

CRÉDITO e MERCADO

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

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

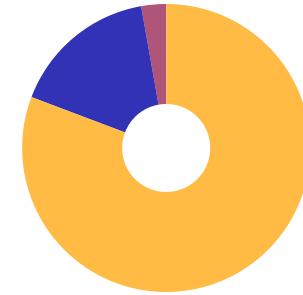
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.053.614,69	1,40%	578	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.607.582,67	16,76%	1.014	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	649.572,04	0,86%	1.140	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.067.862,82	9,40%	964	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.207.567,97	16,23%	1.057	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.237.645,55	8,29%	1.264	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.017.254,45	1,35%	768	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.120.435,12	2,82%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.226.369,00	12,27%	305	1,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.351.426,56	7,12%	500	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	178.908,70	0,24%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	205.721,60	0,27%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	Não há	967.212,33	1,29%	8	5,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.115.326,74	1,48%	33	0,73%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	720.368,02	0,96%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	344.576,66	0,46%	906	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.554.170,86	2,07%	137	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.224.898,09	2,96%	35.035	0,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.169.860,59	2,89%	25	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.081.845,37	1,44%	16.031	0,03%	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
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	18.207,07	0,02%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	1.103.486,21	1,47%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.478.585,11	3,30%	28	1,81%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	330.322,56	0,44%		0,12%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.078.998,95	1,43%		1,48%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.047.060,66	1,39%	24.127	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.046.041,85	1,39%	494	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		5.049,48	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução				75.204.922,24			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				5.049,48			Artigo 6º
				PL Total	75.209.971,72		

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

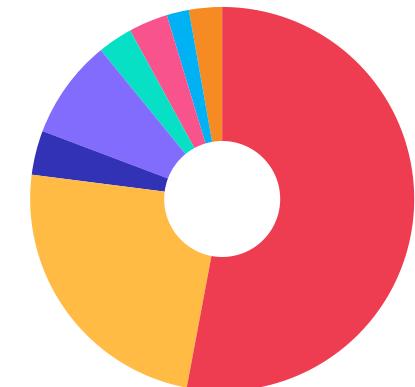
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	39.823.845,74	52,95%	9,80%	52,10%	80,00%	20.340.092,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.520.492,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	18.100.115,43	24,07%	3,56%	17,50%	40,00%	11.981.853,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2.802.907,09	3,73%	0,00%	5,00%	5,00%	957.339,02
Total Renda Fixa	100,00%	60.726.868,26	80,75%	13,36%	74,60%	135,00%	



- █ RENDA FIXA 60.726.868,26
- █ RENDA VARIÁVEL 12.384.951,47
- █ EXTERIOR 2.093.102,51

Enquadramento 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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.520.492,22
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	6.293.506,20	8,37%	1,00%	14,00%	20,00%	8.747.478,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.203.538,65	2,93%	3,00%	5,00%	10,00%	5.316.953,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	2.478.585,11	3,30%	0,00%	3,70%	5,00%	1.281.661,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.409.321,51	1,87%	0,00%	2,25%	5,00%	2.350.924,60
Total Renda Variável	30,00%	12.384.951,47	16,47%	4,00%	24,95%	50,00%	



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%	0,20%	5,00%	3.760.246,11
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.093.102,51	2,78%	0,00%	0,25%	5,00%	1.667.143,60
Total Exterior	10,00%	2.093.102,51	2,78%	0,00%	0,45%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	43.772.929,98	58,20	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.719.661,17	22,23	0,00
TRÍGONO CAPITAL	4.394.758,68	5,84	0,10
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.900.113,11	5,19	2,19
KPTL	2.478.585,11	3,30	0,64
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.120.435,12	2,82	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.103.486,21	1,47	0,12
ZION INVEST	330.322,56	0,44	0,04
PLURAL	205.721,60	0,27	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	178.908,70	0,24	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	9,80	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	3,56	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	14,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	5,00	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, 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
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%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,81%	13,22%	5,09%	8,89%	19,03%	32,58%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3,28%	-41,40%	-	-26,26%	-56,58%	-57,25%	-	0,68%

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%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,73%	12,43%	4,83%	8,38%	17,93%	30,14%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-2,38%	-3,97%	-3,65%	-4,05%	-3,89%	-25,56%	-	0,06%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,48%	-1,60%	0,51%	1,01%	-0,54%	-7,02%	0,62%	0,03%

