

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

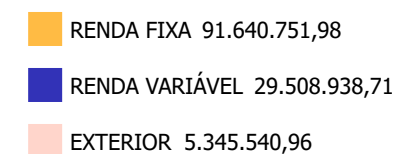
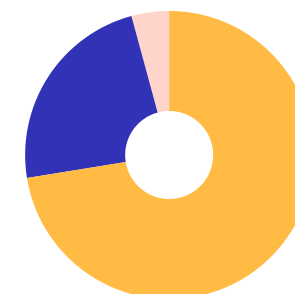
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.234.759,84	4,14%	578	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	23.495.374,07	18,57%	1.014	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.036.800,76	3,98%	770	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	803.994,14	0,64%	650	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	493.542,59	0,39%	165	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	41.462,00	0,03%	85	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	17.432.972,63	13,78%	964	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.235.761,70	4,14%	1.057	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.561.114,28	1,23%	1.013	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	10.319.911,01	8,16%	587	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	197.996,36	0,16%	800	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.089.224,43	4,02%	81	0,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.527.952,92	2,00%	305	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	14.169.885,25	11,20%	4.400	12,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.783.436,65	2,20%	59	2,60%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.728.810,12	2,16%	2.705	0,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.099.758,22	2,45%	34	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	4.770.278,39	3,77%	255	1,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.400.897,82	5,85%	25	0,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.638.772,73	3,67%	16.031	0,11%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.508.478,70	1,98%	131	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	298.506,72	0,24%	1.276	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.279.999,36	1,01%		0,45%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	5.345.540,96	4,23%	494	0,16%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		19.966,84	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			126.495.231,65				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			19.966,84	Artigo 6º			
PL Total			126.515.198,49				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Setembro / 2021)

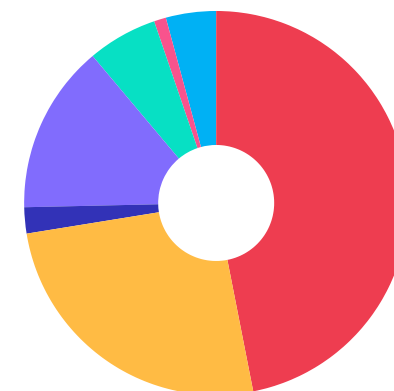
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	59.335.782,01	46,91%	11,20%	50,01%	70,01%	29.223.529,67
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	32.304.969,97	25,54%	4,06%	20,32%	40,00%	18.293.122,69
Total Renda Fixa	100,00%	91.640.751,98	72,45%	15,26%	70,33%	110,01%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	2.783.436,65	2,20%	0,00%	2,00%	5,00%	3.541.324,93
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	17.999.744,55	14,23%	3,69%	17,45%	20,00%	7.299.301,78
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	7.445.758,15	5,89%	3,07%	8,07%	10,00%	5.203.765,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.279.999,36	1,01%	0,00%	1,53%	5,00%	5.044.762,22
Total Renda Variável	30,00%	29.508.938,71	23,33%	6,76%	29,05%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	6.324.761,58
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	5.345.540,96	4,23%	0,00%	0,31%	5,00%	979.220,62
Total Exterior	10,00%	5.345.540,96	4,23%	0,00%	0,62%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	53.400.413,32	42,22	0,00
CAIXA DTVM	42.034.030,57	33,23	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	14.169.885,25	11,20	0,20
TRÍGONO CAPITAL	7.400.897,82	5,85	0,17
META ASSET MANAGEMENT	4.770.278,39	3,77	1,80
ITAÚ UNIBANCO	3.398.264,94	2,69	0,00
ZION INVEST	1.279.999,36	1,01	0,16
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	41.462,00	0,03	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 '	0,00	0,00	11,20	70,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	4,06	40,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	18,45	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,07	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	1,53
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,52%	-3,62%	-1,68%	-0,81%	-1,97%	6,51%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,57%	-3,93%	-1,80%	-1,01%	-2,31%	5,81%	1,75%	0,03%
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,02%	-0,76%	-0,42%	0,89%	2,05%	6,02%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-1,38%	-0,70%	0,51%	1,75%	5,52%	0,80%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
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%
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 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,89%	1,66%	0,87%	2,11%	4,90%	11,72%	0,86%	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%
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%
IMA-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
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%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,47%	2,84%	1,35%	2,27%	3,45%	6,54%	0,04%	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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,35%	1,66%	0,90%	1,43%	1,88%	4,33%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,33%	1,77%	0,91%	1,49%	2,04%	4,77%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	4,66%	2,42%	3,97%	7,69%	13,21%	0,59%	0,01%
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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36%	-1,16%	-1,87%	-0,98%	0,86%	7,32%	0,48%	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
S&P 500 (Benchmark)	-4,76%	14,68%	0,23%	8,42%	28,09%	44,71%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,61%	17,45%	1,14%	9,99%	30,80%	44,41%	6,14%	0,14%
Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%
IBX (Benchmark)	-6,99%	-5,99%	-13,61%	-5,31%	17,82%	7,71%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-7,99%	-20,72%	-20,14%	-16,74%	-6,34%	-2,13%	14,66%	0,23%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,49%	51,44%	-1,98%	27,99%	86,00%	-	12,63%	0,21%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,66%	-13,37%	-17,02%	-9,92%	8,39%	-	13,96%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,52%	-2,28%	-6,51%	0,33%	29,38%	17,40%	12,52%	0,24%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-6,48%	-6,78%	-12,33%	-4,85%	16,73%	5,37%	12,37%	0,23%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	0,59%	-2,45%	-0,11%	4,85%	8,05%	1,80%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,79%	1,44%	-1,87%	0,04%	5,61%	-	2,46%	0,04%
IFIX (Benchmark)	-1,24%	-5,38%	-1,42%	-4,61%	-2,83%	1,17%	-	-

