

CRÉDITO E MERCADO

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

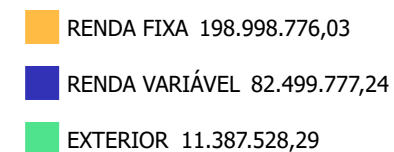
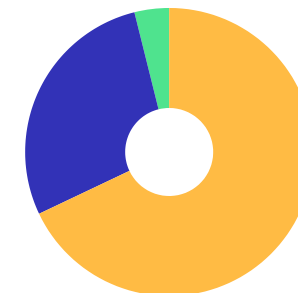
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.518.950,66	2,91%	578	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.365.687,82	3,20%	1.014	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.295.544,72	2,15%	770	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	11.204.984,74	3,83%	1.140	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.458.467,46	1,52%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	140.133,38	0,05%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.034.767,60	2,74%	105	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	27.285.146,47	9,32%	964	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	18.265.878,05	6,24%	1.057	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	17.518.804,52	5,98%	1.013	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.422.088,25	2,88%	863	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	14.751.259,37	5,04%	800	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.391.840,84	1,84%	193	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	270.155,66	0,09%	202	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.184.424,47	9,28%	143	2,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	26.333.169,18	8,99%	96	1,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.966.743,08	0,67%	249	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.590.729,76	1,23%	98	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	420.636,54	0,14%	8.252	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.120.207,56	2,09%	2.705	0,54%	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
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	28.910,58	0,01%	1.102	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	0,04	0,00%	174	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	0,01	0,00%	5.641	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	14.005.783,19	4,78%	11.521	1,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	5.085.214,33	1,74%	5.225	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	5.184.411,75	1,77%	36.305	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.678.525,08	2,28%	4.541	1,94%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.726.533,77	3,66%	9	2,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	13.148.085,08	4,49%	25	1,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.734.793,30	2,98%	16.031	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	1.612.954,82	0,55%	137	5,59%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.947.671,12	1,35%	384	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.708.907,67	1,95%	58.919	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.097.142,40	0,37%		0,38%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	3.148.717,55	1,08%	89	0,13%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	4.068.556,20	1,39%	84	0,35%	Artigo 9º - A, Inciso II
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCI...	D+6 du	Não há	483.459,05	0,17%	13	0,00%	Artigo 9º - A, Inciso II
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD IN...	D+6 du	Não há	485.565,63	0,17%	8	0,01%	Artigo 9º - A, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.201.229,86	1,09%	1.256	0,09%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			292.886.081,56				

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%	119.510.453,67	40,80%	11,39%	49,60%	90,00%	144.087.019,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	29.288.608,16
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	79.488.322,36	27,14%	6,00%	22,60%	45,00%	52.310.414,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.644.304,08
Total Renda Fixa	100,00%	198.998.776,03	67,94%	17,39%	72,20%	150,00%	



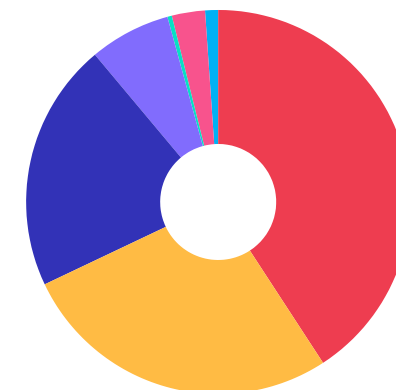
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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%	0,00	0,00%	0,00%	4,40%	10,00%	29.288.608,16
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	61.398.307,93	20,96%	3,65%	16,00%	25,00%	11.823.212,46
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	20.004.326,91	6,83%	6,00%	6,00%	10,00%	9.284.281,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	14.644.304,08
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.097.142,40	0,37%	0,00%	0,00%	5,00%	13.547.161,68
Total Renda Variável	35,00%	82.499.777,24	28,17%	9,65%	26,40%	55,00%	