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%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,30%	-0,86%	-0,11%	-0,21%	-22,60%	-37,21%	0,34%	0,22%

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,13%	-27,13%	-4,66%	-20,78%	-66,79%	-77,82%	0,25%	0,54%

CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	2,39%	1,22%	1,95%	2,87%	6,17%	0,03%	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%
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%	-	-
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%

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,01%	15,17%	5,71%	10,15%	21,77%	38,78%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,10%	2,21%	-0,37%	-2,01%	1,88%	-	-	0,04%

Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,62%	17,77%	9,07%	3,96%	18,60%	85,75%	6,92%	0,10%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%

IDIV (Benchmark)	-4,48%	-4,67%	-6,59%	-1,51%	19,58%	7,85%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	-4,63%	53,64%	0,34%	27,56%	97,30%	151,64%	11,77%	0,19%

Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,75%	6,80%	-10,94%	3,12%	28,12%	29,33%	14,09%	0,20%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-7,05%	-8,20%	-14,12%	-5,86%	14,97%	0,89%	12,29%	0,23%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,49%	51,44%	-1,98%	27,99%	86,00%	-	12,63%	0,21%

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%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,40%	-3,58%	-1,21%	-2,38%	-4,71%	-2,52%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

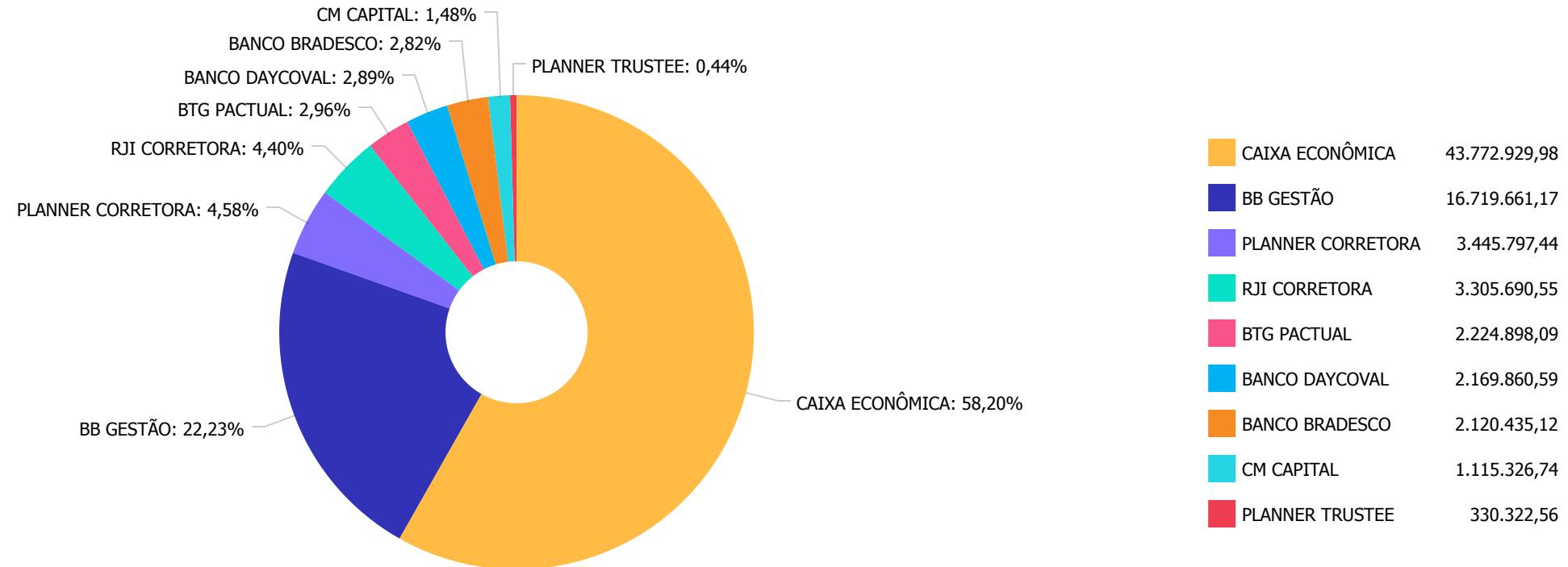
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,35%	-2,53%	-4,98%	-4,73%	-1,53%	-11,70%	0,74%	0,05%
IFIX (Benchmark)	-1,24%	-5,38%	-1,42%	-4,61%	-2,83%	1,17%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-12,33%	357,14%	295,06%	492,59%	310,26%	109,15%	20,93%	0,50%
HAZ FII - ATCR11	0,14%	0,98%	-0,08%	1,21%	0,82%	390,15%	-	-

