

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)

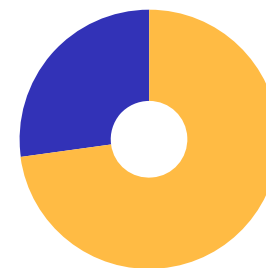
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			139.204.047,63	39,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	28.858.963,87	8,21%	257	2,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	43.516.739,20	12,38%	1.013	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.335.272,15	0,38%	293	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.969.788,73	0,84%	768	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	27.967.229,48	7,96%	148	2,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.213.268,63	0,35%	4.400	1,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.296.725,59	0,37%	28	1,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	Não se ...	Não se aplica	411.814,14	0,12%	20	5,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	1.170.502,98	0,33%	13	0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	D+21	Não há	4.586.632,83	1,30%	1.905	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	3.497.447,77	1,00%	23	3,22%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	Término...	Não há	4.879,29	0,00%	749	0,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	13.212.870,56	3,76%	114	2,16%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA IBX FI AÇÕES	D+3	Não há	8.415.246,91	2,39%	719	4,76%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	3.897.635,58	1,11%	45.479	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	24.495.764,17	6,97%	1.367	1,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	9.737.671,74	2,77%	844	5,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.190.698,67	1,76%	14.776	2,26%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.893.942,52	1,11%	6.223	0,35%	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
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	9.879.296,81	2,81%	3.380	0,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.766.058,77	0,50%	9.019	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	D+4	Não há	8.399.778,89	2,39%	1.049	3,25%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.558.679,84	1,58%	1.276	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.423.345,09	0,40%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			351.480.956,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.423.345,09				Artigo 6º
PL Total			352.904.301,84				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	139.204.047,63	39,61%	0,00%	37,63%	70,00%	106.832.622,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	72.375.703,07	20,59%	20,00%	21,60%	40,00%	68.216.679,63
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	70.296.191,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.335.272,15	0,38%	0,00%	0,42%	5,00%	16.238.775,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	33.447.012,43	9,52%	5,00%	10,85%	40,00%	107.145.370,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	70.296.191,35
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.574.047,84
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.574.047,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.582.317,12	0,45%	0,00%	0,00%	5,00%	15.991.730,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	8.088.959,89	2,30%	0,00%	2,53%	5,00%	9.485.087,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.574.047,84
Total Renda Fixa	100,00%	256.033.312,29	72,84%	25,00%	73,03%	220,00%	

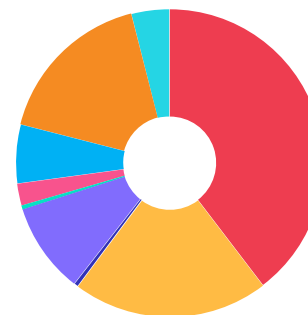


RENDA FIXA 256.033.312,29
RENDA VARIÁVEL 95.447.644,46

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	21.628.117,47	6,15%	5,00%	7,00%	20,00%	48.668.073,88
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	59.861.068,26	17,03%	5,00%	14,97%	20,00%	10.435.123,09
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	70.296.191,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.958.458,73	3,97%	2,00%	5,00%	10,00%	21.189.636,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	8.787.023,92
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.574.047,84
Total Renda Variável	30,00%	95.447.644,46	27,16%	12,00%	26,97%	77,50%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.574.047,84
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.574.047,84
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	17.574.047,84
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	139.204.047,63	39,61	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	60.862.772,54	17,32	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	58.064.881,91	16,52	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.726.388,18	10,16	0,00
ICATU VANGUARDA	16.895.822,26	4,81	0,04
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	10.950.940,37	3,12	0,16
OCCAM BRASIL	9.879.296,81	2,81	0,03
GENIAL INVESTIMENTOS	6.190.698,67	1,76	0,07
ITAÚ UNIBANCO	5.558.679,84	1,58	0,00
PLURAL	5.079.764,89	1,45	0,08
BANCO J. SAFRA S/A	1.766.058,77	0,50	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.296.725,59	0,37	0,73
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	4.879,29	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 ' a '	139.204.047,63	39,61	37,63	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	72.375.703,07	20,59	30,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.335.272,15	0,38	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	33.447.012,43	9,52	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	8.088.959,89	2,30	0,00	4,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	21.628.117,47	6,15	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	59.861.068,26	17,03	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	13.958.458,73	3,97	2,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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
IMA Geral (Benchmark)	-0,01%	-0,38%	-0,52%	0,96%	2,48%	6,93%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,68%	3,02%	0,58%	2,87%	7,02%	12,85%	1,36%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,26%	-6,63%	-4,19%	-1,61%	3,20%	1,48%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,30%	-6,78%	-4,26%	-1,76%	2,89%	0,97%	3,81%	0,09%
120% do CDI (Benchmark)	0,53%	3,02%	1,47%	2,42%	3,60%	8,04%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSECTORIAL	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,95%	1,69%	1,01%	2,43%	4,98%	12,47%	0,81%	0,02%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,89%	1,66%	0,87%	2,11%	4,90%	11,72%	0,86%	0,02%
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%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	-0,13%	-0,48%	-0,46%	-0,91%	-1,03%	-6,25%	0,13%	0,01%
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%