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%	8.186.298,43	2,80%	0,00%	0,36%	5,00%	6.458.005,65
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	3.201.229,86	1,09%	0,00%	0,38%	5,00%	11.443.074,22
Total Exterior	10,00%	11.387.528,29	3,89%	0,00%	0,74%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	155.784.855,03	53,19	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	68.072.509,46	23,24	0,00
TRÍGONO CAPITAL	23.874.618,85	8,15	0,56
ITAÚ UNIBANCO	7.151.154,83	2,44	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	7.148.900,98	2,44	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	6.678.525,08	2,28	-
WESTERN ASSET	5.708.907,67	1,95	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.661.996,54	1,93	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	5.085.214,33	1,74	0,36
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	3.590.729,76	1,23	0,00
MULTINVEST CAPITAL	1.612.954,82	0,55	0,16
ZION INVEST	1.097.142,40	0,37	0,13
MIRAE ASSET	969.024,68	0,33	0,20
AZ QUEST INVESTIMENTOS	420.636,54	0,14	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	28.910,58	0,01	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	0,01	0,00	0,00

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 '	119.510.453,67	40,80	11,39	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	79.488.322,36	27,14	6,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	0,04
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	61.398.307,93	20,96	16,00	25,00
Artigo 8º, Inciso III	20.004.326,91	6,83	6,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.097.142,40	0,37	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	8.186.298,43	2,80	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	3.201.229,86	1,09	0,00	5,00

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
IRF-M 1 (Benchmark)	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%
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 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%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	4,66%	2,42%	3,97%	7,69%	13,21%	0,59%	0,01%
Selic (Benchmark)	0,44%	2,50%	1,21%	2,01%	2,99%	6,64%	-	-
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,49%	2,84%	1,38%	2,28%	3,26%	6,25%	0,05%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,51%	2,60%	1,45%	2,23%	3,31%	6,54%	0,15%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,35%	1,66%	0,90%	1,43%	1,88%	4,33%	0,01%	0,00%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,36%	-1,16%	-1,87%	-0,98%	0,86%	7,32%	0,48%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,49%	-0,81%	-1,52%	-0,70%	0,74%	-	0,22%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,15%	-1,65%	-0,86%	0,43%	1,30%	4,80%	1,07%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,31%	1,63%	0,82%	1,63%	2,40%	6,83%	0,25%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-1,38%	-0,70%	0,51%	1,75%	5,52%	0,80%	0,03%
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%
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
S&P 500 (Benchmark)	-4,76%	14,68%	0,23%	8,42%	28,09%	44,71%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,60%	17,21%	1,13%	9,92%	30,75%	43,09%	6,16%	0,13%

Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-5,49%	51,44%	-1,98%	27,99%	86,00%	-	12,63%	0,21%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-5,45%	-3,29%	-12,34%	-4,26%	17,01%	2,20%	12,56%	0,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,52%	-0,57%	-11,40%	-1,65%	19,26%	6,71%	10,48%	0,18%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,84%	-15,32%	-18,94%	-14,07%	-4,83%	0,46%	13,25%	0,17%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-8,29%	-9,84%	-14,73%	-4,60%	8,76%	-5,07%	12,42%	0,18%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-6,14%	-9,32%	-14,04%	-6,06%	11,21%	2,43%	11,54%	0,22%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,73%	-1,21%	-11,59%	-3,13%	17,15%	9,79%	10,72%	0,21%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,58%	-7,51%	-14,14%	-4,51%	8,01%	-2,82%	10,03%	0,18%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,52%	-2,28%	-6,51%	0,33%	29,38%	17,40%	12,52%	0,24%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,31%	-	-1,11%	-	-	-	14,53%	-

CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-4,57%	17,12%	1,15%	9,89%	30,43%	43,42%	6,09%	0,13%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	0,59%	-2,45%	-0,11%	4,85%	8,05%	1,80%	0,04%

IFIX (Benchmark)	-1,24%	-5,38%	-1,42%	-4,61%	-2,83%	1,17%	-	-
-------------------------	--------	--------	--------	--------	--------	-------	---	---

