

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

**Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)**

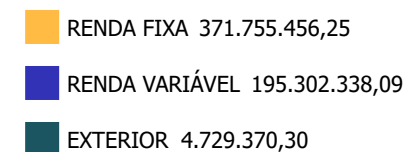
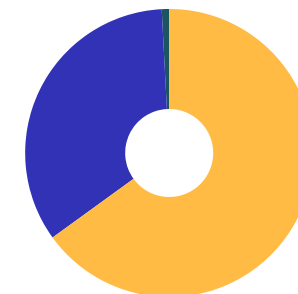
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	595.053,63	0,10%	1.140	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	13.873.268,98	2,43%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.404.850,71	0,25%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	98.347.550,51	17,20%	964	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	77.713.907,00	13,59%	1.057	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	72.497.256,85	12,68%	1.013	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	11.790.912,84	2,06%	863	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.232.604,47	0,57%	1.264	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.054.670,98	0,53%	587	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	54.943.997,98	9,61%	143	5,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.588.346,31	3,08%	790	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	11.761.216,76	2,06%	74	1,85%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	4.951.819,23	0,87%	95	2,23%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.292.403,81	0,75%	2.466	0,38%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	32.232.770,62	5,64%	113	2,85%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	40.713.115,88	7,12%	114	6,66%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	5.435.877,34	0,95%	45.479	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.481.853,66	0,78%	56.614	0,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	16.265.456,13	2,84%	2.256	1,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	24.840.461,88	4,34%	137	3,52%	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
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	13.654.403,07	2,39%	11.521	1,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.434.947,47	1,13%	175	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	24.726.417,95	4,32%	135	3,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.988.943,28	0,87%	45.291	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.202.422,81	1,61%	16.031	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.179.275,70	0,56%	131	0,26%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.349.962,18	0,59%	15.340	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	1.504.026,31	0,26%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.729.370,30	0,83%	494	0,14%	Artigo 9º - A, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.751.787,04	0,31%		0,00%	DF - Artigo 6º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>571.787.164,64</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>1.751.787,04</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>573.538.951,68</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	279.455.404,99	48,87%	11,00%	49,00%	70,00%	120.795.610,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	75.587.015,27	13,22%	3,00%	12,00%	40,00%	153.127.850,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	16.713.035,99	2,92%	1,00%	3,50%	5,00%	11.876.322,24
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>371.755.456,25</b>	<b>65,02%</b>	<b>15,00%</b>	<b>64,50%</b>	<b>115,00%</b>	



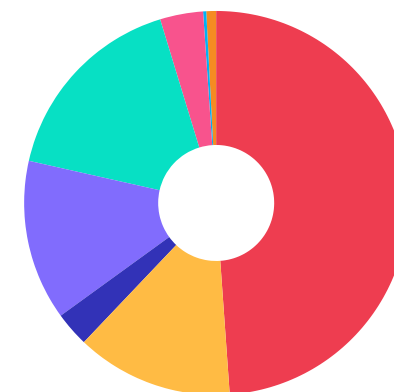
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	77.238.290,31	13,51%	1,00%	15,50%	25,00%	65.708.500,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	95.839.417,50	16,76%	3,00%	14,00%	25,00%	47.107.373,66
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	20.720.603,97	3,62%	1,00%	5,00%	10,00%	36.458.112,49
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.504.026,31	0,26%	0,00%	0,50%	5,00%	27.085.331,92
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>195.302.338,09</b>	<b>34,16%</b>	<b>5,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>65,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.589.358,23
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	4.729.370,30	0,83%	0,00%	0,50%	5,00%	23.859.987,93
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>4.729.370,30</b>	<b>0,83%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,50%</b>	<b>10,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	489.233.633,76	85,56	0,08
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	49.888.139,15	8,72	0,00
VINCI PARTNERS	31.161.365,42	5,45	0,02
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	1.504.026,31	0,26	0,41

