

CRÉDITO E MERCADO

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

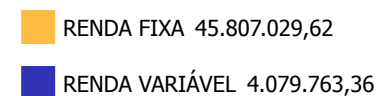
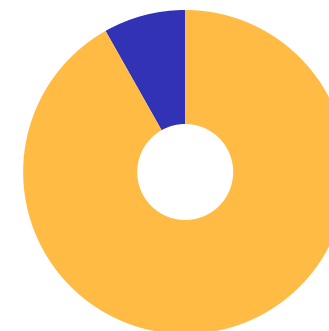
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.925.163,75	9,87%	1.014	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	989.660,72	1,98%	770	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.741.355,72	3,49%	257	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.881.116,96	3,77%	650	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.089.287,77	6,19%	1.140	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.651.836,33	3,31%	581	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.164.128,21	4,34%	1.013	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	5.959.923,85	11,95%	300	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	1.904.327,97	3,82%	198	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.608.653,92	7,23%	1.264	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.130.746,42	8,28%	294	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	4.948.795,64	9,92%	293	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	4.293.081,36	8,61%	768	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.362.645,93	4,74%	173	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.080.280,75	2,17%	249	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	536.216,67	1,07%	18	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	402.339,66	0,81%	15	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	137.467,99	0,28%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.713.172,66	3,43%	113	0,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.090.071,35	2,19%	36.305	0,03%	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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.276.519,35	2,56%	111	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			49.886.792,98				

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

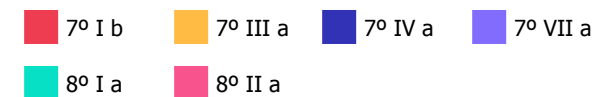
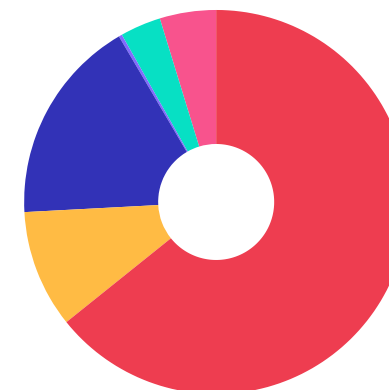
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	32.046.201,62	64,24%	9,49%	42,30%	80,00%	7.863.232,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.948.795,64	9,92%	0,00%	10,00%	20,00%	5.028.562,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	8.674.564,37	17,39%	4,04%	21,50%	40,00%	11.280.152,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	137.467,99	0,28%	0,00%	1,00%	1,00%	361.399,94
Total Renda Fixa	100,00%	45.807.029,62	91,82%	13,53%	74,80%	141,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	1.713.172,66	3,43%	0,00%	4,50%	10,00%	3.275.506,64
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.366.590,70	4,74%	3,00%	14,50%	2,00%	-1.368.854,84
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,50%	10,00%	4.988.679,30
Total Renda Variável	30,00%	4.079.763,36	8,18%	3,00%	24,50%	22,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,35%	5,00%	2.494.339,65
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,35%	5,00%	2.494.339,65
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,70%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.792.394,60	53,71	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.571.502,61	37,23	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.446.871,45	6,91	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	938.556,33	1,88	0,03
PETRA CAPITAL	137.467,99	0,28	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 '	32.046.201,62	64,24	9,49	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.948.795,64	9,92	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	8.674.564,37	17,39	4,04	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	137.467,99	0,28	0,00	1,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	2.366.590,70	4,74	18,24	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, 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
IMA Geral (Benchmark)	-0,01%	-0,38%	-0,52%	0,96%	2,48%	6,93%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,02%	-0,97%	-0,53%	0,71%	1,85%	5,72%	0,91%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,73%	-5,87%	-2,65%	-1,15%	-3,14%	4,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,78%	-6,12%	-2,78%	-1,40%	-3,39%	3,69%	2,06%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,26%	-6,63%	-4,19%	-1,61%	3,20%	1,48%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,27%	-6,87%	-4,33%	-1,81%	2,97%	0,80%	3,71%	0,10%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,30%	-6,78%	-4,26%	-1,76%	2,89%	0,97%	3,81%	0,09%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
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%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	2,30%	1,13%	2,53%	5,69%	13,00%	0,81%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,98%	2,29%	1,11%	2,49%	5,70%	13,04%	0,82%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,14%	-2,46%	-1,64%	0,45%	4,47%	6,28%	2,20%	0,06%