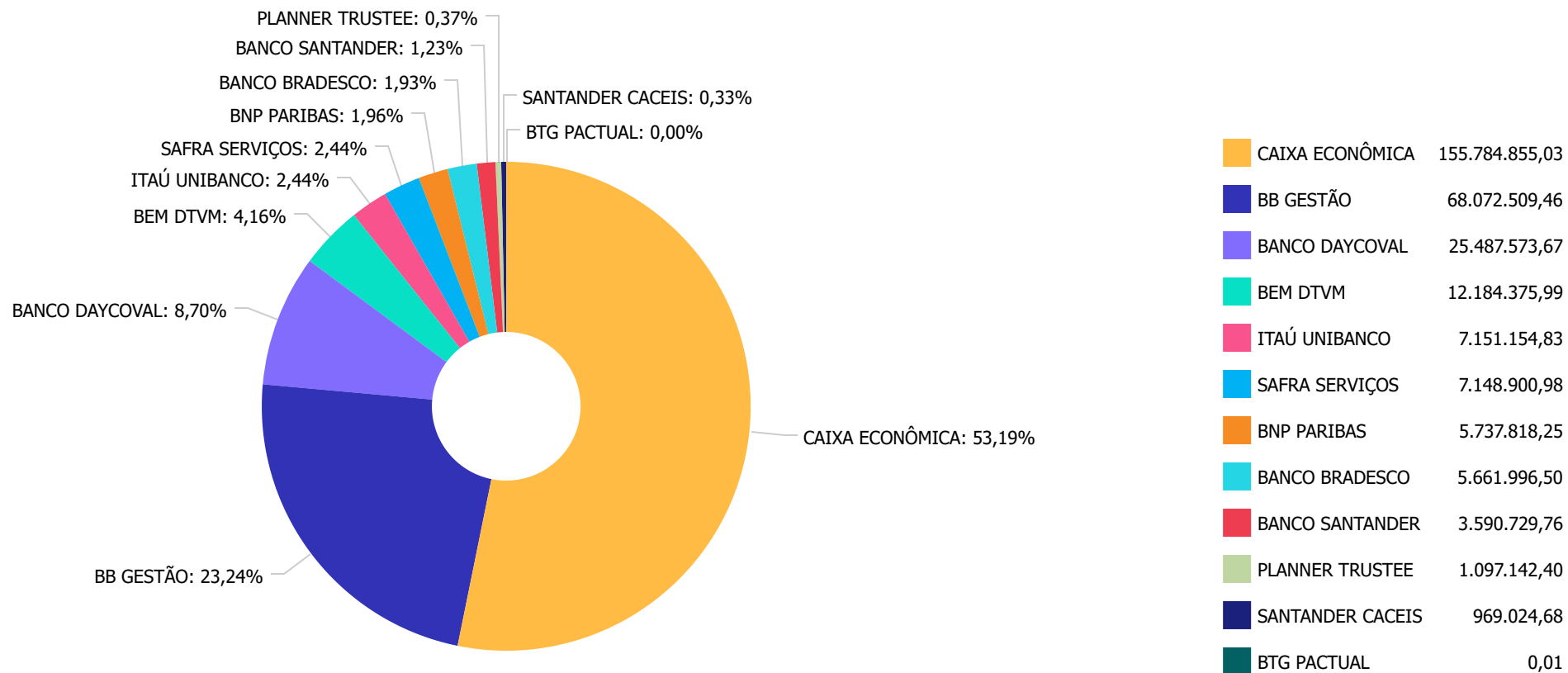
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-12,33%	-8,57%	-20,99%	18,52%	-17,95%	-58,17%	20,93%	0,50%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	-1,53%	-2,56%	-4,16%	-1,76%	1,27%	-0,35%	2,42%	0,05%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-6,53%	-6,24%	-15,87%	-5,36%	13,95%	9,19%	13,30%	0,23%