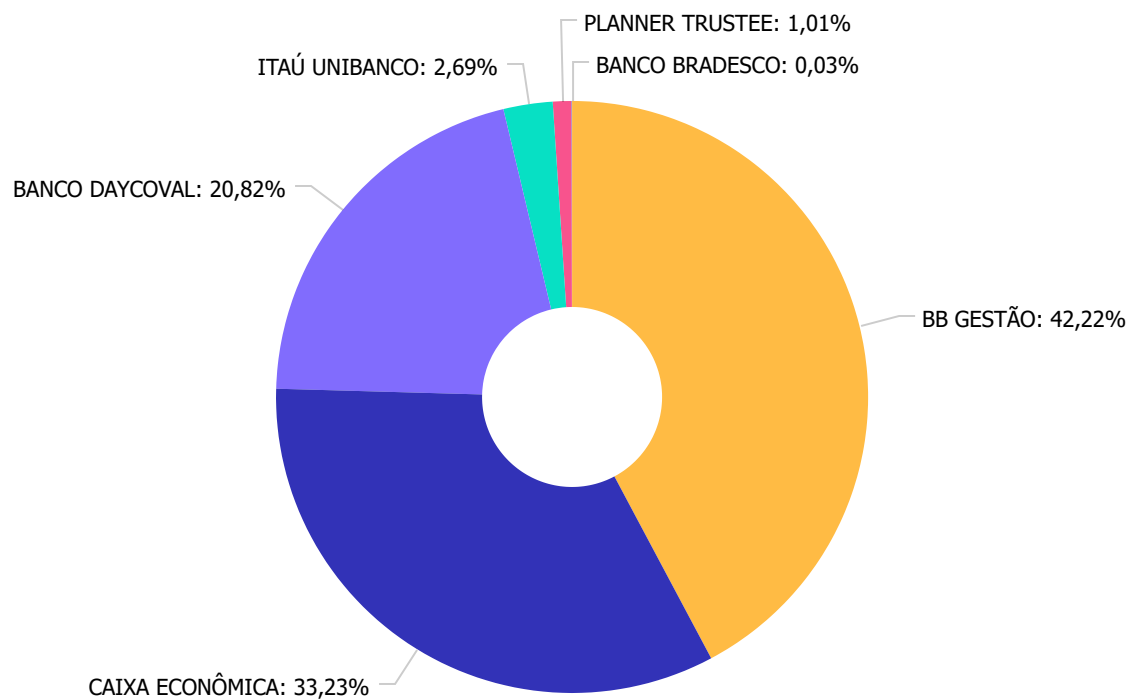
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-12,33%	357,14%	295,06%	492,59%	310,26%	109,15%	20,93%	0,50%