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

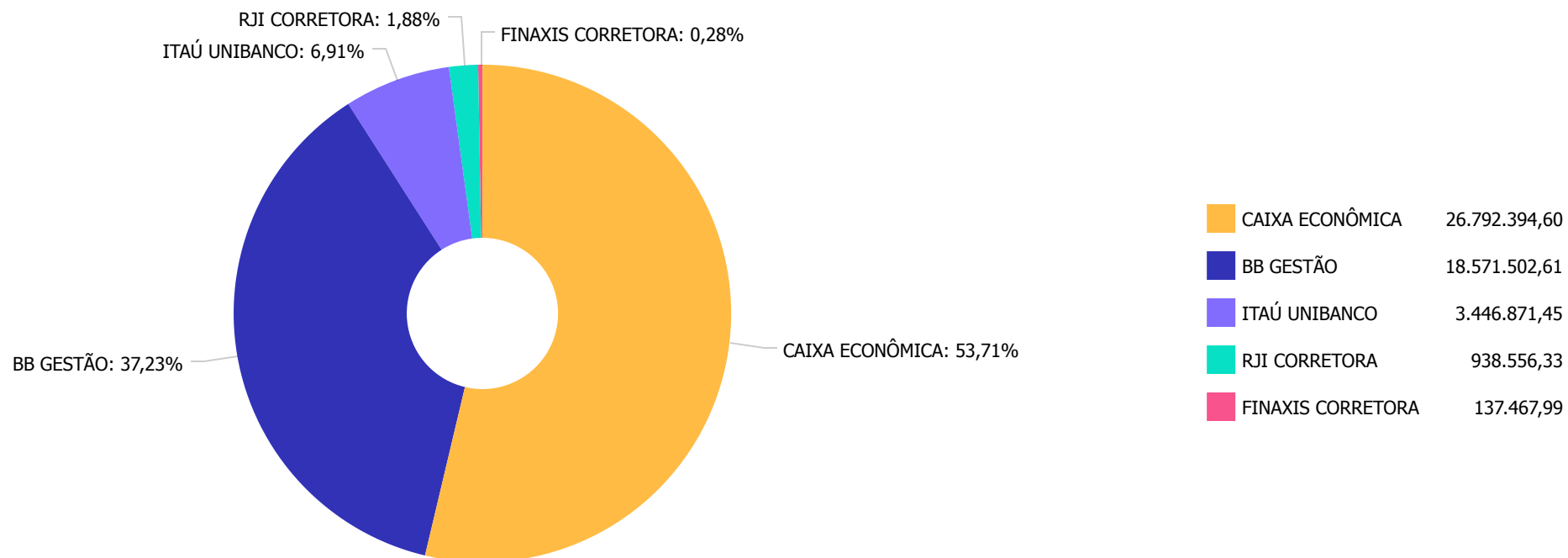
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	-2,47%	-1,66%	0,40%	4,49%	6,40%	2,18%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	-0,33%	-2,95%	-1,39%	-0,15%	-1,02%	5,48%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,38%	-3,19%	-1,51%	-0,38%	-1,26%	4,87%	1,41%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	2,28%	1,19%	1,90%	2,87%	6,32%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	2,64%	1,31%	2,13%	3,23%	6,30%	0,03%	0,00%
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%
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,18%	-4,86%	-0,68%	-4,29%	-5,30%	-9,94%	0,01%	0,03%
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%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-13,57%	-45,13%	-19,42%	-29,59%	-46,52%	-69,07%	20,86%	0,17%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,51%	-44,23%	-42,01%	-44,46%	-47,09%	-50,87%	1,93%	0,42%