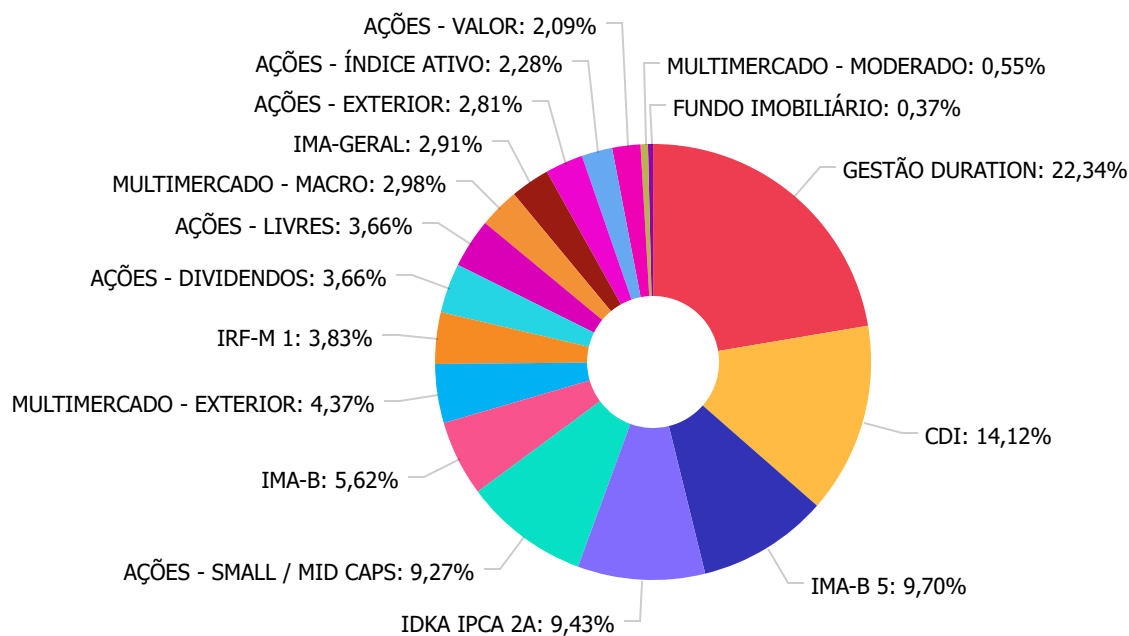
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	1,22%	16,99%	8,36%	2,09%	22,47%	80,14%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,19%	20,16%	10,08%	3,90%	29,49%	95,40%	6,22%	0,14%
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%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	4,75%	-	13,42%	5,11%	-	-	10,07%	-
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	0,71%	-	11,62%	8,33%	-	-	8,86%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,81%	19,04%	7,72%	6,60%	20,62%	79,55%	7,15%	0,10%

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



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

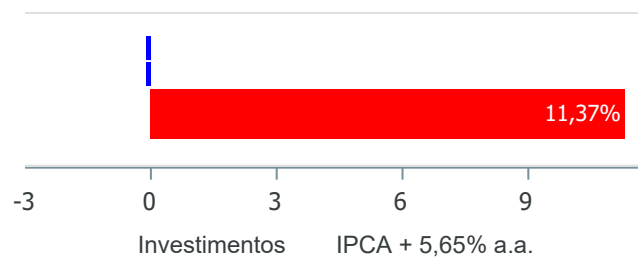


GESTÃO DURATION	65.418.884,62
CDI	41.354.584,21
IMA-B 5	28.412.950,08
IDKA IPCA 2A	27.631.565,87
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	27.153.868,27
IMA-B	16.456.855,85
MULTIMERCADO - EXTERIOR	12.805.296,34
IRF-M 1	11.204.984,74
AÇÕES - DIVIDENDOS	10.726.533,77
AÇÕES - LIVRES	10.719.173,21
MULTIMERCADO - MACRO	8.734.793,30
IMA-GERAL	8.518.950,66
AÇÕES - EXTERIOR	8.238.810,74
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.678.525,12
AÇÕES - VALOR	6.120.207,56
MULTIMERCADO - MODERADO	1.612.954,82
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.097.142,40

