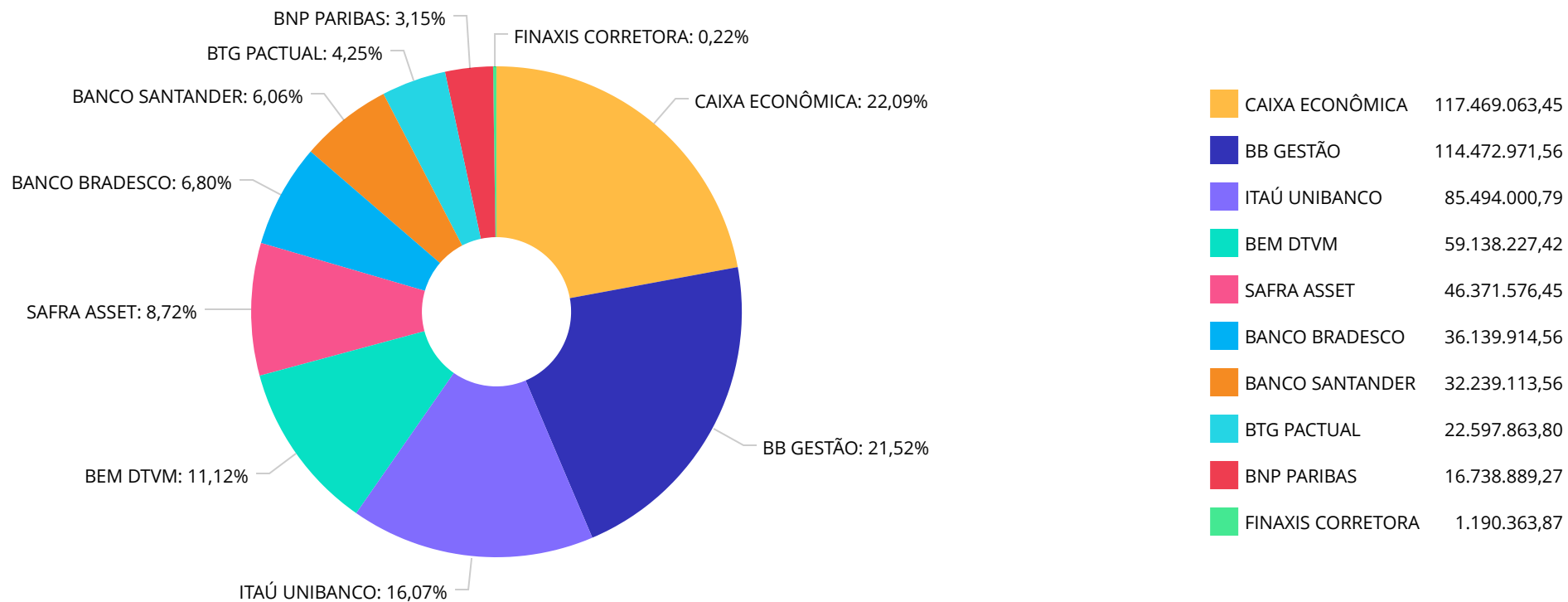
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-7,71%	-3,23%	-14,35%	-5,38%	16,49%	8,55%	12,73%	0,21%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,58%	-0,73%	-2,95%	-0,57%	5,51%	6,44%	3,62%	0,06%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-6,75%	-5,50%	-13,47%	-4,90%	17,56%	7,93%	12,21%	0,22%