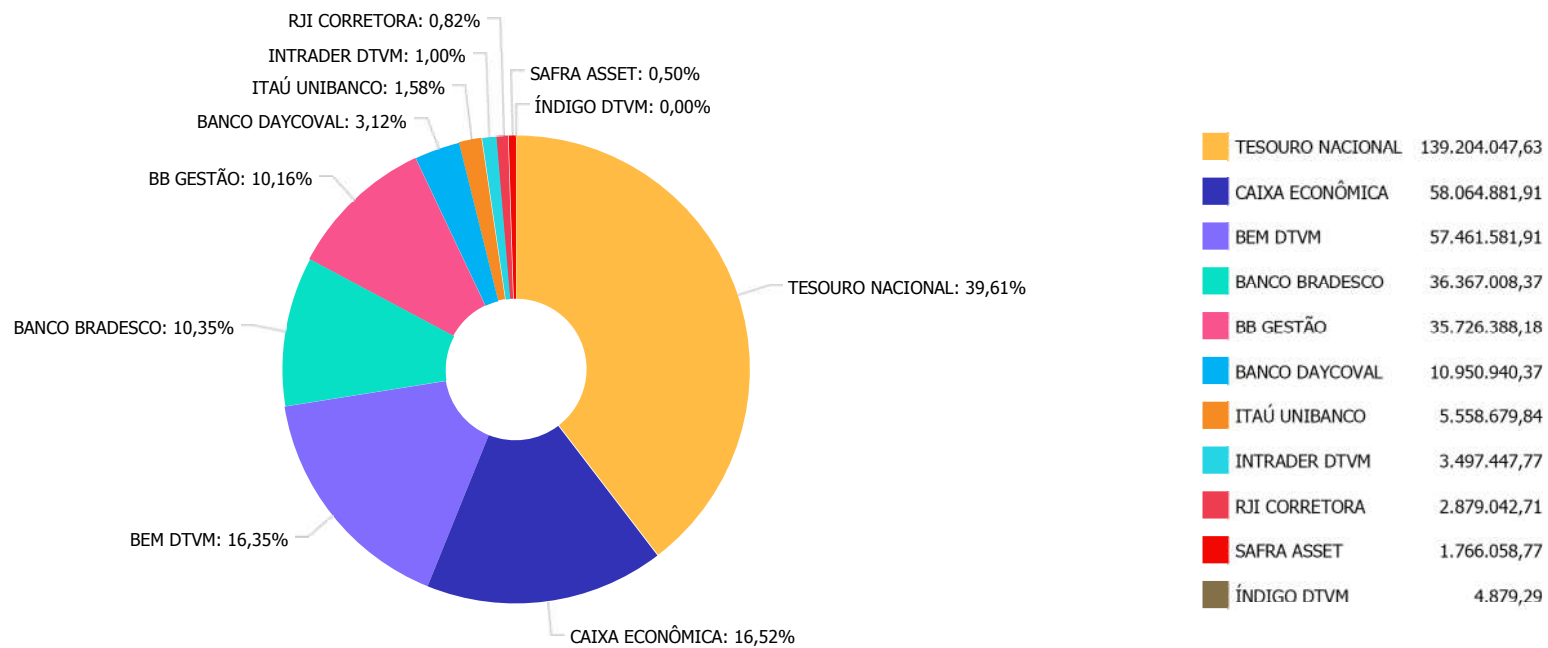
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	-1,57%	5.168.313.136.030,00%	-16,27%	5.168.313.136.030,00%	5.168.313.136.030,00%	5.168.313.136.030,00%	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,50%	-3,87%	0,06%	2,24%	-2,88%	61,07%	0,50%	0,05%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,36%	-1,87%	-1,73%	-0,98%	-0,55%	-3,28%	1,28%	0,02%