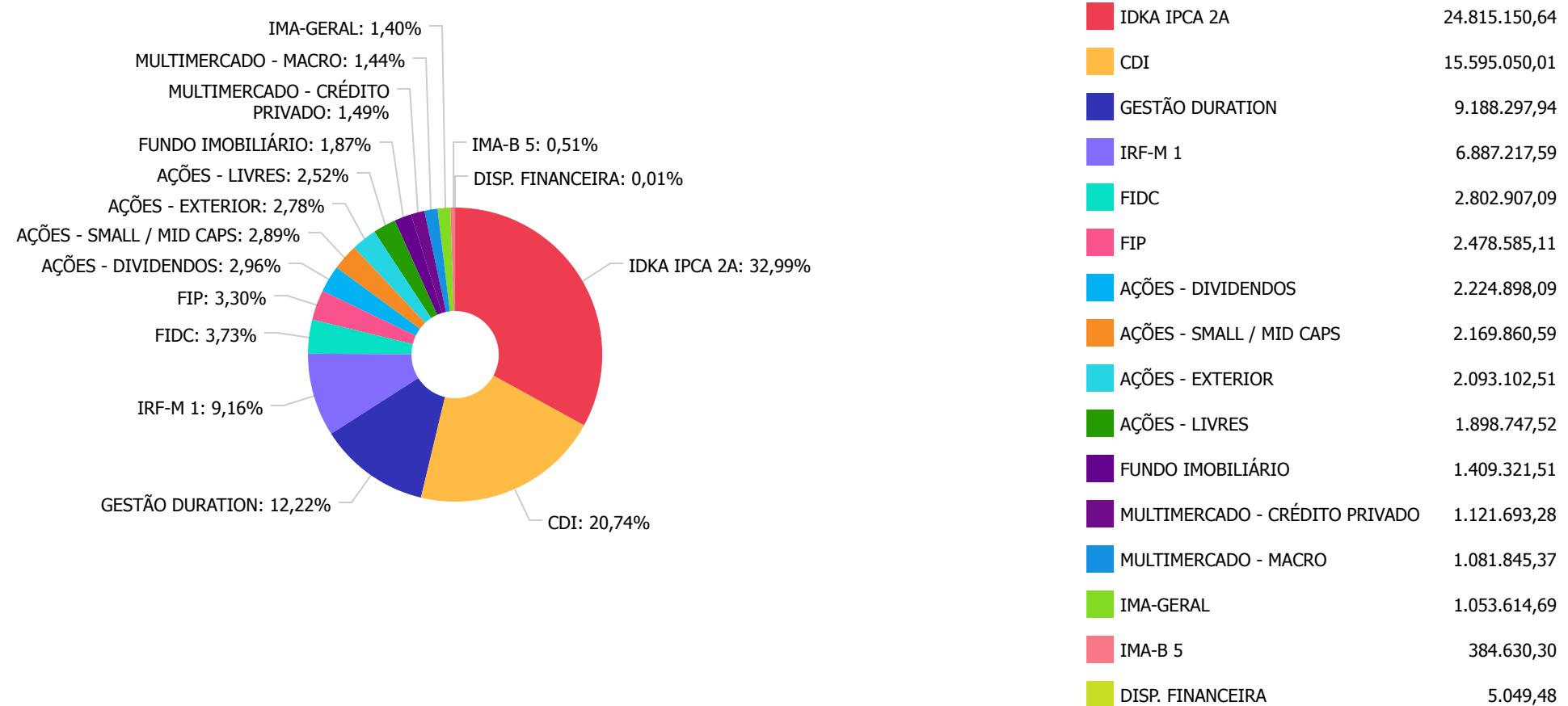
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,62%	17,77%	9,07%	3,96%	18,60%	85,75%	6,92%	0,10%
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)



