

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
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.342.620,83	3,64%	36	4,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.347.575,66	5,71%	22	11,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	15.474.418,12	4,57%	581	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	5.082.873,81	1,50%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	6.973.121,08	2,06%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	541.010,59	0,16%	165	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.438.820,00	2,49%	105	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.524.456,25	2,81%	74	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	8.782.740,00	2,59%	18	13,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	47.605.590,46	14,05%	964	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	25.812,01	0,01%	1.013	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.272.738,17	2,15%	1.264	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	19.330.664,36	5,71%	361	1,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.646.950,53	0,49%	293	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	19.283.664,28	5,69%	259	13,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.009.702,98	0,30%	14.070	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.972.169,40	0,58%	181	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	50.345.492,93	14,86%	587	1,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.865.283,73	0,55%	768	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	11.060.851,25	3,26%	74	1,74%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

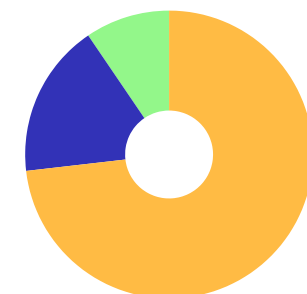
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	13.878.919,35	4,10%	263	0,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.843.852,06	0,54%	93	15,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.367.500,49	2,17%	906	1,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.850.971,99	0,84%	27.215	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.790.632,14	0,53%	56.614	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.547.347,82	1,05%	137	0,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.564.721,22	0,46%	175	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.748.963,84	0,81%	135	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.910.312,72	0,56%	3.380	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	8.627.584,46	2,55%	131	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	10.753.314,15	3,17%	19.023	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.800.500,00	0,53%		1,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	5.926.597,02	1,75%	84	0,51%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	659.401,84	0,19%	73	0,05%	Artigo 9º - A, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	1.828.639,09	0,54%	224	1,31%	Artigo 9º - A, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	3.290.315,92	0,97%	431	0,69%	Artigo 9º - A, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	1.708.387,61	0,50%	358	0,64%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	18.781.978,58	5,54%	494	0,56%	Artigo 9º - A, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		765.038,91	0,23%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			338.806.496,74				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			765.038,91	Artigo 6º			
PL Total			339.571.535,65				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	160.742.441,34	47,44%	20,00%	45,00%	85,00%	127.243.080,89
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.388.064,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	75,00%	1.646.950,53	0,49%	0,00%	0,50%	4,00%	11.905.309,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	75,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	55,00%	74.476.313,32	21,98%	10,00%	28,00%	55,00%	111.867.259,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	55,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.388.064,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.388.064,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	20,00%	11.060.851,25	3,26%	0,00%	3,50%	7,00%	12.655.603,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.388.064,97
Total Renda Fixa	100,00%	247.926.556,44	73,18%	30,00%	77,00%	161,00%	



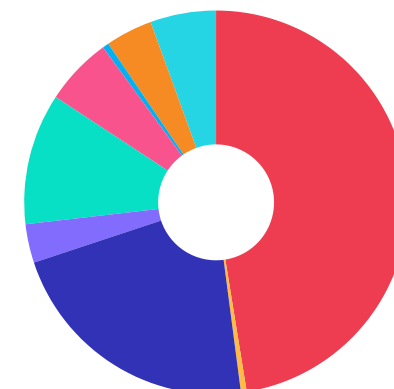
RENTA FIXA 247.926.556,44
RENTA VARIÁVEL 58.684.620,24
EXTERIOR 32.195.320,06

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

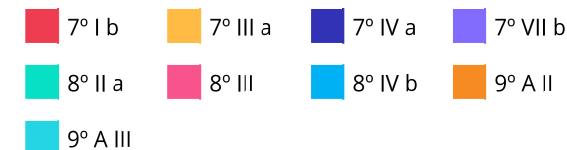


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	35,00%	37.503.221,63	11,07%	2,00%	7,50%	20,00%	30.258.077,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	19.380.898,61	5,72%	1,00%	4,00%	10,00%	14.499.751,06
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	15,00%	1.800.500,00	0,53%	0,00%	1,50%	5,00%	15.139.824,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.776.129,93
Total Renda Variável	45,00%	58.684.620,24	17,32%	3,00%	13,00%	45,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	13.413.341,48	3,96%	0,00%	4,00%	10,00%	20.467.308,19
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	18.781.978,58	5,54%	0,00%	6,00%	10,00%	15.098.671,09
Total Exterior	10,00%	32.195.320,06	9,50%	0,00%	10,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	146.138.496,79	43,13	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	109.938.154,99	32,45	0,01
BANESTES DTVM	67.834.652,50	20,02	0,97
GENIAL INVESTIMENTOS	5.118.955,01	1,51	0,06
VINCI PARTNERS	4.313.685,06	1,27	0,00
OCCAM BRASIL	1.910.312,72	0,56	0,01
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.708.387,61	0,50	0,03