**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 '	279.455.404,99	48,87	11,00	70,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	75.587.015,27	13,22	3,75	45,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	16.713.035,99	2,92	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	77.238.290,31	13,51	1,00	25,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	95.839.417,50	16,76	3,00	25,00
Artigo 8º, Inciso III	20.720.603,97	3,62	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.504.026,31	0,26	1,00	0,50
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	4.729.370,30	0,83	1,00	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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	2,79%	1,21%	2,82%	5,92%	13,71%	0,78%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
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%
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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	4,66%	2,42%	3,97%	7,69%	13,21%	0,59%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	-2,51%	-1,69%	0,37%	4,45%	6,20%	2,16%	0,06%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	2,65%	1,48%	2,31%	3,31%	6,30%	0,13%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	4,68%	2,43%	3,98%	7,72%	15,54%	0,59%	0,01%
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%

**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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,85%	-0,46%	0,90%	2,78%	-	0,67%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,49%	-0,81%	-1,52%	-0,70%	0,74%	-	0,22%	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%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,81%	0,93%	-0,45%	1,35%	3,84%	11,46%	1,05%	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
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-4,76%	14,68%	0,23%	8,42%	28,09%	44,71%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-4,78%	16,09%	0,67%	9,26%	28,99%	-	5,97%	0,13%
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	-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%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-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%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-7,71%	-3,23%	-14,35%	-5,38%	16,49%	8,55%	12,73%	0,21%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-6,56%	-6,91%	-12,44%	-4,94%	16,86%	5,56%	12,44%	0,23%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-7,98%	-9,65%	-14,44%	-7,16%	9,34%	9,32%	11,95%	0,22%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,47%	1,00%	-0,18%	0,97%	3,70%	6,85%	1,27%	0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	0,59%	-2,45%	-0,11%	4,85%	8,05%	1,80%	0,04%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,75%	6,80%	-10,94%	3,12%	28,12%	29,33%	14,09%	0,20%