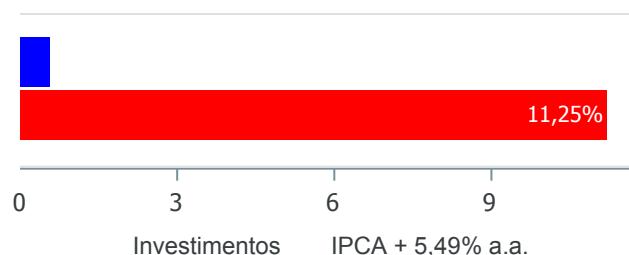
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

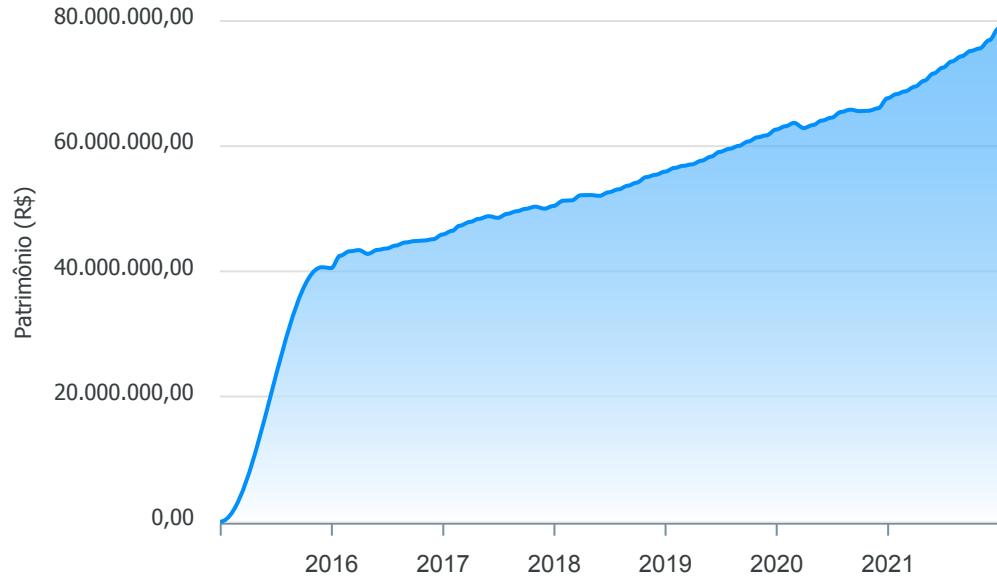
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	67.656.852,62	1.020.204,38	319.089,73	68.308.677,47	-49.289,80	-49.289,80	-0,07%	-0,07%	0,68%	0,68%	-10,66%	0,83%
Fevereiro	68.308.677,47	1.065.703,57	372.839,51	68.745.429,68	-256.111,85	-305.401,65	-0,37%	-0,44%	1,25%	1,93%	-22,95%	1,19%
Março	68.745.429,68	1.177.148,87	272.159,02	69.509.377,76	-141.041,77	-446.443,42	-0,20%	-0,64%	1,42%	3,38%	-19,06%	1,12%
Abril	69.509.377,76	1.099.850,75	356.501,08	70.442.385,96	189.658,53	-256.784,89	0,27%	-0,38%	0,74%	4,14%	-9,09%	0,99%
Maio	70.442.385,96	14.095.470,75	13.338.701,02	71.613.240,97	414.085,28	157.300,39	0,58%	0,20%	1,28%	5,48%	3,71%	1,98%
Junho	71.613.240,97	8.877.259,80	8.173.293,74	72.540.078,89	222.871,86	380.172,25	0,31%	0,51%	0,98%	6,51%	7,86%	1,86%
Julho	72.540.078,89	1.269.001,63	357.441,79	73.531.648,39	80.009,66	460.181,91	0,11%	0,62%	1,43%	8,03%	7,73%	1,71%
Agosto	73.531.648,39	1.231.617,24	355.355,85	74.356.700,98	-51.208,80	408.973,11	-0,07%	0,55%	1,34%	9,48%	5,82%	2,31%
Setembro	74.356.700,98	1.201.737,94	356.064,15	75.204.922,24	2.547,47	411.520,58	0,00%	0,56%	1,61%	11,25%	4,94%	1,89%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