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

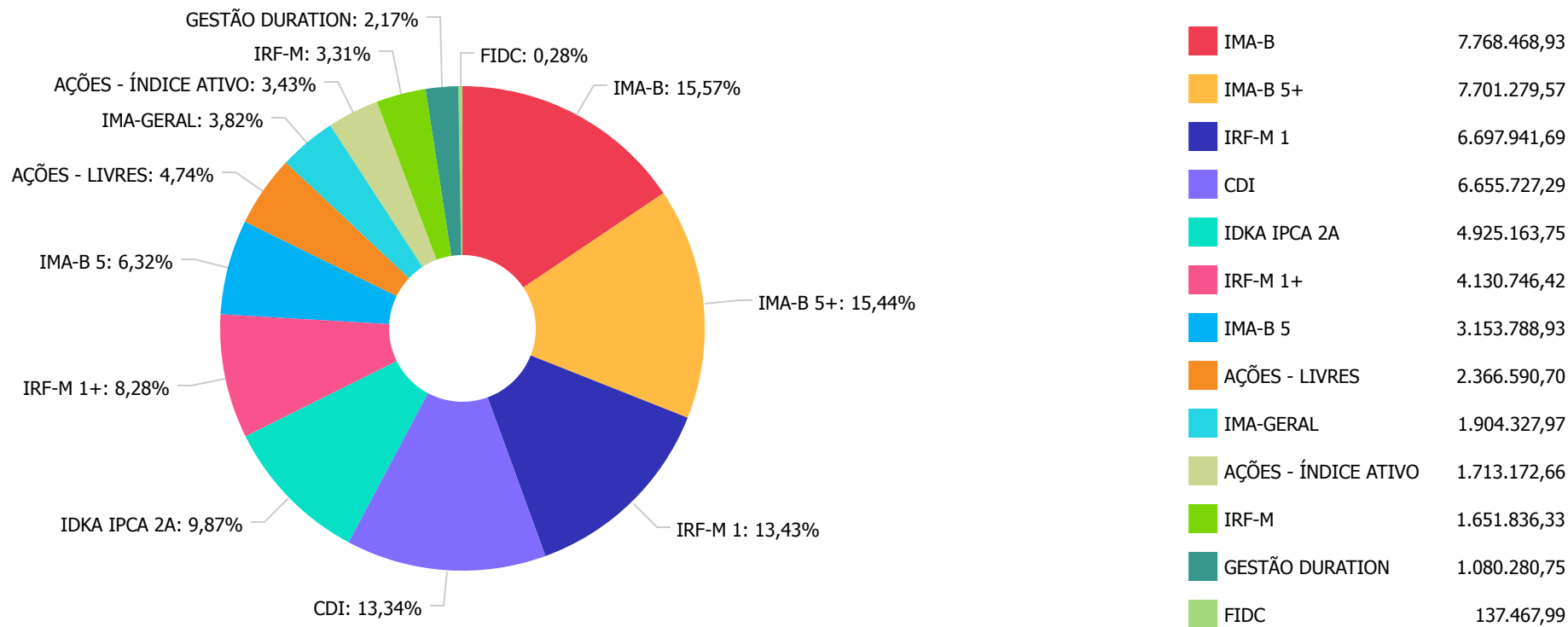
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	-7,47%	-6,33%	-14,15%	-5,58%	18,46%	6,59%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-7,25%	-6,05%	-14,34%	-5,34%	17,51%	5,44%	12,81%	0,23%

Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,10%	-3,73%	-12,45%	0,03%	13,48%	-13,14%	12,57%	0,22%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,52%	-0,57%	-11,40%	-1,65%	19,26%	6,71%	10,48%	0,18%

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



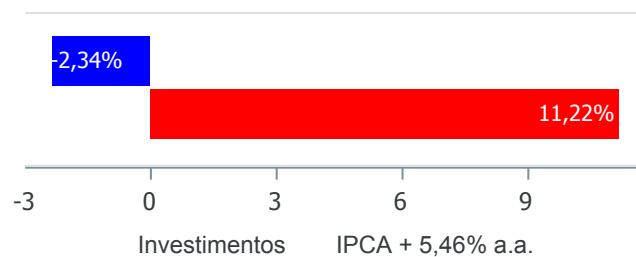
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