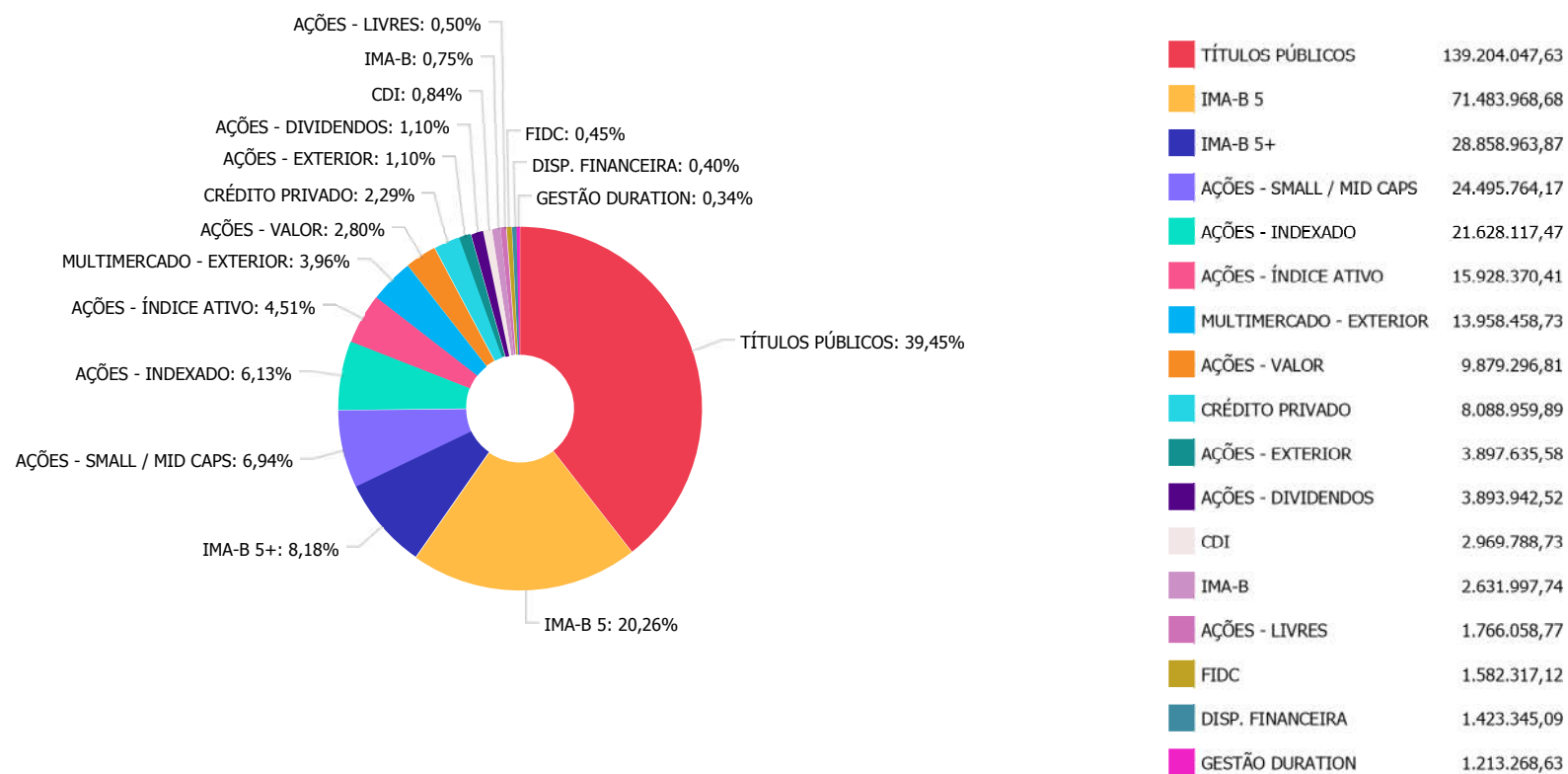
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	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%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-4,78%	16,09%	0,67%	9,26%	28,99%	-	5,97%	0,13%
IBX (Benchmark)	-6,99%	-5,99%	-13,61%	-5,31%	17,82%	7,71%	-	-
BRADERCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-3,91%	2,47%	-9,75%	2,89%	17,72%	15,75%	12,89%	0,17%
ICATU VANGUARDA IBX FI AÇÕES	-6,81%	-5,66%	-13,76%	-5,48%	17,63%	8,78%	12,33%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,61%	-11,00%	-13,82%	-8,35%	6,94%	-11,33%	10,86%	0,21%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-6,38%	-9,90%	-12,55%	-4,99%	10,51%	-0,30%	11,74%	0,20%
OCCAM FIC AÇÕES	-6,93%	-8,92%	-12,94%	-6,39%	11,87%	5,28%	11,32%	0,20%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-8,39%	-10,55%	-15,58%	-7,88%	9,84%	-0,05%	12,68%	0,21%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-8,94%	-4,10%	-15,01%	-4,29%	13,06%	21,82%	12,22%	0,18%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-6,56%	-6,91%	-12,44%	-4,94%	16,86%	5,56%	12,44%	0,23%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,61%	17,45%	1,14%	9,99%	30,80%	44,41%	6,14%	0,14%
BRADERCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	-4,70%	16,72%	0,92%	9,55%	30,02%	42,82%	6,12%	0,13%