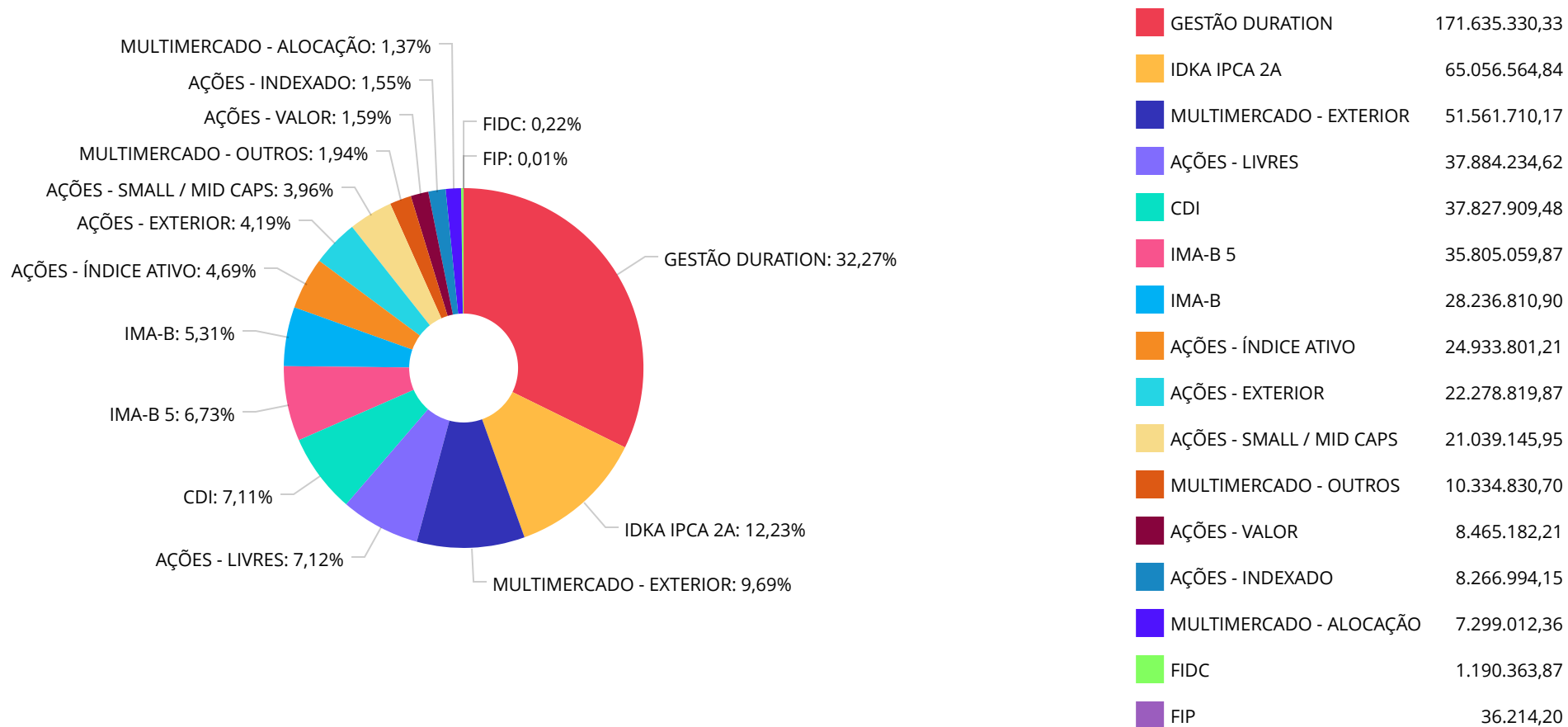
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	1,22%	16,99%	8,36%	2,09%	22,47%	80,14%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,33%	15,97%	7,99%	2,32%	20,85%	95,63%	6,11%	0,10%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,19%	20,16%	10,08%	3,90%	29,49%	95,40%	6,22%	0,14%
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)



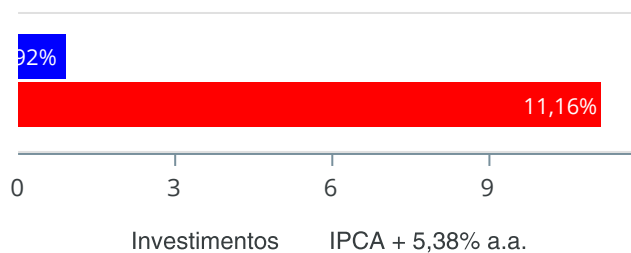
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)



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	564.714.090,43	83.446.868,81	72.255.388,74	575.088.838,13	-816.732,37	-816.732,37	-0,14%	-0,14%	0,67%	0,67%	-21,24%	3,32%
Fevereiro	575.088.838,13	17.685.888,68	28.529.973,08	562.557.406,12	-1.687.347,61	-2.504.079,98	-0,29%	-0,43%	1,24%	1,91%	-22,71%	3,08%
Março	562.557.406,12	18.807.774,80	19.188.963,25	567.651.639,44	5.475.421,77	2.971.341,79	0,97%	0,53%	1,41%	3,36%	15,92%	3,78%
Abril	567.651.639,44	27.522.380,31	31.769.635,39	571.044.807,64	7.640.423,28	10.611.765,07	1,35%	1,89%	0,73%	4,11%	45,95%	2,26%
Mai	571.044.807,64	13.465.149,13	18.492.288,88	572.491.154,04	6.473.486,15	17.085.251,22	1,13%	3,04%	1,27%	5,43%	56,02%	2,64%
Junho	572.491.154,04	99.565.468,68	104.766.408,97	568.491.574,49	1.201.360,74	18.286.611,96	0,21%	3,26%	0,97%	6,45%	50,49%	2,06%
Julho	568.491.574,49	31.450.487,42	44.945.639,34	552.557.713,26	-2.438.709,31	15.847.902,65	-0,43%	2,82%	1,42%	7,97%	35,34%	3,14%
Agosto	552.557.713,26	75.920.105,17	81.320.133,44	543.583.954,06	-3.573.730,93	12.274.171,72	-0,65%	2,15%	1,33%	9,41%	22,86%	3,37%
Setembro	543.583.954,06	26.772.112,27	31.938.571,62	531.851.984,73	-6.565.509,98	5.708.661,74	-1,21%	0,92%	1,60%	11,16%	8,22%	3,60%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