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

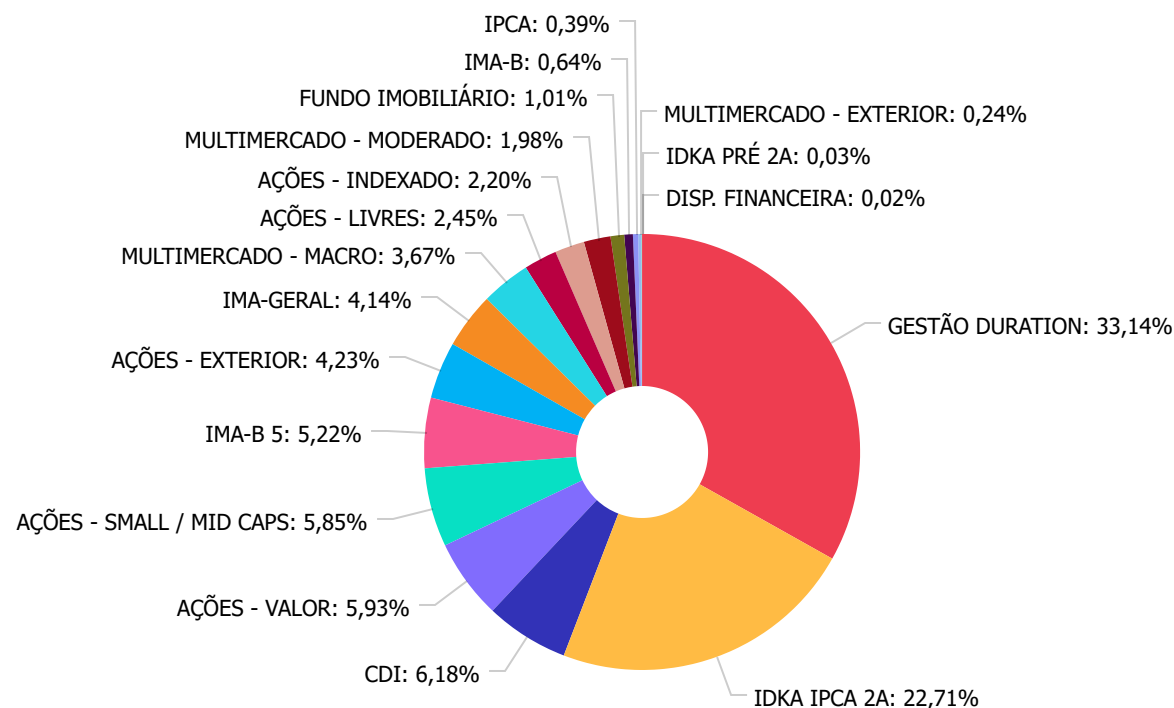
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%

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



BB GESTÃO	53.400.413,32
CAIXA ECONÔMICA	42.034.030,57
BANCO DAYCOVAL	26.341.061,46
ITAÚ UNIBANCO	3.398.264,94
PLANNER TRUSTEE	1.279.999,36
BANCO BRADESCO	41.462,00

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

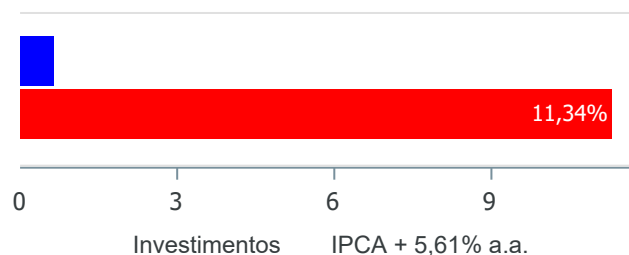


GESTÃO DURATION	41.922.768,89
IDKA IPCA 2A	28.731.135,77
CDI	7.815.173,71
AÇÕES - VALOR	7.499.088,51
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.400.897,82
IMA-B 5	6.597.915,04
AÇÕES - EXTERIOR	5.345.540,96
IMA-GERAL	5.234.759,84
MULTIMERCADO - MACRO	4.638.772,73
AÇÕES - LIVRES	3.099.758,22
AÇÕES - INDEXADO	2.783.436,65
MULTIMERCADO - MODERADO	2.508.478,70
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.279.999,36
IMA-B	803.994,14
IPCA	493.542,59
MULTIMERCADO - EXTERIOR	298.506,72
IDKA PRÉ 2A	41.462,00
DISP. FINANCEIRA	19.966,84