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

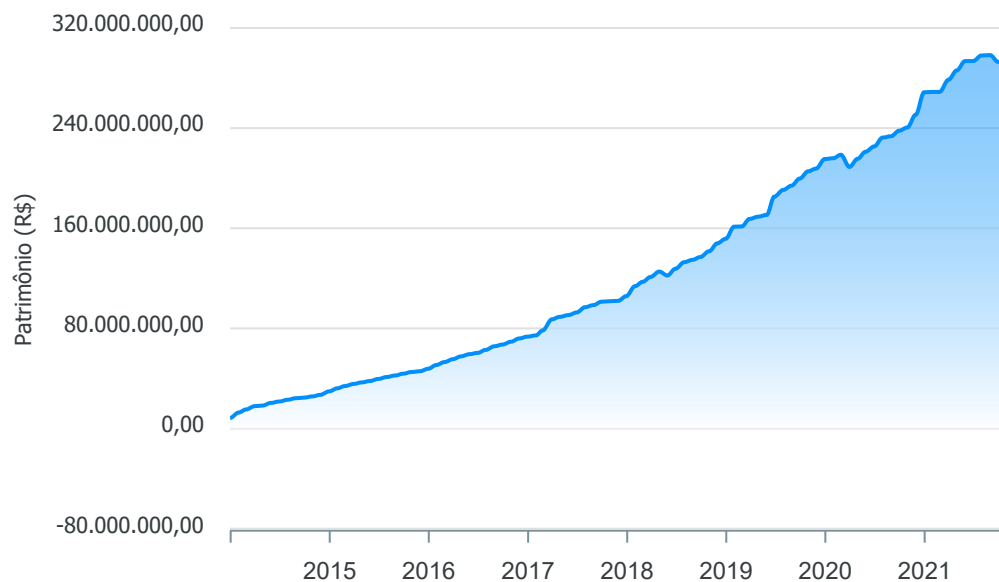
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	268.620.345,37	3.322.628,30	1.413.137,09	268.919.802,41	-1.610.034,17	-1.610.034,17	-0,60%	-0,60%	0,69%	0,69%	-86,47%	3,29%
Fevereiro	268.919.802,41	5.124.668,20	2.810.735,28	268.946.656,86	-2.287.078,47	-3.897.112,64	-0,84%	-1,43%	1,26%	1,95%	-73,37%	3,17%
Março	268.946.656,86	22.245.258,01	14.784.722,61	278.680.148,54	2.272.956,28	-1.624.156,36	0,82%	-0,62%	1,44%	3,42%	-18,21%	3,83%
Abril	278.680.148,54	16.216.363,61	12.830.995,42	286.088.615,79	4.023.099,06	2.398.942,70	1,43%	0,79%	0,75%	4,19%	18,95%	2,48%
Mai	286.088.615,79	4.931.183,23	1.691.574,83	293.548.378,93	4.220.154,74	6.619.097,44	1,46%	2,26%	1,29%	5,54%	40,88%	2,99%
Junho	293.548.378,93	5.417.262,53	6.177.277,02	293.596.005,40	807.640,96	7.426.738,40	0,28%	2,55%	0,99%	6,59%	38,66%	2,47%
Julho	293.596.005,40	8.199.426,71	1.912.616,87	298.024.969,15	-1.857.846,09	5.568.892,31	-0,62%	1,91%	1,45%	8,13%	23,51%	3,09%
Agosto	298.024.969,15	5.111.469,69	2.153.853,71	298.347.549,55	-2.635.035,58	2.933.856,73	-0,88%	1,02%	1,36%	9,59%	10,62%	3,28%
Setembro	298.347.549,55	46.812.608,18	48.961.182,42	292.886.081,56	-3.312.893,75	-379.037,02	-1,11%	-0,10%	1,62%	11,37%	-0,91%	3,66%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



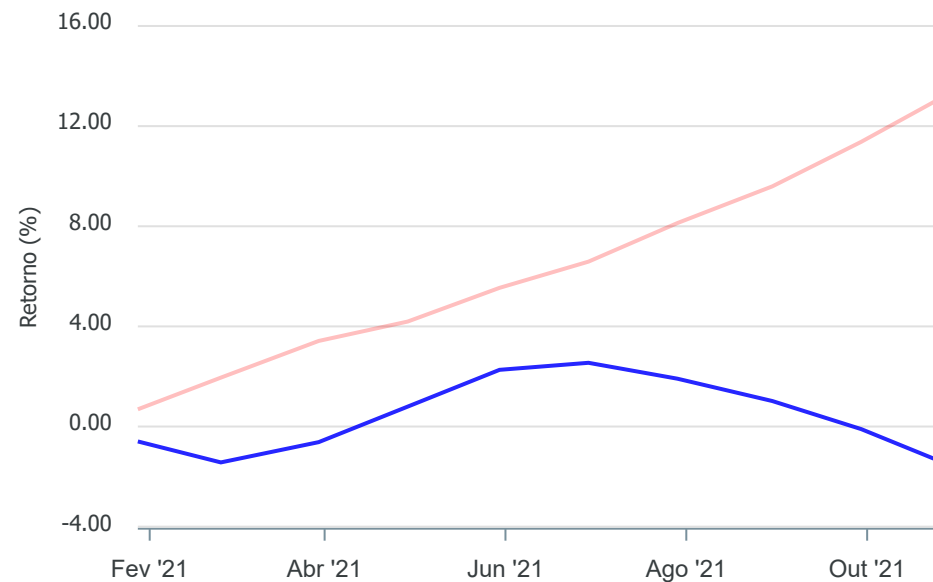
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	4.401.103,82	0,00	0,00	4.458.467,46	57.363,64	1,30%	1,30%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	138.339,37	0,00	0,00	140.133,38	1.794,01	1,30%	1,30%	0,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	18.071.015,75	0,00	0,00	18.265.878,05	194.862,30	1,08%	1,08%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.269.888,49	0,00	0,00	9.365.687,82	95.799,33	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.348.603,44	0,00	0,00	17.518.804,52	170.201,08	0,98%	0,98%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.234.596,23	0,00	0,00	6.295.544,72	60.948,49	0,98%	0,98%	0,82%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.958.217,17	0,00	0,00	8.034.767,60	76.550,43	0,96%	0,96%	1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.950.419,57	0,00	0,00	1.966.743,08	16.323,51	0,84%	0,84%	0,54%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	27.051.090,17	0,00	0,00	27.184.424,47	133.334,30	0,49%	0,49%	0,22%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	268.831,70	0,00	0,00	270.155,66	1.323,96	0,49%	0,49%	0,05%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.646.450,24	2.691.000,00	126.760,00	26.333.169,18	122.478,94	0,47%	0,51%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	11.164.088,85	0,00	0,00	11.204.984,74	40.895,89	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	33.170.462,84	0,00	6.000.000,00	27.285.146,47	114.683,63	0,35%	0,35%	0,48%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.579.805,58	0,00	0,00	3.590.729,76	10.924,18	0,31%	0,31%	0,25%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.710.763,41	17.421.608,18	17.422.308,41	14.751.259,37	41.196,19	0,13%	0,35%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.517.510,85	0,00	2.000.000,00	8.518.950,66	1.439,81	0,01%	-0,01%	0,80%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.400.156,72	0,00	0,00	5.391.840,84	-8.315,88	-0,15%	-0,15%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.435.228,31	0,00	0,00	8.422.088,25	-13.140,06	-0,16%	-0,16%	2,16%
Total Renda Fixa	203.316.572,51	20.112.608,18	25.549.068,41	198.998.776,03	1.118.663,75	0,55%		0,56%