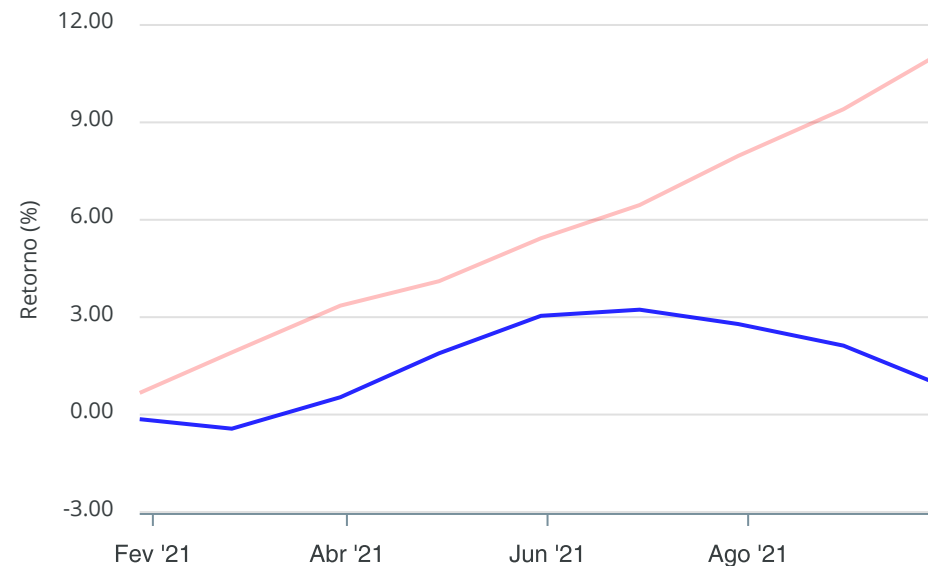
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO



- 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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.590.395,44	0,00	0,00	8.701.797,00	111.401,56	1,30%	1,30%	0,59%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.039.694,50	0,00	0,00	9.140.445,90	100.751,40	1,11%	1,11%	0,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	48.958.218,24	331.981,83	0,00	49.799.670,58	509.470,51	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.791.582,89	0,00	0,00	17.962.816,97	171.234,08	0,96%	0,96%	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	73.143.224,66	0,00	0,00	73.755.377,16	612.152,50	0,84%	0,84%	0,54%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	18.497.456,26	13.440.130,44	16.857.663,00	15.256.894,26	176.970,56	0,55%	1,08%	0,78%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.828.506,97	0,00	150.000,00	1.687.994,92	9.487,95	0,52%	0,53%	0,13%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	37.881.346,15	13.000.000,00	14.930.908,62	36.139.914,56	189.477,03	0,37%	0,49%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	74.960.057,21	0,00	0,00	75.226.130,74	266.073,53	0,35%	0,35%	0,48%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	22.584.902,06	0,00	0,00	22.653.822,43	68.920,37	0,31%	0,31%	0,25%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	28.280.236,27	0,00	0,00	28.236.810,90	-43.425,37	-0,15%	-0,15%	2,18%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.192.529,46	0,00	0,00	1.190.363,87	-2.165,59	-0,18%	-0,18%	0,01%
Total Renda Fixa	342.748.150,11	26.772.112,27	31.938.571,62	339.752.039,29	2.170.348,53	0,63%		0,66%

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
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	10.198.839,52	0,00	0,00	10.334.830,70	135.991,18	1,33%	1,33%	0,57%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.415.977,72	0,00	0,00	7.299.012,36	-116.965,36	-1,58%	-1,58%	3,62%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6.795.176,47	0,00	0,00	6.529.721,60	-265.454,87	-3,91%	-3,91%	12,89%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.143.840,93	0,00	0,00	14.509.424,35	-634.416,58	-4,19%	-4,19%	7,51%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	25.246.726,24	0,00	0,00	24.092.756,58	-1.153.969,66	-4,57%	-4,57%	6,09%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.934.245,01	0,00	0,00	8.523.106,48	-411.138,53	-4,60%	-4,60%	6,16%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	38.538,09	0,00	0,00	36.214,20	-2.323,89	-6,03%	-6,03%	6,20%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.752.718,66	0,00	0,00	8.215.782,79	-536.935,87	-6,13%	-6,13%	11,54%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	12.568.598,45	0,00	0,00	11.738.623,63	-829.974,82	-6,60%	-6,60%	11,68%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8.865.547,55	0,00	0,00	8.266.994,15	-598.553,40	-6,75%	-6,75%	12,21%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6.561.486,78	0,00	0,00	6.103.890,98	-457.595,80	-6,97%	-6,97%	11,57%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	9.132.831,08	0,00	0,00	8.465.182,21	-667.648,87	-7,31%	-7,31%	13,50%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	10.951.916,18	0,00	0,00	10.107.142,95	-844.773,23	-7,71%	-7,71%	12,73%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	14.387.125,47	0,00	0,00	13.195.177,58	-1.191.947,89	-8,28%	-8,28%	12,42%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.762.589,76	0,00	0,00	13.457.417,90	-1.305.171,86	-8,84%	-8,84%	13,25%
Total Renda Variável	159.756.157,91	0,00	0,00	150.875.278,46	-8.880.879,45	-5,56%		9,37%