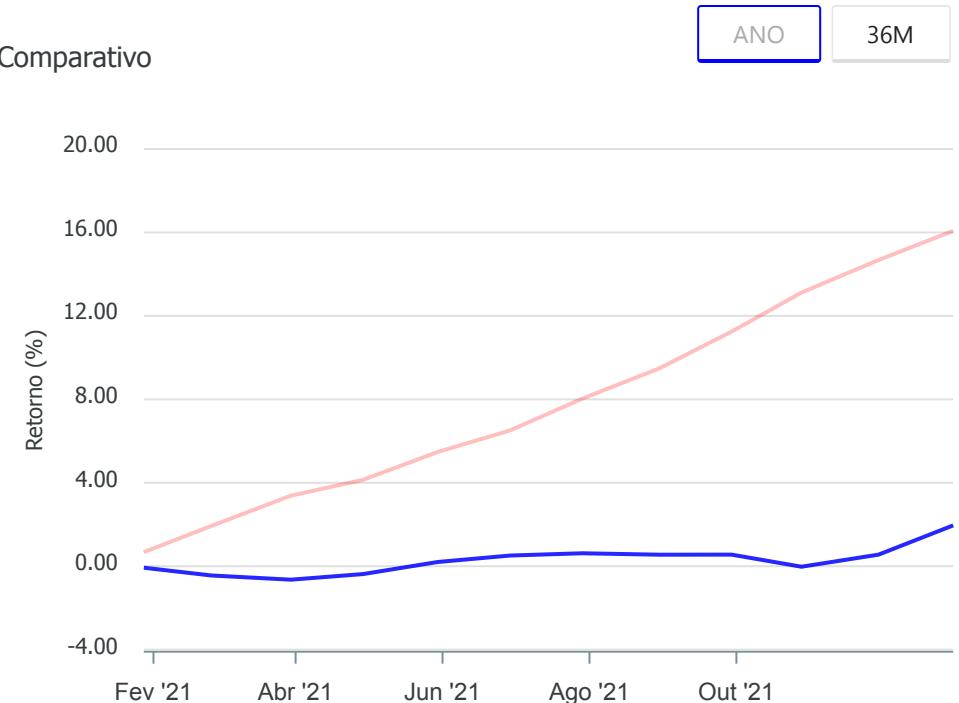


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos	Meta de Rentabilidade	<input type="checkbox"/> CDI	<input type="checkbox"/> IMA-B	
<input type="checkbox"/> IMA-B 5	<input type="checkbox"/> IMA-B 5+	<input type="checkbox"/> IMA Geral	<input type="checkbox"/> IRF-M	<input type="checkbox"/> IRF-M 1
<input type="checkbox"/> IRF-M 1+	<input type="checkbox"/> Ibovespa	<input type="checkbox"/> IBX	<input type="checkbox"/> SMILL	<input type="checkbox"/> 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
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	936.466,31	0,00	0,00	967.212,33	30.746,02	3,28%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.077.336,36	0,00	0,00	12.207.567,97	130.231,61	1,08%	1,08%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.478.622,78	0,00	0,00	12.607.582,67	128.959,89	1,03%	1,03%	0,73%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	716.902,39	0,00	0,00	720.368,02	3.465,63	0,48%	0,48%	0,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.012.605,20	0,00	0,00	1.017.254,45	4.649,25	0,46%	0,46%	0,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.328.466,01	0,00	0,00	5.351.426,56	22.960,55	0,43%	0,43%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.214.143,65	0,00	0,00	6.237.645,55	23.501,90	0,38%	0,38%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	647.201,23	0,00	0,00	649.572,04	2.370,81	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.042.863,91	0,00	0,00	7.067.862,82	24.998,91	0,35%	0,35%	0,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	8.351.243,44	1.201.737,94	356.064,15	9.226.369,00	29.451,77	0,31%	0,33%	0,01%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	178.371,61	0,00	0,00	178.908,70	537,09	0,30%	0,30%	0,34%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.053.670,66	0,00	0,00	1.053.614,69	-55,97	-0,01%	-0,01%	0,80%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	205.984,04	0,00	0,00	205.721,60	-262,44	-0,13%	-0,13%	0,25%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.123.705,49	0,00	0,00	2.120.435,12	-3.270,37	-0,15%	-0,15%	1,07%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.142.680,94	0,00	0,00	1.115.326,74	-27.354,20	-2,39%	-	-
Total Renda Fixa	59.510.264,02	1.201.737,94	356.064,15	60.726.868,26	370.930,45	0,61%		0,48%