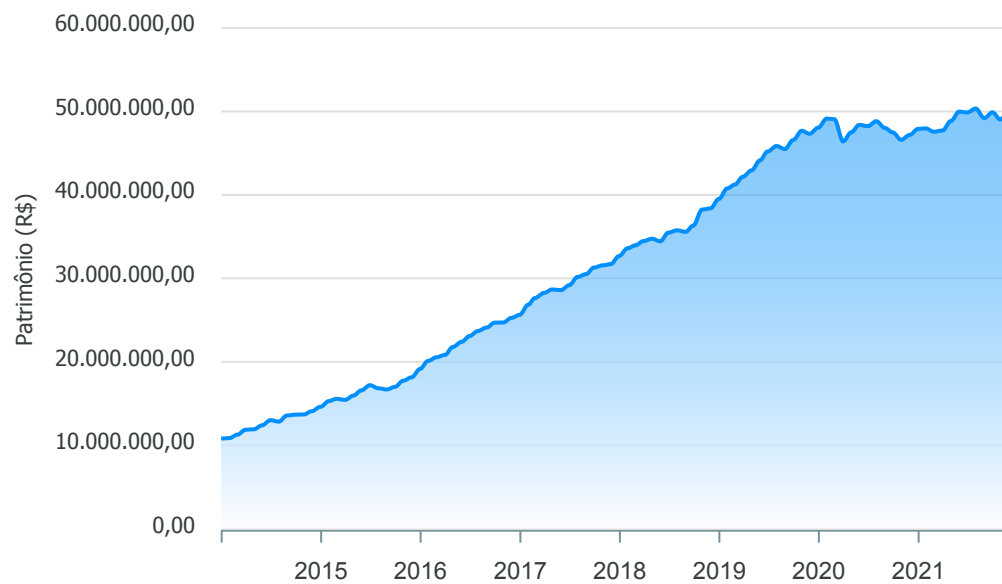
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.908.959,14	430.000,00	0,00	47.969.639,63	-369.319,51	-369.319,51	-0,76%	-0,76%	0,67%	0,67%	-113,38%	2,65%
Fevereiro	47.969.639,63	1.350.000,00	1.195.681,98	47.564.856,59	-559.101,06	-928.420,57	-1,16%	-1,92%	1,24%	1,93%	-99,53%	2,63%
Março	47.564.856,59	970.000,00	836.113,78	47.716.678,62	17.935,81	-910.484,76	0,04%	-1,88%	1,42%	3,37%	-55,72%	3,12%
Abril	47.716.678,62	1.500.000,00	773.218,82	48.844.689,14	401.229,34	-509.255,42	0,83%	-1,07%	0,73%	4,13%	-25,83%	2,10%
Mai	48.844.689,14	1.355.000,00	808.449,32	49.979.322,14	588.082,32	78.826,90	1,19%	0,11%	1,28%	5,46%	2,02%	2,30%
Junho	49.979.322,14	1.170.000,00	1.436.803,65	49.876.366,04	163.847,55	242.674,45	0,33%	0,44%	0,98%	6,49%	6,76%	1,98%
Julho	49.876.366,04	1.474.000,00	780.618,23	50.348.975,90	-220.771,91	21.902,54	-0,44%	0,00%	1,43%	8,02%	0,00%	2,09%
Agosto	50.348.975,90	1.230.000,00	1.575.792,13	49.205.403,94	-797.779,83	-775.877,29	-1,58%	-1,58%	1,34%	9,46%	-16,74%	3,32%
Setembro	49.205.403,94	1.100.000,00	30.000,00	49.886.792,98	-388.610,96	-1.164.488,25	-0,77%	-2,34%	1,61%	11,22%	-20,89%	2,48%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



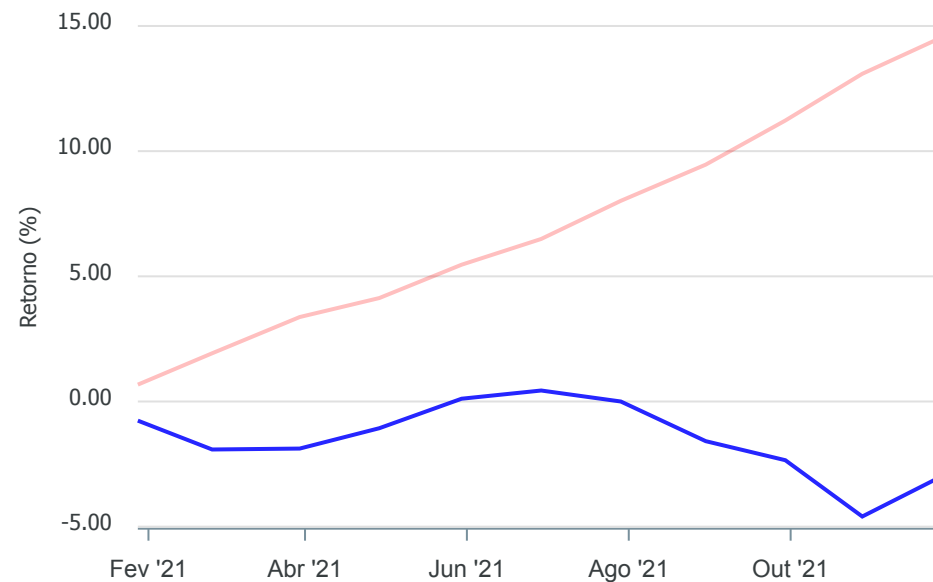
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.874.785,46	0,00	0,00	4.925.163,75	50.378,29	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.143.102,97	0,00	0,00	2.164.128,21	21.025,24	0,98%	0,98%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	980.079,61	0,00	0,00	989.660,72	9.581,11	0,98%	0,98%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.071.314,67	0,00	0,00	1.080.280,75	8.966,08	0,84%	0,84%	0,54%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	533.513,23	0,00	0,00	536.216,67	2.703,44	0,51%	0,51%	1,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.273.460,31	0,00	0,00	4.293.081,36	19.621,05	0,46%	0,46%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.595.057,40	0,00	0,00	3.608.653,92	13.596,52	0,38%	0,38%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.078.012,50	0,00	0,00	3.089.287,77	11.275,27	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.284.214,77	1.100.000,00	30.000,00	2.362.645,93	8.431,16	0,35%	0,42%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.904.648,08	0,00	0,00	1.904.327,97	-320,11	-0,02%	-0,02%	0,91%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	4.955.856,79	0,00	0,00	4.948.795,64	-7.061,15	-0,14%	-0,14%	2,20%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.884.009,93	0,00	0,00	1.881.116,96	-2.892,97	-0,15%	-0,15%	2,18%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	137.718,08	0,00	0,00	137.467,99	-250,09	-0,18%	-0,18%	0,01%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.658.067,84	0,00	0,00	1.651.836,33	-6.231,51	-0,38%	-0,38%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.163.198,86	0,00	0,00	4.130.746,42	-32.452,44	-0,78%	-0,78%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	6.036.293,40	0,00	0,00	5.959.923,85	-76.369,55	-1,27%	-1,27%	3,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.764.322,10	0,00	0,00	1.741.355,72	-22.966,38	-1,30%	-1,30%	3,81%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	465.494,13	0,00	0,00	402.339,66	-63.154,47	-13,57%	-13,57%	20,86%
Total Renda Fixa	44.803.150,13	1.100.000,00	30.000,00	45.807.029,62	-66.120,51	-0,14%		1,63%