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.085.214,33	85.214,33	1,70%	-4,73%	10,72%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.799.894,23	0,00	0,00	8.734.793,30	-65.100,93	-0,74%	-0,74%	1,80%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.638.059,35	0,00	0,00	1.612.954,82	-25.104,53	-1,53%	-1,53%	2,42%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	7.622.082,90	0,00	7.464.081,48	0,04	-158.001,38	-2,07%	-8,28%	12,42%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.515.182,62	0,00	4.000.000,00	420.636,54	-94.546,08	-2,09%	-4,58%	10,03%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	11.000.000,00	0,00	10.726.533,77	-273.466,23	-2,49%	-4,31%	14,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6.278.528,25	0,00	0,00	6.120.207,56	-158.320,69	-2,52%	-2,52%	12,52%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	1.866.723,27	5.000.000,00	0,00	6.678.525,08	-188.198,19	-2,74%	-5,45%	12,56%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.012.014,46	4.700.000,00	0,00	13.148.085,08	-563.929,38	-4,11%	-5,49%	12,63%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4.136.752,54	0,00	0,00	3.947.671,12	-189.081,42	-4,57%	-4,57%	6,09%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.984.294,58	0,00	0,00	5.708.907,67	-275.386,91	-4,60%	-4,60%	6,16%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.546.117,31	0,00	0,00	5.184.411,75	-361.705,56	-6,52%	-6,52%	10,48%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	14.983.417,43	0,00	0,00	14.005.783,19	-977.634,24	-6,52%	-6,52%	13,30%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.861.124,91	0,00	4.500.000,00	28.910,58	-332.214,33	-6,83%	-6,13%	11,54%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.170.382,30	0,00	7.448.032,53	0,01	-722.349,76	-8,84%	-8,84%	13,25%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.251.428,05	0,00	0,00	1.097.142,40	-154.285,65	-12,33%	-12,33%	20,93%
Total Renda Variável	84.666.002,20	25.700.000,00	23.412.114,01	82.499.777,24	-4.454.110,95	-5,12%		10,71%