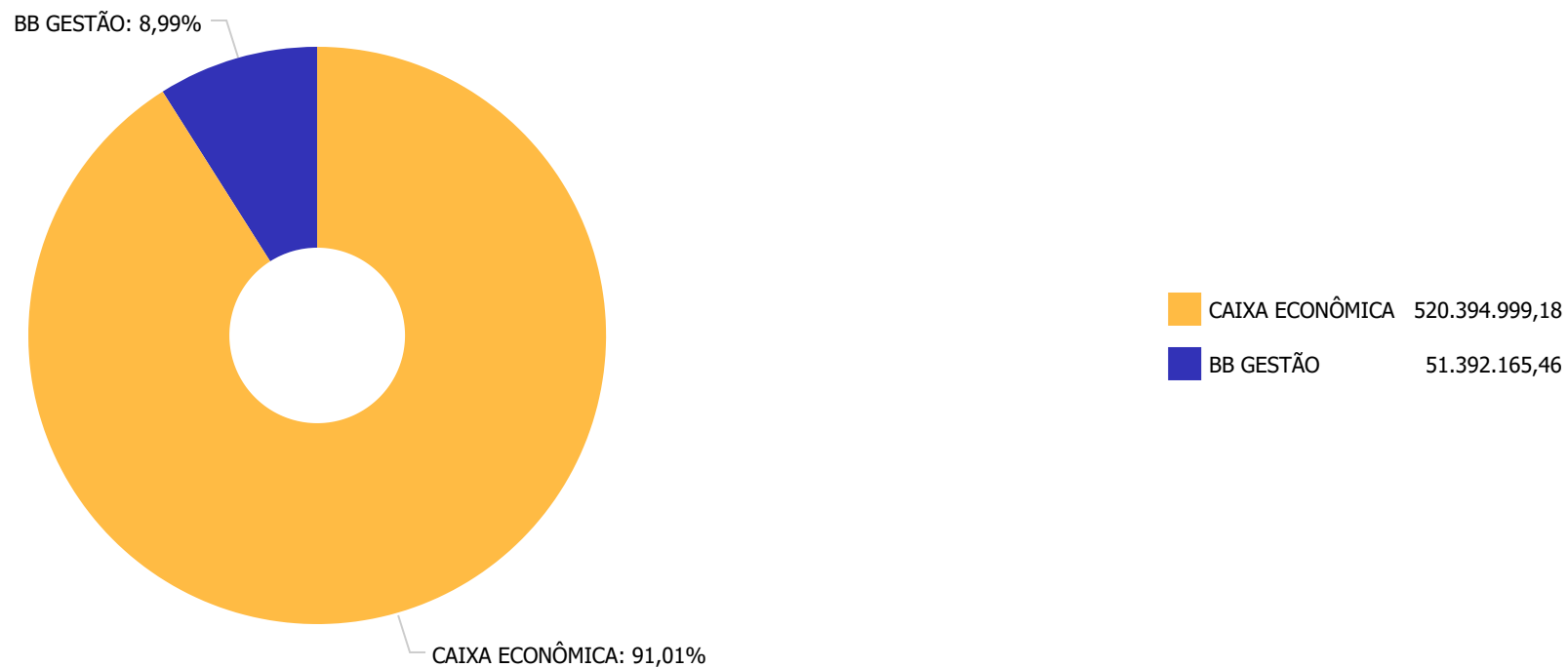
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,52%	-5,72%	-12,57%	-3,53%	12,03%	9,28%	10,75%	0,19%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,79%	1,44%	-1,87%	0,04%	5,61%	-	2,46%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-1,58%	-0,73%	-2,95%	-0,57%	5,51%	6,44%	3,62%	0,06%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,04%	-0,10%	-	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-6,75%	-5,50%	-13,47%	-4,90%	17,56%	7,93%	12,21%	0,22%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-6,53%	-6,24%	-15,87%	-5,36%	13,95%	9,19%	13,30%	0,23%