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
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%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,33%	0,28%	0,68%	1,24%	1,37%	8,14%	0,41%	0,01%

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%

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%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,87%	-7,23%	-3,51%	-0,95%	2,86%	-4,59%	3,05%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,96%	-4,15%	-1,90%	-0,24%	-0,38%	2,38%	1,08%	0,06%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,49%	-9,37%	-4,41%	-2,47%	-1,91%	-3,41%	2,73%	0,09%
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 TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	4,66%	2,42%	3,97%	7,69%	13,21%	0,59%	0,01%

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%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,37%	-3,13%	-1,46%	-0,35%	-1,25%	4,97%	1,41%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------	---	---

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	2,64%	1,31%	2,13%	3,23%	6,30%	0,03%	0,00%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,61%	3,45%	1,55%	2,55%	4,07%	4,74%	0,16%	0,01%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,25%	1,09%	0,65%	1,02%	1,14%	2,08%	0,01%	0,00%

IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,92%	1,72%	1,05%	2,51%	5,47%	12,48%	0,92%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	3,51%	1,92%	3,52%	6,84%	13,46%	0,57%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36%	-1,16%	-1,87%	-0,98%	0,86%	7,32%	0,48%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,85%	-0,46%	0,90%	2,78%	-	0,67%	0,03%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,13%	-0,83%	-0,12%	1,35%	2,53%	4,44%	0,86%	0,03%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	4,72%	2,44%	4,01%	7,77%	16,25%	0,59%	0,01%

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
IDIV (Benchmark)	-4,48%	-4,67%	-6,59%	-1,51%	19,58%	7,85%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-6,49%	-7,26%	-10,65%	-4,65%	15,95%	7,86%	10,67%	0,22%

Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-7,98%	-9,65%	-14,44%	-7,16%	9,34%	9,32%	11,95%	0,22%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,81%	-15,27%	-18,88%	-14,02%	-4,84%	0,39%	13,19%	0,17%
OCCAM FIC AÇÕES	-6,93%	-8,92%	-12,94%	-6,39%	11,87%	5,28%	11,32%	0,20%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,98%	-3,26%	-8,58%	-1,61%	23,96%	25,09%	11,83%	0,24%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-7,71%	-3,23%	-14,35%	-5,38%	16,49%	8,55%	12,73%	0,21%

IFIX (Benchmark)	-1,24%	-5,38%	-1,42%	-4,61%	-2,83%	1,17%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,01%	-47,37%	-14,03%	-27,61%	-61,07%	-35,12%	6,43%	0,23%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-7,05%	-8,20%	-14,12%	-5,86%	14,97%	0,89%	12,29%	0,23%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,64%	17,47%	1,14%	9,99%	30,72%	42,05%	6,15%	0,13%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,75%	6,80%	-10,94%	3,12%	28,12%	29,33%	14,09%	0,20%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,79%	1,44%	-1,87%	0,04%	5,61%	-	2,46%	0,04%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-3,79%	-7,92%	-10,50%	-7,89%	7,64%	-	9,92%	0,19%