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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	9.159.976,88	0,00	0,00	9.360.555,98	200.579,10	2,19%	2,19%	6,22%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	9.459.450,40	0,00	0,00	9.585.291,13	125.840,73	1,33%	1,33%	6,11%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	22.460.218,76	0,00	0,00	22.278.819,87	-181.398,89	-0,81%	-0,81%	7,15%
Total Exterior	41.079.646,04	0,00	0,00	41.224.666,98	145.020,94	0,35%		6,70%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	72.806.220,69	0,00	0,00	73.755.377,16	949.156,47	1,30%	1,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	68.150.059,46	1.098.317,23	20.000.000,00	49.799.670,58	551.293,89	0,80%	1,30%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.403.056,95	63.000.000,00	47.625.336,82	36.139.914,56	362.194,43	0,43%	1,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.737.743,37	0,00	243.842,07	8.701.797,00	207.895,70	2,38%	2,42%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	22.470.260,22	0,00	0,00	22.653.822,43	183.562,21	0,82%	0,82%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.237.297,60	0,00	245.191,91	9.140.445,90	148.340,21	1,61%	-1,05%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.310.848,73	0,00	478.834,90	17.962.816,97	130.803,14	0,71%	-1,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	52.108.701,97	40.571.178,56	77.504.472,19	15.256.894,26	81.485,92	0,09%	1,21%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.159.959,54	0,00	500.000,00	1.687.994,92	28.035,38	1,30%	1,48%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.198.549,64	0,00	0,00	1.190.363,87	-8.185,77	-0,68%	-0,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	28.463.548,56	243.842,07	0,00	28.236.810,90	-470.579,73	-1,64%	-1,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	76.163.788,12	478.834,90	0,00	75.226.130,74	-1.416.492,28	-1,85%	-1,87%
				Total Renda Fixa	747.509,57	0,15%	

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
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	23.819.241,98	0,00	0,00	24.092.756,58	273.514,60	1,15%	1,15%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	10.143.484,13	0,00	0,00	10.334.830,70	191.346,57	1,89%	1,89%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.427.842,16	0,00	0,00	8.523.106,48	95.264,32	1,13%	1,13%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.556.021,28	0,00	11.555.340,18	0,00	-681,10	-0,01%	0,55%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	94.027,40	0,00	51.326,33	36.214,20	-6.486,87	-6,90%	-61,49%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.520.741,29	0,00	0,00	7.299.012,36	-221.728,93	-2,95%	-2,95%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	7.235.279,54	0,00	0,00	6.529.721,60	-705.557,94	-9,75%	-9,75%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6.996.999,83	0,00	0,00	6.103.890,98	-893.108,85	-12,76%	-12,76%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	11.300.000,00	0,00	10.107.142,95	-1.192.857,05	-10,56%	-14,35%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	9.553.789,68	0,00	0,00	8.266.994,15	-1.286.795,53	-13,47%	-13,47%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9.557.129,25	0,00	0,00	8.215.782,79	-1.341.346,46	-14,04%	-14,04%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	9.822.152,19	0,00	0,00	8.465.182,21	-1.356.969,98	-13,82%	-13,82%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	13.593.121,10	0,00	0,00	11.738.623,63	-1.854.497,47	-13,64%	-13,64%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	16.692.740,26	0,00	0,00	14.509.424,35	-2.183.315,91	-13,08%	-13,08%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	15.474.890,30	0,00	0,00	13.195.177,58	-2.279.712,72	-14,73%	-14,73%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.719.151,72	5.895.191,91	0,00	13.457.417,90	-3.156.925,73	-19,00%	-18,94%
				Total Renda Variável	-15.919.859,05	-9,54%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.695.893,73	11.555.340,19	0,00	22.278.819,87	1.027.585,95	4,84%	7,72%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	8.503.260,27	0,00	0,00	9.360.555,98	857.295,71	10,08%	10,08%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	8.875.773,53	0,00	0,00	9.585.291,13	709.517,60	7,99%	7,99%
				Total Exterior	2.594.399,26	6,72%	

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.