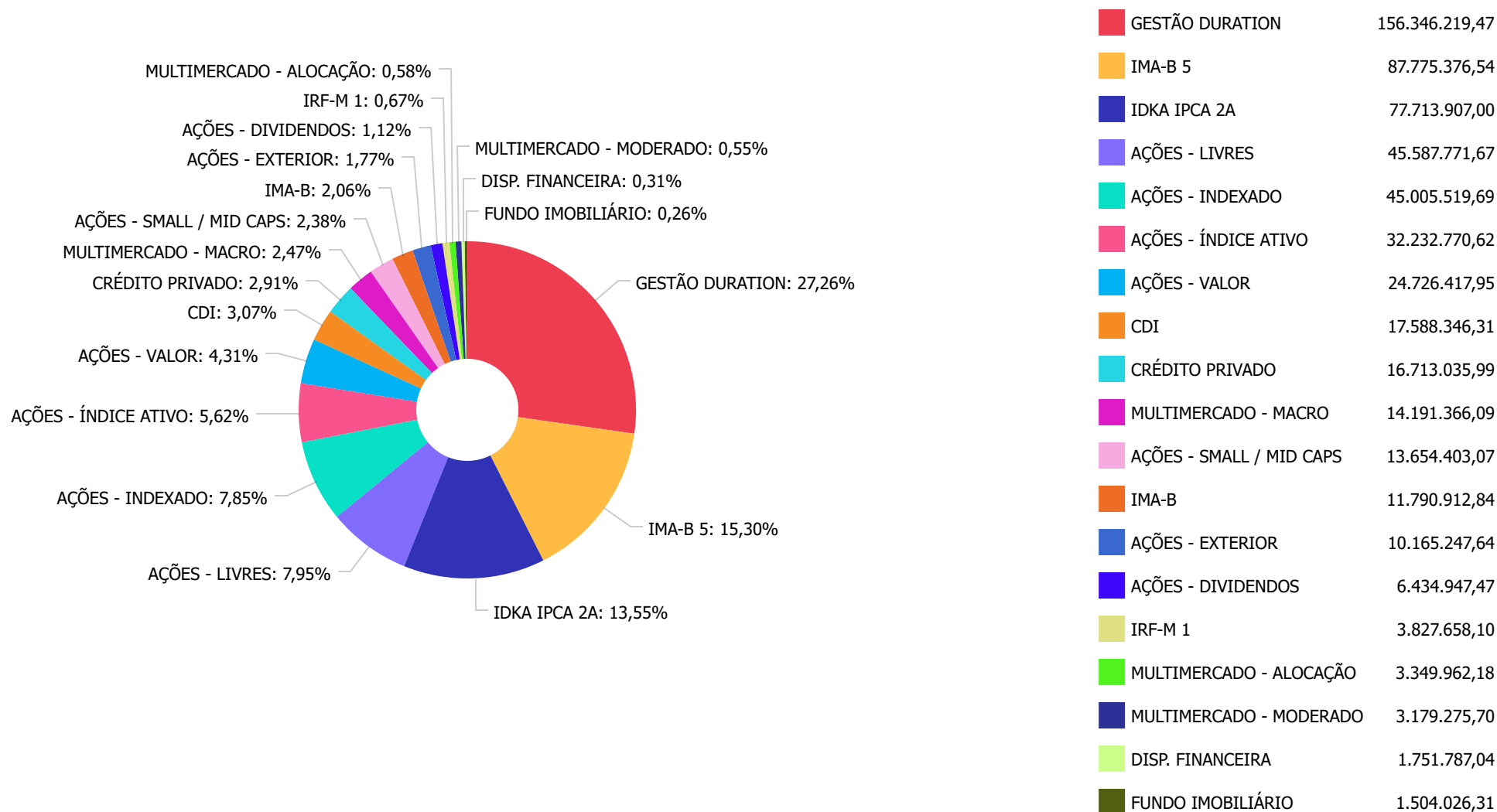
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%

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



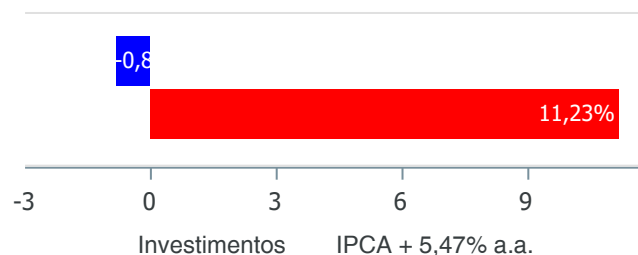
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)**