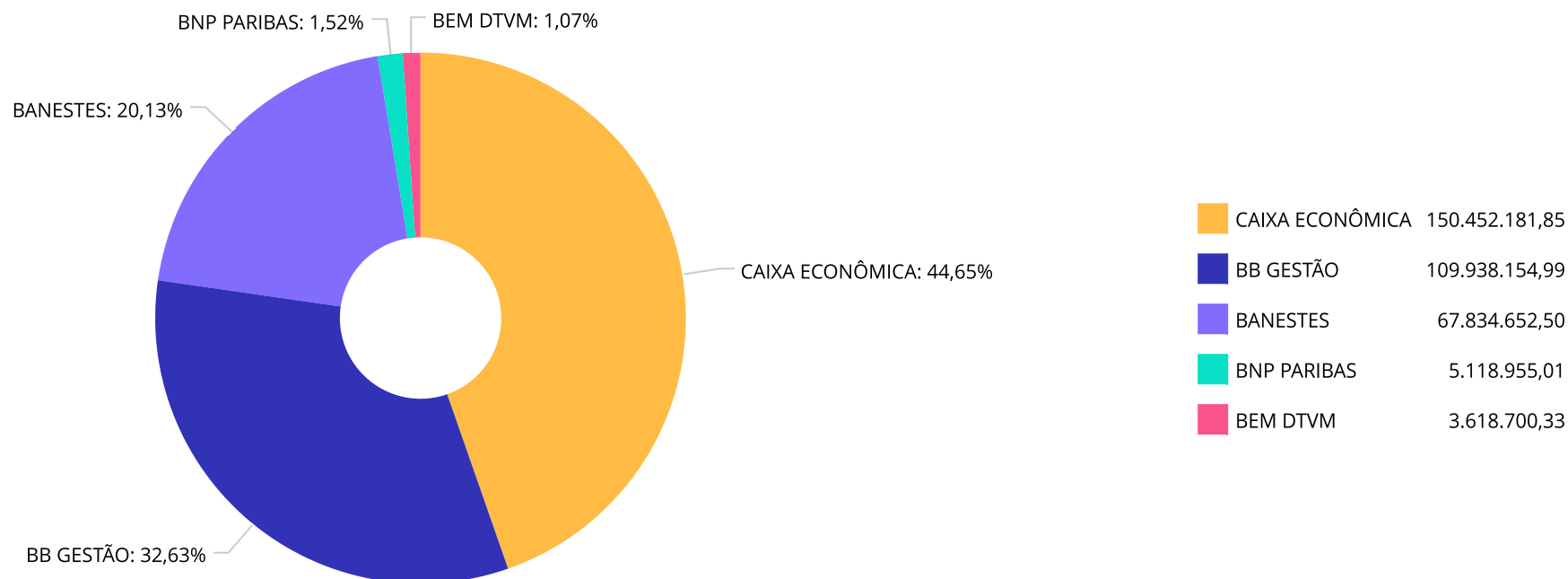
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,95%	22,08%	10,00%	6,17%	27,02%	102,50%	6,41%	0,09%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,30%	19,63%	11,29%	4,48%	29,53%	110,87%	6,19%	0,12%

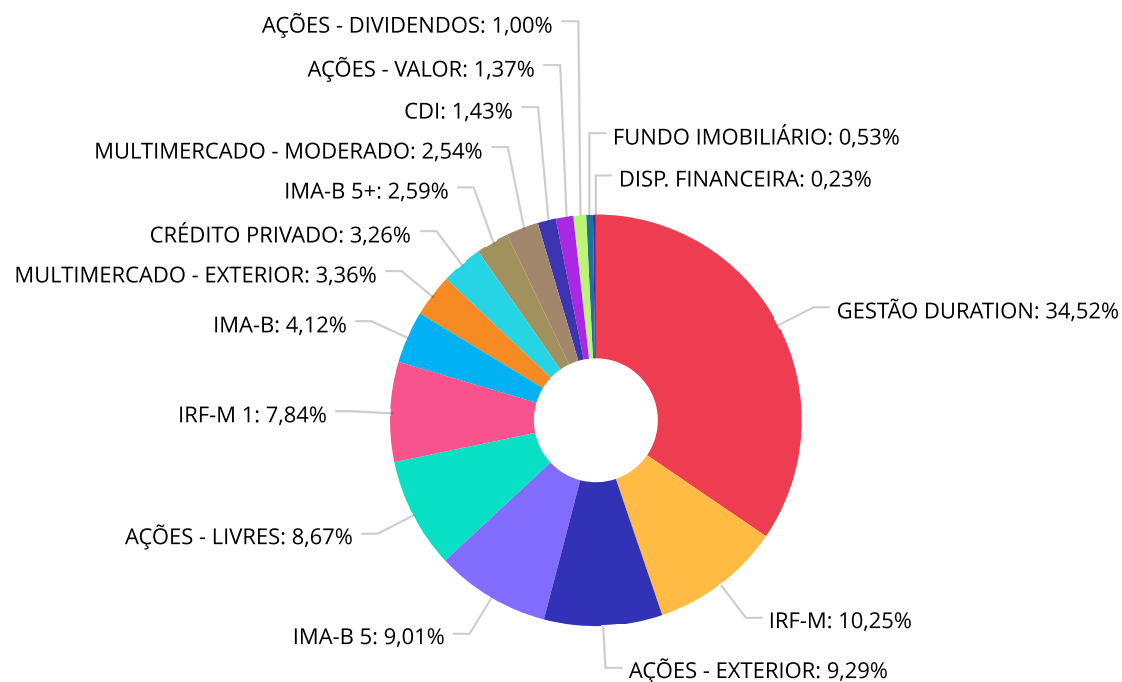
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	2,57%	10,44%	10,02%	5,42%	-	-	6,19%	-
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-1,35%	8,91%	2,87%	4,59%	-	-	11,31%	-