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
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.099.648,92	0,00	0,00	1.103.486,21	3.837,29	0,35%	0,35%	0,74%
HAZ FII - ATCR11	1.077.456,87	0,00	0,00	1.078.998,95	1.542,08	0,14%	0,14%	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.480.989,21	0,00	0,00	2.478.585,11	-2.404,10	-0,10%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.280,27	0,00	0,00	18.207,07	-73,20	-0,40%	-0,40%	0,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.089.908,43	0,00	0,00	1.081.845,37	-8.063,06	-0,74%	-0,74%	1,80%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.614.651,11	0,00	0,00	1.554.170,86	-60.480,25	-3,75%	-3,75%	14,09%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.332.908,19	0,00	0,00	2.224.898,09	-108.010,10	-4,63%	-4,63%	11,77%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.295.831,84	0,00	0,00	2.169.860,59	-125.971,25	-5,49%	-5,49%	12,63%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	370.719,99	0,00	0,00	344.576,66	-26.143,33	-7,05%	-7,05%	12,29%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	376.774,17	0,00	0,00	330.322,56	-46.451,61	-12,33%	-12,33%	20,93%
Total Renda Variável	12.757.169,00	0,00	0,00	12.384.951,47	-372.217,53	-2,92%		10,13%

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 AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.040.603,44	0,00	0,00	1.047.060,66	6.457,22	0,62%	0,62%	6,92%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.048.664,52	0,00	0,00	1.046.041,85	-2.622,67	-0,25%	-0,25%	6,75%
Total Exterior	2.089.267,96	0,00	0,00	2.093.102,51	3.834,55	0,18%		6,84%

Retorno dos Investimentos apóas 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...	12.446.004,76	0,00	0,00	12.607.582,67	161.577,91	1,30%	1,30%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.061.745,42	0,00	0,00	12.207.567,97	145.822,55	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.519.834,61	3.702.356,81	1.067.996,13	9.226.369,00	72.173,71	0,71%	0,91%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.287.034,49	0,00	0,00	5.351.426,56	64.392,07	1,22%	1,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.182.561,02	0,00	0,00	6.237.645,55	55.084,53	0,89%	0,89%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	940.746,12	0,00	0,00	967.212,33	26.466,21	2,81%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.004.149,75	0,00	0,00	1.017.254,45	13.104,70	1,31%	1,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	643.985,48	0,00	0,00	649.572,04	5.586,56	0,87%	0,87%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	716.696,38	0,00	0,00	720.368,02	3.671,64	0,51%	0,51%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	179.100,89	0,00	0,00	178.908,70	-192,19	-0,11%	-0,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.061.070,70	0,00	0,00	1.053.614,69	-7.456,01	-0,70%	-0,70%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	215.786,07	0,00	0,00	205.721,60	-10.064,47	-4,66%	-4,66%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.138.738,38	0,00	0,00	2.120.435,12	-18.303,26	-0,86%	-0,86%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.157.537,54	0,00	0,00	1.115.326,74	-42.210,80	-3,65%	-3,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.202.320,49	0,00	0,00	7.067.862,82	-134.457,67	-1,87%	-1,87%
				Total Renda Fixa	335.195,48	0,56%	

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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	959.963,14	0,00	0,00	1.047.060,66	87.097,52	9,07%	9,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	971.095,54	0,00	0,00	1.046.041,85	74.946,31	7,72%	7,72%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.217.337,96	0,00	0,00	2.224.898,09	7.560,13	0,34%	0,34%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.429,39	0,00	0,00	18.207,07	-222,32	-1,21%	-1,21%
HAZ FII - ATCR11	1.079.849,34	0,00	0,00	1.078.998,95	-850,39	-0,08%	-0,08%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.487.701,04	0,00	0,00	2.478.585,11	-9.115,93	-0,37%	-0,37%
CAIXA alocação MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.109.023,76	0,00	0,00	1.081.845,37	-27.178,39	-2,45%	-2,45%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.213.646,27	0,00	0,00	2.169.860,59	-43.785,68	-1,98%	-1,98%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	401.228,37	0,00	0,00	344.576,66	-56.651,71	-14,12%	-14,12%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.161.351,99	0,00	0,00	1.103.486,21	-57.865,78	-4,98%	-4,98%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	418.064,49	0,00	865,66	330.322,56	-86.876,27	-20,78%	295,06%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.745.075,50	0,00	0,00	1.554.170,86	-190.904,64	-10,94%	-10,94%
				Total Renda Variável	-303.847,15	-2,06%	

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.