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

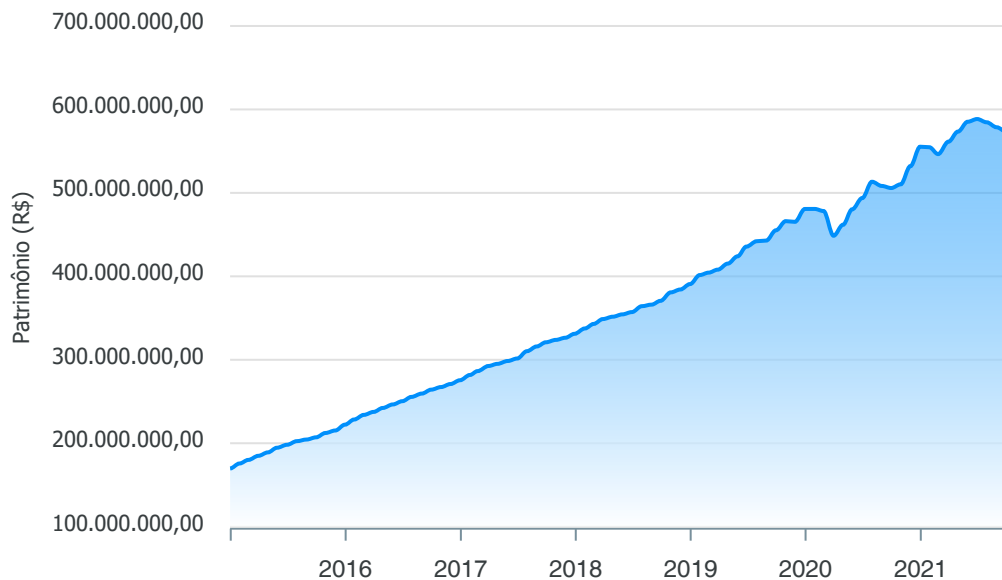
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	555.320.830,37	19.780.273,32	16.954.909,91	554.562.602,48	-3.583.591,30	-3.583.591,30	-0,64%	-0,64%	0,67%	0,67%	-95,17%	3,20%
Fevereiro	554.562.602,48	16.268.141,03	18.134.754,29	546.490.384,40	-6.205.604,82	-9.789.196,12	-1,12%	-1,75%	1,24%	1,93%	-91,00%	3,45%
Março	546.490.384,40	12.022.414,91	7.791.400,00	558.764.213,65	8.042.814,34	-1.746.381,78	1,46%	-0,32%	1,42%	3,38%	-9,45%	3,83%
Abril	558.764.213,65	8.816.550,51	3.781.000,00	572.099.861,47	8.300.097,31	6.553.715,53	1,47%	1,15%	0,73%	4,14%	27,76%	2,38%
Mai	572.099.861,47	6.412.352,38	3.791.500,00	585.252.695,05	10.531.981,20	17.085.696,73	1,83%	3,00%	1,28%	5,47%	54,90%	2,63%
Junho	585.252.695,05	6.108.445,94	3.126.500,00	588.496.632,06	261.991,07	17.347.687,80	0,04%	3,05%	0,98%	6,50%	46,90%	2,63%
Julho	588.496.632,06	81.089.609,25	77.785.556,35	584.612.607,25	-7.188.077,71	10.159.610,09	-1,21%	1,80%	1,43%	8,02%	22,39%	3,28%
Agosto	584.612.607,25	25.432.361,76	24.777.203,34	578.627.536,06	-6.640.229,61	3.519.380,48	-1,13%	0,64%	1,34%	9,47%	6,77%	3,38%
Setembro	578.627.536,06	28.438.621,39	26.915.900,00	571.787.164,64	-8.363.092,81	-4.843.712,33	-1,44%	-0,81%	1,61%	11,23%	-7,21%	4,28%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