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	1,46%	20,32%	10,07%	5,44%	29,65%	-	5,72%	0,11%

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



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

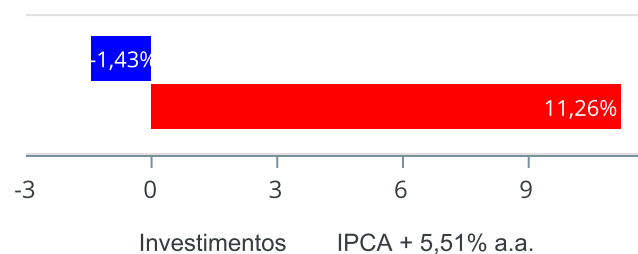


GESTÃO DURATION	117.234.747,67
IRF-M	34.805.082,48
AÇÕES - EXTERIOR	31.535.918,22
IMA-B 5	30.586.093,74
AÇÕES - LIVRES	29.435.371,79
IRF-M 1	26.620.313,83
IMA-B	13.989.571,36
MULTIMERCADO - EXTERIOR	11.412.715,99
CRÉDITO PRIVADO	11.060.851,25
IMA-B 5+	8.782.740,00
MULTIMERCADO - MODERADO	8.627.584,46
CDI	4.847.156,11
AÇÕES - VALOR	4.659.276,56
AÇÕES - DIVIDENDOS	3.408.573,28
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.800.500,00
DISP. FINANCEIRA	765.038,91