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	124.433.817,54	6.358.552,05	5.784.720,29	123.760.195,90	-1.247.453,40	-1.247.453,40	-1,00%	-1,00%	0,69%	0,69%	-145,63%	3,49%
Fevereiro	123.760.195,90	7.142.278,53	7.765.872,50	121.797.001,65	-1.339.600,28	-2.587.053,68	-1,08%	-2,07%	1,25%	1,95%	-106,25%	3,49%
Março	121.797.001,65	4.474.163,56	3.282.090,84	124.216.164,47	1.227.090,10	-1.359.963,58	1,00%	-1,09%	1,43%	3,41%	-32,04%	3,89%
Abril	124.216.164,47	1.215.849,31	2.366.040,34	124.983.101,10	1.917.127,66	557.164,08	1,54%	0,43%	0,75%	4,18%	10,38%	2,66%
Maio	124.983.101,10	33.245.089,70	33.261.174,78	127.212.758,26	2.245.742,24	2.802.906,32	1,80%	2,24%	1,29%	5,52%	40,52%	3,72%
Junho	127.212.758,26	25.289.447,89	25.740.790,29	127.349.697,45	588.281,59	3.391.187,91	0,46%	2,71%	0,99%	6,57%	41,29%	2,89%
Julho	127.349.697,45	16.118.596,92	14.158.074,13	128.715.447,08	-594.773,16	2.796.414,75	-0,46%	2,24%	1,44%	8,10%	27,63%	2,84%
Agosto	128.715.447,08	8.032.203,15	8.553.143,85	127.236.454,50	-958.051,88	1.838.362,87	-0,74%	1,48%	1,35%	9,57%	15,45%	3,09%
Setembro	127.236.454,50	4.509.363,97	4.212.089,55	126.495.231,65	-1.038.497,27	799.865,60	-0,81%	0,65%	1,62%	11,34%	5,75%	3,28%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