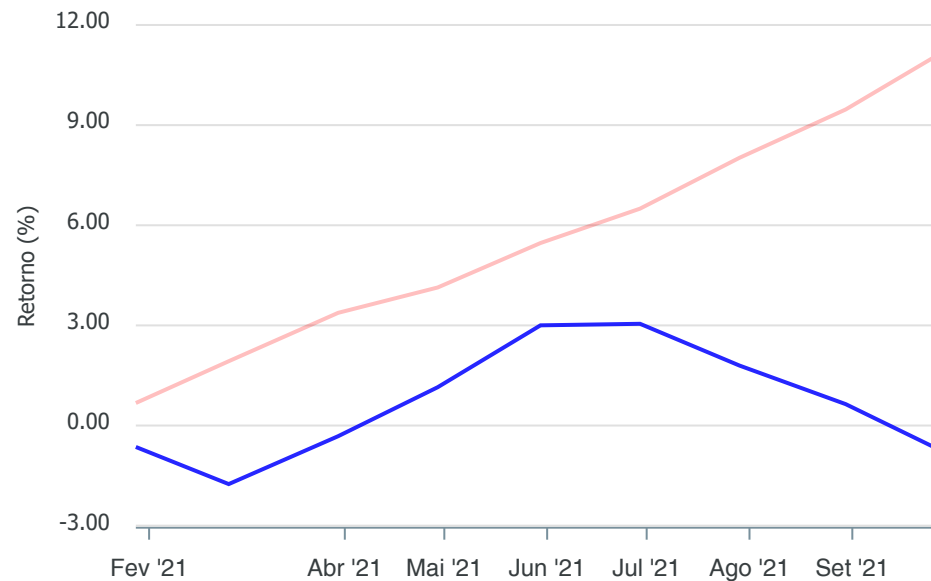
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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 IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	13.695.345,74	0,00	0,00	13.873.268,98	177.923,24	1,30%	1,30%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.386.865,63	0,00	0,00	1.404.850,71	17.985,08	1,30%	1,30%	0,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	87.743.471,54	0,00	10.900.900,00	77.713.907,00	871.335,46	0,99%	1,08%	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	71.792.921,60	0,00	0,00	72.497.256,85	704.335,25	0,98%	0,98%	0,81%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.653.560,80	0,00	0,00	11.761.216,76	107.655,96	0,92%	0,92%	0,92%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.911.943,24	0,00	0,00	4.951.819,23	39.875,99	0,81%	0,81%	1,05%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	54.674.508,39	0,00	0,00	54.943.997,98	269.489,59	0,49%	0,49%	0,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.483.497,66	0,00	10.000.000,00	17.588.346,31	104.848,65	0,38%	0,53%	0,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	578.926,10	13.957,36	0,00	595.053,63	2.170,17	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	97.999.696,93	0,00	0,00	98.347.550,51	347.853,58	0,35%	0,35%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.666.212,07	385.716,40	0,00	3.054.670,98	2.742,51	0,09%	0,11%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.182.638,89	2.049.451,16	6.000.000,00	3.232.604,47	514,42	0,01%	0,38%	0,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.809.308,90	0,00	0,00	11.790.912,84	-18.396,06	-0,16%	-0,16%	2,16%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>393.578.897,49</b>	<b>2.449.124,92</b>	<b>26.900.900,00</b>	<b>371.755.456,25</b>	<b>2.628.333,84</b>	<b>0,67%</b>		<b>0,63%</b>



**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
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.523.418,14	0,00	15.000,00	1.504.026,31	-4.391,83	-0,29%	0,00%	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.012.402,29	0,00	0,00	4.988.943,28	-23.459,01	-0,47%	-0,47%	1,27%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.271.009,01	0,00	0,00	9.202.422,81	-68.586,20	-0,74%	-0,74%	1,80%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.204.489,66	0,00	0,00	3.179.275,70	-25.213,96	-0,79%	-0,79%	2,46%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.403.644,72	0,00	0,00	3.349.962,18	-53.682,54	-1,58%	-1,58%	3,62%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	20.638.721,08	5.000.000,00	0,00	24.840.461,88	-798.259,20	-3,11%	-3,75%	14,09%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5.696.087,66	12.573,00	0,00	5.435.877,34	-272.783,32	-4,78%	-4,78%	5,97%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.528.396,56	3.910.551,84	0,00	13.654.403,07	-784.545,33	-5,43%	-6,52%	13,30%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	17.216.512,96	0,00	0,00	16.265.456,13	-951.056,83	-5,52%	-5,52%	10,75%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.782.540,83	2.066.371,63	0,00	6.434.947,47	-413.964,99	-6,04%	-6,49%	10,67%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	38.370.969,58	5.000.000,00	0,00	40.713.115,88	-2.657.853,70	-6,13%	-6,56%	12,44%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	29.555.310,41	5.000.000,00	0,00	32.232.770,62	-2.322.539,79	-6,72%	-7,25%	12,81%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4.603.185,80	0,00	0,00	4.292.403,81	-310.781,99	-6,75%	-6,75%	12,21%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	21.644.266,88	5.000.000,00	0,00	24.726.417,95	-1.917.848,93	-7,20%	-7,98%	11,95%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.856.455,07	0,00	0,00	4.481.853,66	-374.601,41	-7,71%	-7,71%	12,73%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>180.307.410,65</b>	<b>25.989.496,47</b>	<b>15.000,00</b>	<b>195.302.338,09</b>	<b>-10.979.569,03</b>	<b>-5,32%</b>		<b>11,22%</b>