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

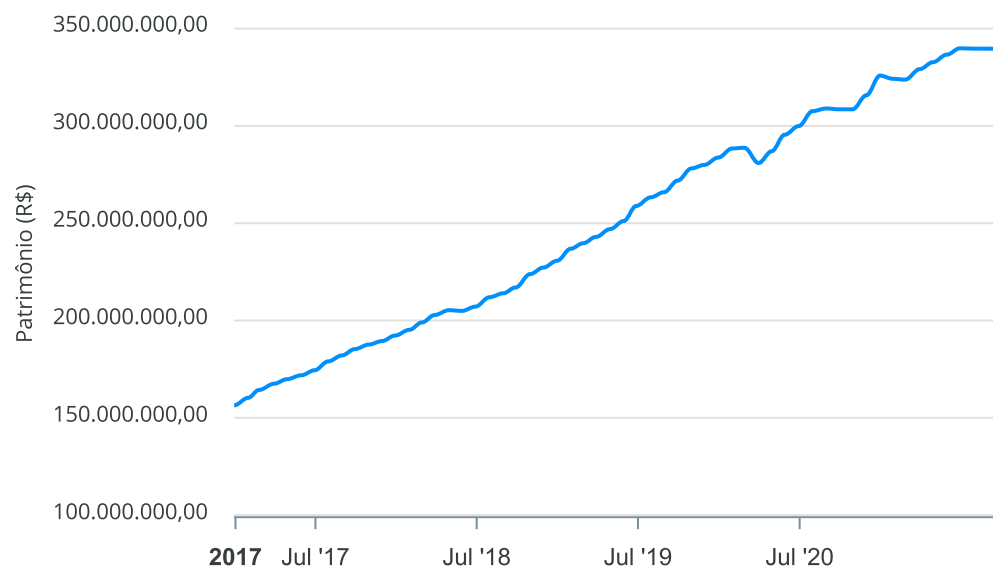
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	325.679.727,73	4.334.218,97	4.766.670,31	323.956.966,54	-1.290.309,85	-1.290.309,85	-0,40%	-0,40%	0,68%	0,68%	-58,46%	3,42%
Fevereiro	323.956.966,54	8.288.078,01	5.017.090,33	323.540.486,60	-3.687.467,62	-4.977.777,47	-1,13%	-1,52%	1,25%	1,93%	-78,55%	3,03%
Março	323.540.486,60	6.547.108,04	4.747.719,54	327.003.703,57	1.663.828,47	-3.313.949,00	0,51%	-1,01%	1,43%	3,39%	-29,97%	3,89%
Abril	327.003.703,57	6.589.402,56	3.881.061,96	332.563.008,00	2.850.963,83	-462.985,17	0,86%	-0,16%	0,74%	4,15%	-3,83%	2,73%
Mai	332.563.008,00	7.000.589,93	4.715.840,43	336.410.400,69	1.562.643,19	1.099.658,02	0,47%	0,31%	1,28%	5,48%	5,60%	2,68%
Junho	336.410.400,69	8.678.262,26	7.045.231,66	338.285.909,40	242.478,11	1.342.136,13	0,07%	0,38%	0,98%	6,52%	5,81%	2,32%
Julho	338.285.909,40	6.860.765,98	4.743.367,20	339.446.364,57	-956.943,61	385.192,52	-0,28%	0,10%	1,43%	8,05%	1,20%	2,92%
Agosto	339.446.364,57	8.042.798,89	5.779.427,52	339.448.712,56	-2.261.023,38	-1.875.830,86	-0,66%	-0,57%	1,34%	9,50%	-5,96%	3,16%
Setembro	339.448.712,56	6.985.985,41	4.795.615,94	338.681.262,58	-2.957.819,45	-4.833.650,31	-0,87%	-1,43%	1,61%	11,26%	-12,67%	3,04%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

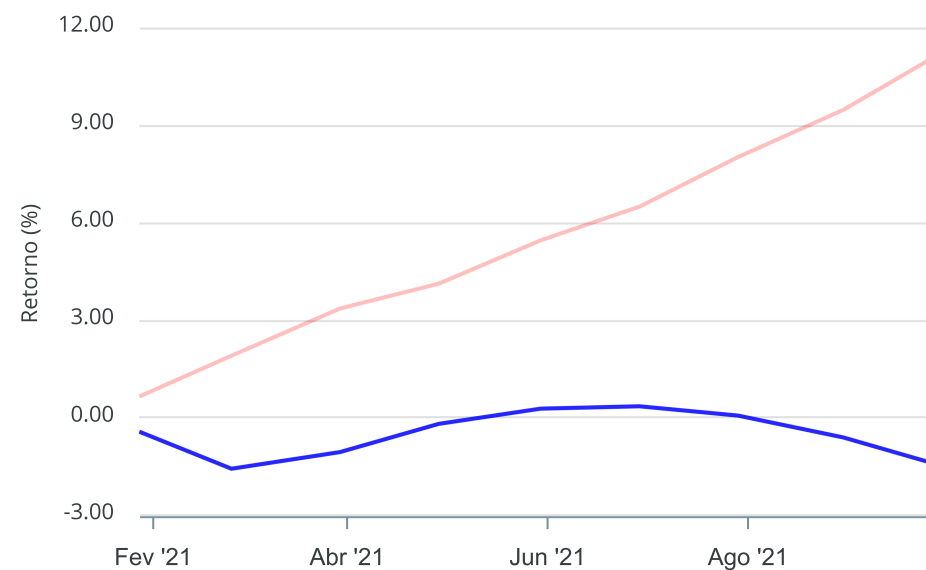
Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO