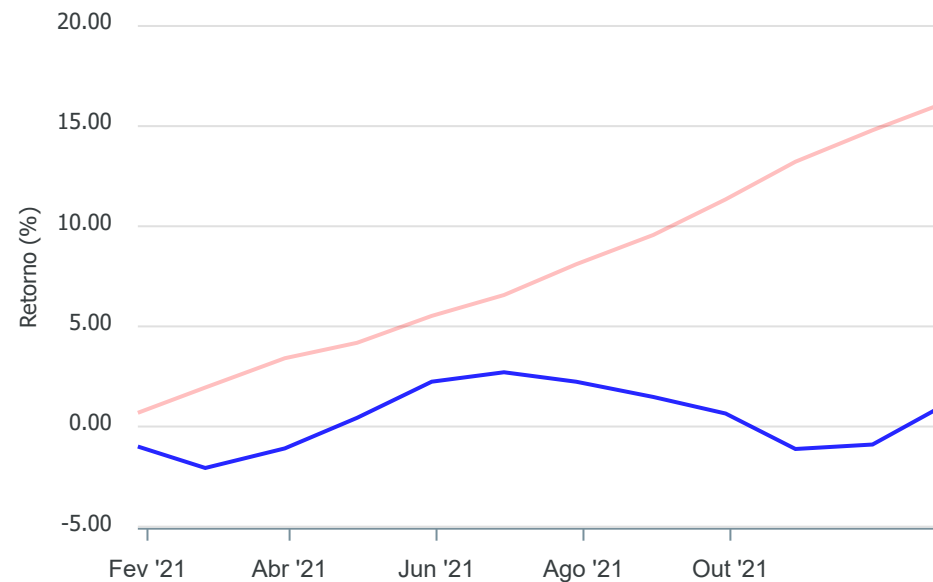
Evolução do Patrimônio



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

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...	487.224,19	0,00	0,00	493.542,59	6.318,40	1,30%	1,30%	0,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.179.906,05	0,00	0,00	5.235.761,70	55.855,65	1,08%	1,08%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	22.239.607,03	1.022.390,80	0,00	23.495.374,07	233.376,24	1,00%	1,03%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.988.038,44	0,00	0,00	5.036.800,76	48.762,32	0,98%	0,98%	0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.555.711,92	0,00	9.755,36	1.561.114,28	15.157,72	0,97%	0,98%	0,81%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	14.045.200,85	0,00	0,00	14.169.885,25	124.684,40	0,89%	0,89%	0,86%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	5.065.601,70	0,00	0,00	5.089.224,43	23.622,73	0,47%	0,47%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.371.312,51	0,00	0,00	17.432.972,63	61.660,12	0,35%	0,35%	0,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	5.002.444,50	25.703,58	2.513.512,21	2.527.952,92	13.317,05	0,26%	0,33%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	921.241,51	961.269,59	1.688.821,98	197.996,36	4.307,24	0,23%	0,35%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.308.858,41	0,00	0,00	10.319.911,01	11.052,60	0,11%	0,11%	0,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.235.037,93	0,00	0,00	5.234.759,84	-278,09	-0,01%	-0,01%	0,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	805.230,60	0,00	0,00	803.994,14	-1.236,46	-0,15%	-0,15%	2,18%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	41.698,79	0,00	0,00	41.462,00	-236,79	-0,57%	-0,57%	1,75%
Total Renda Fixa	93.247.114,43	2.009.363,97	4.212.089,55	91.640.751,98	596.363,13	0,64%		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
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.500.000,00	0,00	2.508.478,70	8.478,70	0,34%	-0,79%	2,46%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.673.345,78	0,00	0,00	4.638.772,73	-34.573,05	-0,74%	-0,74%	1,80%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.799.400,39	0,00	0,00	2.728.810,12	-70.590,27	-2,52%	-2,52%	12,52%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	312.924,19	0,00	0,00	298.506,72	-14.417,47	-4,61%	-4,61%	6,14%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.830.556,92	0,00	0,00	7.400.897,82	-429.659,10	-5,49%	-5,49%	12,63%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	2.976.136,38	0,00	0,00	2.783.436,65	-192.699,73	-6,47%	-6,47%	12,37%
META VALOR FI AÇÕES	5.184.507,76	0,00	0,00	4.770.278,39	-414.229,37	-7,99%	-7,99%	14,66%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.393.525,93	0,00	0,00	3.099.758,22	-293.767,71	-8,66%	-8,66%	13,96%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.459.999,27	0,00	0,00	1.279.999,36	-179.999,91	-12,33%	-12,33%	20,93%
Total Renda Variável	28.630.396,62	2.500.000,00	0,00	29.508.938,71	-1.621.457,91	-5,21%		10,79%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.358.943,45	0,00	0,00	5.345.540,96	-13.402,49	-0,25%	-0,25%	6,75%
Total Exterior	5.358.943,45	0,00	0,00	5.345.540,96	-13.402,49	-0,25%		6,75%

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.404.397,43	7.822.698,17	0,00	23.495.374,07	268.278,47	1,16%	1,30%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	14.047.338,39	0,00	0,00	14.169.885,25	122.546,86	0,87%	0,87%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	5.021.249,57	0,00	0,00	5.089.224,43	67.974,86	1,35%	1,35%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.283.452,90	0,00	4.305.339,07	5.036.800,76	58.686,93	0,63%	1,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.848.493,76	3.600.304,45	270.583,55	5.235.761,70	57.547,04	1,06%	1,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	710.949,87	9.180.639,56	7.382.713,08	2.527.952,92	19.076,57	0,19%	0,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.571.592,31	0,00	27.950,48	1.561.114,28	17.472,45	1,11%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	495.581,37	0,00	13.830,07	493.542,59	11.791,29	2,38%	2,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	406.120,70	5.551.880,76	5.766.507,63	197.996,36	6.502,53	0,11%	0,90%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	16.270,61	0,00	0,00	19.966,84	3.696,23	22,72%	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	37.574,38	4.641,10	0,00	41.462,00	-753,48	-1,78%	-1,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	817.569,14	0,00	0,00	803.994,14	-13.575,00	-1,66%	-1,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.271.804,14	0,00	0,00	5.234.759,84	-37.044,30	-0,70%	-0,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.367.490,86	0,00	0,00	10.319.911,01	-47.579,85	-0,46%	-0,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	22.893.683,99	0,00	5.015.635,19	17.432.972,63	-445.076,17	-1,94%	-1,87%
			Total Renda Fixa		89.544,43	0,10%	

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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.500.000,00	0,00	2.508.478,70	8.478,70	0,34%	-1,87%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	295.154,75	0,00	0,00	298.506,72	3.351,97	1,14%	1,14%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.186.541,55	0,00	4.140.748,46	0,00	-45.793,09	-1,09%	-12,57%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.755.309,12	0,00	0,00	4.638.772,73	-116.536,39	-2,45%	-2,45%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.550.240,76	0,00	0,00	7.400.897,82	-149.342,94	-1,98%	-1,98%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.918.686,39	0,00	0,00	2.728.810,12	-189.876,27	-6,51%	-6,51%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.619.999,19	0,00	0,00	1.279.999,36	-339.999,83	-20,99%	295,06%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.174.921,47	0,00	0,00	2.783.436,65	-391.484,82	-12,33%	-12,33%
ITAÚ ASGARD INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.735.559,22	0,00	0,00	3.099.758,22	-635.801,00	-17,02%	-17,02%
META VALOR FI AÇÕES	5.973.440,04	0,00	0,00	4.770.278,39	-1.203.161,65	-20,14%	-20,14%
				Total Renda Variável	-3.060.165,32	-8,34%	

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 4.963/2021, 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 4.963 de 25 de novembro de 2021 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.