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	4.741.227,92	0,00	0,00	4.729.370,30	-11.857,62	-0,25%	-0,25%	6,75%
<b>Total Exterior</b>	<b>4.741.227,92</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>4.729.370,30</b>	<b>-11.857,62</b>	<b>-0,25%</b>		<b>6,75%</b>

**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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	107.568.134,78	0,00	30.900.900,00	77.713.907,00	1.046.672,22	0,97%	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	81.637.538,38	0,00	10.000.000,00	72.497.256,85	859.718,47	1,05%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	13.911.720,64	0,00	370.535,84	13.873.268,98	332.084,18	2,39%	2,43%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.282.447,34	15.000.000,00	10.000.000,00	17.588.346,31	305.898,97	1,12%	1,48%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.638.642,33	0,00	0,00	11.761.216,76	122.574,43	1,05%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	26.533.285,71	38.477.342,37	61.852.000,00	3.232.604,47	73.976,39	0,11%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.410.654,03	0,00	39.366,78	1.404.850,71	33.563,46	2,38%	2,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	17.592.387,26	439.079,67	15.000.000,00	3.054.670,98	23.204,05	0,13%	-0,46%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.468.109,50	21.655,58	901.556,35	595.053,63	6.844,90	0,46%	0,87%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.973.967,04	0,00	0,00	4.951.819,23	-22.147,81	-0,45%	-0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.992.948,73	0,00	0,00	11.790.912,84	-202.035,89	-1,68%	-1,68%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	35.487.173,85	20.177.093,66	0,00	54.943.997,98	-720.269,53	-1,29%	-1,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	100.218.495,52	0,00	0,00	98.347.550,51	-1.870.945,01	-1,87%	-1,87%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>-10.861,17</b>	<b>0,00%</b>	

**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 RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	1.873.177,76	0,00	414.300,72	1.504.026,31	45.149,27	2,41%	0,00%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	5.000.000,00	0,00	4.988.943,28	-11.056,72	-0,22%	-0,18%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.239.724,26	0,00	0,00	3.179.275,70	-60.448,56	-1,87%	-1,87%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.451.727,12	0,00	0,00	3.349.962,18	-101.764,94	-2,95%	-2,95%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	5.545.712,09	0,00	5.435.877,34	-109.834,75	-1,98%	0,67%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.433.608,34	0,00	0,00	9.202.422,81	-231.185,53	-2,45%	-2,45%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.481.853,66	-518.146,34	-10,36%	-14,35%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3.563.664,06	1.322.785,56	0,00	4.292.403,81	-594.045,81	-12,16%	-13,47%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,00	7.066.371,63	0,00	6.434.947,47	-631.424,16	-8,94%	-10,65%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6.618.843,36	8.910.551,84	0,00	13.654.403,07	-1.874.992,13	-12,07%	-15,87%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	18.604.060,73	0,00	0,00	16.265.456,13	-2.338.604,60	-12,57%	-12,57%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	22.305.825,81	5.000.000,00	0,00	24.840.461,88	-2.465.363,93	-9,03%	-10,94%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	18.241.174,72	10.000.000,00	0,00	24.726.417,95	-3.514.756,77	-12,45%	-14,44%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	32.000.821,02	5.000.000,00	0,00	32.232.770,62	-4.768.050,40	-12,89%	-14,34%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	40.950.208,87	5.000.000,00	0,00	40.713.115,88	-5.237.092,99	-11,40%	-12,44%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-22.411.618,36</b>	<b>-10,29%</b>	

## 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.