36M



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.017.476,41	0,00	0,00	5.082.873,81	65.397,40	1,30%	1,30%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	534.084,50	0,00	0,00	541.010,59	6.926,09	1,30%	1,30%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	6.890.619,25	0,00	0,00	6.973.121,08	82.501,83	1,20%	1,20%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	25.561,24	0,00	0,00	25.812,01	250,77	0,98%	0,98%	0,81%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.433.662,50	0,00	0,00	9.524.456,25	90.793,75	0,96%	0,96%	1,08%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.358.420,00	0,00	0,00	8.438.820,00	80.400,00	0,96%	0,96%	1,08%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.959.606,07	0,00	0,00	11.060.851,25	101.245,18	0,92%	0,92%	0,92%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.960.214,65	0,00	0,00	1.972.169,40	11.954,75	0,61%	0,61%	0,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.297.819,95	0,00	442.478,66	1.865.283,73	9.942,44	0,43%	0,46%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.245.336,28	0,00	0,00	7.272.738,17	27.401,89	0,38%	0,38%	0,29%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	47.437.210,31	0,00	0,00	47.605.590,46	168.380,15	0,35%	0,35%	0,48%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	19.284.254,46	0,00	0,00	19.347.575,66	63.321,20	0,33%	0,33%	0,41%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	19.258.750,98	0,00	0,00	19.283.664,28	24.913,30	0,13%	0,13%	0,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	50.291.573,04	0,00	0,00	50.345.492,93	53.919,89	0,11%	0,11%	0,67%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	992.979,58	4.559.068,55	4.545.171,06	1.009.702,98	2.825,91	0,05%	0,25%	0,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.649.300,47	0,00	0,00	1.646.950,53	-2.349,94	-0,14%	-0,14%	2,20%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.402.283,23	0,00	0,00	19.330.664,36	-71.618,87	-0,37%	-0,37%	1,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.532.794,91	0,00	0,00	15.474.418,12	-58.376,79	-0,38%	-0,38%	1,41%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.825.555,00	0,00	0,00	8.782.740,00	-42.815,00	-0,49%	-0,49%	2,73%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.451.388,16	0,00	0,00	12.342.620,83	-108.767,33	-0,87%	-0,87%	3,05%

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
Total Renda Fixa	247.848.890,99	4.559.068,55	4.987.649,72	247.926.556,44	506.246,62	0,20%		0,95%

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	8.696.007,44	0,00	0,00	8.627.584,46	-68.422,98	-0,79%	-0,79%	2,46%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.837.500,00	0,00	11.250,00	1.800.500,00	-25.750,00	-1,40%	-2,01%	6,43%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.685.392,14	0,00	0,00	3.547.347,82	-138.044,32	-3,75%	-3,75%	14,09%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.916.407,73	0,00	0,00	1.843.852,06	-72.555,67	-3,79%	-3,79%	9,92%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.969.206,33	0,00	0,00	2.850.971,99	-118.234,34	-3,98%	-3,98%	11,83%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10.591.539,08	658.168,54	0,00	10.753.314,15	-496.393,47	-4,41%	-4,64%	6,15%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.673.241,36	0,00	0,00	1.564.721,22	-108.520,14	-6,49%	-6,49%	10,67%
OCCAM FIC AÇÕES	2.052.505,30	0,00	0,00	1.910.312,72	-142.192,58	-6,93%	-6,93%	11,32%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7.926.479,29	0,00	0,00	7.367.500,49	-558.978,80	-7,05%	-7,05%	12,29%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.940.296,40	0,00	0,00	1.790.632,14	-149.664,26	-7,71%	-7,71%	12,73%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.987.228,74	0,00	0,00	2.748.963,84	-238.264,90	-7,98%	-7,98%	11,95%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	15.219.521,47	0,00	0,00	13.878.919,35	-1.340.602,12	-8,81%	-8,81%	13,19%
Total Renda Variável	61.495.325,28	658.168,54	11.250,00	58.684.620,24	-3.457.623,58	-5,56%		9,69%

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
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.782.791,18	0,00	0,00	1.828.639,09	45.847,91	2,57%	2,57%	6,19%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	0,00	646.918,54	0,00	659.401,84	12.483,30	1,93%	2,94%	6,41%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	1.041.174,75	646.918,55	0,00	1.708.387,61	20.294,31	1,20%	1,46%	5,72%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	5.908.937,99	0,00	0,00	5.926.597,02	17.659,03	0,30%	0,30%	6,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	18.829.069,26	0,00	0,00	18.781.978,58	-47.090,68	-0,25%	-0,25%	6,75%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	2.698.703,36	646.918,55	0,00	3.290.315,92	-55.305,99	-1,65%	-1,35%	11,31%
Total Exterior	30.260.676,54	1.940.755,64	0,00	32.195.320,06	-6.112,12	-0,02%		7,02%