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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.166.123,34	0,00	0,00	1.090.071,35	-76.051,99	-6,52%	-6,52%	10,48%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.847.158,75	0,00	0,00	1.713.172,66	-133.986,09	-7,25%	-7,25%	12,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.388.971,72	0,00	0,00	1.276.519,35	-112.452,37	-8,10%	-8,10%	12,57%
Total Renda Variável	4.402.253,81	0,00	0,00	4.079.763,36	-322.490,45	-7,33%		12,11%

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...	4.862.043,19	0,00	0,00	4.925.163,75	63.120,56	1,30%	1,30%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.237.776,07	0,00	0,00	4.293.081,36	55.305,29	1,31%	1,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.576.785,97	0,00	0,00	3.608.653,92	31.867,95	0,89%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.062.718,75	0,00	0,00	3.089.287,77	26.569,02	0,87%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.888.784,97	0,00	750.000,00	2.164.128,21	25.343,24	0,88%	1,13%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	438.024,08	3.485.000,00	1.580.000,00	2.362.645,93	19.621,85	0,50%	1,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.066.378,64	0,00	0,00	1.080.280,75	13.902,11	1,30%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	719.295,80	260.000,00	0,00	989.660,72	10.364,92	1,06%	1,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	138.413,31	0,00	0,00	137.467,99	-945,32	-0,68%	-0,68%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.914.410,59	0,00	0,00	1.904.327,97	-10.082,62	-0,53%	-0,53%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.617.675,92	59.000,00	0,00	1.651.836,33	-24.839,59	-1,48%	-1,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.912.878,60	0,00	0,00	1.881.116,96	-31.761,64	-1,66%	-1,66%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	499.302,21	0,00	39.477,67	402.339,66	-57.484,88	-11,51%	-19,42%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.818.895,92	0,00	0,00	1.741.355,72	-77.540,20	-4,26%	-4,26%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	5.031.504,63	0,00	0,00	4.948.795,64	-82.708,99	-1,64%	-1,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.248.866,32	0,00	0,00	4.130.746,42	-118.119,90	-2,78%	-2,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	6.229.628,71	0,00	0,00	5.959.923,85	-269.704,86	-4,33%	-4,33%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	924.705,55	0,00	16.932,69	536.216,67	-371.556,19	-40,18%	-42,01%
				Total Renda Fixa	-798.649,25	-1,71%	

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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.230.266,35	0,00	0,00	1.090.071,35	-140.195,00	-11,40%	-11,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.458.011,29	0,00	0,00	1.276.519,35	-181.491,94	-12,45%	-12,45%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.999.999,17	0,00	0,00	1.713.172,66	-286.826,51	-14,34%	-14,34%
				Total Renda Variável	-608.513,45	-12,98%	

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.