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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3.081.246,46	0,00	0,00	3.148.717,55	67.471,09	2,19%	2,19%	6,22%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	4.056.433,43	0,00	0,00	4.068.556,20	12.122,77	0,30%	0,30%	6,19%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.227.294,95	0,00	0,00	3.201.229,86	-26.065,09	-0,81%	-0,81%	7,15%
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVE...	0,00	500.000,00	0,00	485.565,63	-14.434,37	-2,89%	0,71%	8,86%
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ...	0,00	500.000,00	0,00	483.459,05	-16.540,95	-3,31%	4,75%	10,07%
Total Exterior	10.364.974,84	1.000.000,00	0,00	11.387.528,29	22.553,45	0,20%		6,75%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	23.931.099,26	4.847.000,00	2.851.760,00	26.333.169,18	406.829,92	1,41%	1,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	18.047.687,43	0,00	0,00	18.265.878,05	218.190,62	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.323.006,97	0,00	0,00	17.518.804,52	195.797,55	1,13%	1,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.245.657,81	0,00	0,00	9.365.687,82	120.030,01	1,30%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.471.366,49	0,00	120.159,17	4.458.467,46	107.260,14	2,40%	2,44%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	11.108.617,74	0,00	0,00	11.204.984,74	96.367,00	0,87%	0,87%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.510.376,01	26.576.504,58	18.425.649,09	14.751.259,37	90.027,87	0,27%	0,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.226.738,00	0,00	0,00	6.295.544,72	68.806,72	1,11%	1,11%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.190.424,91	0,00	214.043,91	8.034.767,60	58.386,60	0,71%	-1,90%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.561.634,35	0,00	0,00	3.590.729,76	29.095,41	0,82%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.941.433,11	0,00	0,00	1.966.743,08	25.309,97	1,30%	1,30%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	266.489,65	0,00	0,00	270.155,66	3.666,01	1,38%	1,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	140.712,25	0,00	3.926,82	140.133,38	3.347,95	2,38%	2,42%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.438.382,35	0,00	0,00	5.391.840,84	-46.541,51	-0,86%	-0,86%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.591.376,42	0,00	2.000.000,00	8.518.950,66	-72.425,76	-0,68%	-0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.566.399,73	0,00	0,00	8.422.088,25	-144.311,48	-1,68%	-1,68%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	27.603.378,23	0,00	0,00	27.184.424,47	-418.953,76	-1,52%	-1,52%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	33.921.471,04	0,00	6.000.000,00	27.285.146,47	-636.324,57	-1,88%	-1,87%
				Total Renda Fixa	104.558,69	0,05%	

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
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.085.214,33	85.214,33	1,70%	-11,59%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.645.098,17	0,00	0,00	5.708.907,67	63.809,50	1,13%	1,13%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3.902.854,92	0,00	0,00	3.947.671,12	44.816,20	1,15%	1,15%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.683.005,33	0,00	0,00	1.612.954,82	-70.050,51	-4,16%	-4,16%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.954.230,92	0,00	0,00	8.734.793,30	-219.437,62	-2,45%	-2,45%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.689.404,80	4.700.000,00	0,00	13.148.085,08	-241.319,72	-1,80%	-1,98%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	11.000.000,00	0,00	10.726.533,77	-273.466,23	-2,49%	-1,11%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.388.570,85	0,00	0,00	1.097.142,40	-291.428,45	-20,99%	-20,99%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	0,00	7.000.000,00	0,00	6.678.525,08	-321.474,92	-4,59%	-12,34%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6.546.064,29	0,00	0,00	6.120.207,56	-425.856,73	-6,51%	-6,51%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5.017.683,10	0,00	4.000.000,00	420.636,54	-597.046,56	-11,90%	-14,14%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.851.183,33	0,00	0,00	5.184.411,75	-666.771,58	-11,40%	-11,40%
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	8.198.364,37	0,00	7.464.081,48	0,04	-734.282,85	-8,96%	-14,73%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.307.882,14	0,00	4.500.000,00	28.910,58	-778.971,56	-14,68%	-14,04%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.188.748,09	0,00	7.448.032,53	0,01	-1.740.715,55	-18,94%	-18,94%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	16.648.631,61	0,00	0,00	14.005.783,19	-2.642.848,42	-15,87%	-15,87%
				Total Renda Variável	-8.809.830,67	-9,65%	

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
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	3.655.877,33	0,00	0,00	4.068.556,20	412.678,87	11,29%	11,29%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.860.339,17	0,00	0,00	3.148.717,55	288.378,38	10,08%	10,08%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.971.815,23	0,00	0,00	3.201.229,86	229.414,63	7,72%	7,72%
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVE...	0,00	500.000,00	0,00	485.565,63	-14.434,37	-2,89%	11,62%
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ...	0,00	500.000,00	0,00	483.459,05	-16.540,95	-3,31%	13,41%
				Total Exterior	899.496,56	8,58%	

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.