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	7.026.920,72	0,00	185.700,43	6.973.121,08	131.900,79	1,88%	1,92%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	19.217.509,13	0,00	0,00	19.347.575,66	130.066,53	0,68%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.097.579,35	0,00	136.987,41	5.082.873,81	122.281,87	2,40%	2,44%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.945.575,98	0,00	0,00	11.060.851,25	115.275,27	1,05%	1,05%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.708.993,75	0,00	253.893,48	9.524.456,25	69.355,98	0,71%	-1,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.208.512,77	0,00	0,00	7.272.738,17	64.225,40	0,89%	0,89%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.602.305,00	0,00	224.807,75	8.438.820,00	61.322,75	0,71%	-1,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.189.635,98	0,00	1.358.487,74	1.865.283,73	34.135,49	1,07%	1,31%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.942.080,78	0,00	0,00	1.972.169,40	30.088,62	1,55%	1,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	543.245,45	0,00	15.160,22	541.010,59	12.925,36	2,38%	2,42%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	1.669.386,51	12.739.176,59	13.407.050,14	1.009.702,98	8.190,02	0,06%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	25.523,53	0,00	0,00	25.812,01	288,48	1,13%	1,13%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	19.305.848,77	0,00	0,00	19.283.664,28	-22.184,49	-0,11%	-0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.674.475,93	0,00	0,00	1.646.950,53	-27.525,40	-1,64%	-1,64%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.187.465,00	0,00	223.933,03	8.782.740,00	-180.791,97	-1,97%	-4,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	50.577.610,33	0,00	0,00	50.345.492,93	-232.117,40	-0,46%	-0,46%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.712.070,64	0,00	0,00	15.474.418,12	-237.652,52	-1,51%	-1,51%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.617.927,80	0,00	0,00	19.330.664,36	-287.263,44	-1,46%	-1,46%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.791.263,79	0,00	0,00	12.342.620,83	-448.642,96	-3,51%	-3,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	48.511.230,12	0,00	0,00	47.605.590,46	-905.639,66	-1,87%	-1,87%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Fixa	-1.561.761,28	-0,59%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8.330.793,62	2.372.052,80	0,00	10.753.314,15	50.467,73	0,47%	1,14%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	8.791.623,41	0,00	0,00	8.627.584,46	-164.038,95	-1,87%	-1,87%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.751.136,40	0,00	0,00	1.564.721,22	-186.415,18	-10,65%	-10,65%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	1.991.785,04	0,00	1.790.632,14	-201.152,90	-10,10%	-14,35%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.060.257,35	0,00	0,00	1.843.852,06	-216.405,29	-10,50%	-10,50%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.094.250,00	0,00	31.482,50	1.800.500,00	-262.267,50	-12,52%	-14,03%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.118.368,45	0,00	0,00	2.850.971,99	-267.396,46	-8,57%	-8,57%
OCCAM FIC AÇÕES	1.346.036,62	841.041,88	0,00	1.910.312,72	-276.765,78	-12,65%	-12,94%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3.118.183,54	850.024,38	0,00	3.547.347,82	-420.860,10	-10,61%	-10,94%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.212.982,47	0,00	0,00	2.748.963,84	-464.018,63	-14,44%	-14,44%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	8.578.788,31	0,00	0,00	7.367.500,49	-1.211.287,82	-14,12%	-14,12%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	16.445.431,37	669.077,15	0,00	13.878.919,35	-3.235.589,17	-18,91%	-18,88%
			Total Renda Variável		-6.855.730,05	-10,46%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.436.296,17	0,00	0,00	18.781.978,58	1.345.682,41	7,72%	7,72%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	5.325.454,70	0,00	0,00	5.926.597,02	601.142,32	11,29%	11,29%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.662.149,10	0,00	0,00	1.828.639,09	166.489,99	10,02%	10,02%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	0,00	1.646.918,55	0,00	1.708.387,61	61.469,06	3,73%	10,07%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	2.588.177,81	646.918,55	0,00	3.290.315,92	55.219,56	1,71%	2,87%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	0,00	646.918,54	0,00	659.401,84	12.483,30	1,93%	10,00%
			Total Exterior		2.242.486,64	7,49%	

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.