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



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



Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
LFT - Letra Financeira do Tesouro	01/09/2024	31/05/2019	494	10.129,355103	11.025,239944	5.003.901,42	5.446.468,53	Curva
LFT - Letra Financeira do Tesouro	01/09/2025	16/04/2020	945	10.573,88657	11.016,747103	9.992.322,81	10.410.826,01	Curva
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2023	16/05/2019	12.443	723,347484	871,994604	9.000.612,74	10.850.228,86	Curva
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2023	24/07/2019	6.408	780,251724	895,804379	4.999.853,05	5.740.314,46	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	16/04/2020	515	3.883,55835	4.157,701086	2.000.032,55	2.141.216,06	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	12/04/2019	1.890	3.704,564038	4.131,018634	7.001.626,03	7.807.625,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	01/03/2019	651	3.836,072947	4.361,418038	2.497.283,49	2.839.283,14	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	28/03/2019	785	3.821,862525	4.317,279365	3.000.162,08	3.389.064,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	28/05/2019	1.800	3.924,661788	4.443,234457	7.064.391,22	7.997.822,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2019	1.652	4.236,052066	4.723,695049	6.997.958,01	7.803.544,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2020	944	4.235,741459	4.692,382999	3.998.539,94	4.429.609,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	16/04/2020	41	4.074,31034	4.458,170770	167.046,72	182.785,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	16/04/2020	700	4.074,31034	4.458,170770	2.852.017,24	3.120.719,54	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	24/10/2018	1.115	3.586,592611	4.130,634055	3.999.050,76	4.605.656,97	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	14/11/2018	1.111	3.601,810354	4.125,444071	4.001.611,30	4.583.368,36	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	07/07/2020	685	4.379,998727	4.882,837471	3.000.299,13	3.344.743,67	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	12/04/2019	1.647	4.006,792493	4.538,320681	6.599.187,24	7.474.614,16	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	20/12/2019	2.377	4.836,216123	5.322,825064	11.495.685,72	12.652.355,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	16/04/2020	1.186	4.267,740000	4.692,097312	5.061.539,64	5.564.827,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	13/10/2020	1.550	4.498,413021	4.914,534100	6.972.540,18	7.617.527,86	Curva

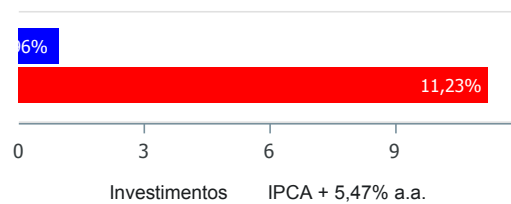
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	24/08/2021	464	4309,722839	4.389,994083	1.999.711,40	2.036.957,25	Curva
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2031	17/04/2020	8.183	1.228,38937	1.204,567439	10.051.910,21	9.856.975,35	Curva
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2031	21/06/2021	8.783	1.081,701032	962,608531	9.500.580,16	8.454.590,73	Mercado

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	335.961.816,36	2.700.000,00	0,00	336.749.933,04	-1.911.883,32	-1.911.883,32	-0,56%	-0,56%	0,67%	0,67%	-83,68%	4,87%
Fevereiro	336.749.933,04	15.331.477,95	12.949.747,50	335.137.435,43	-3.994.228,06	-5.906.111,38	-1,18%	-1,74%	1,24%	1,93%	-90,05%	5,22%
Março	335.137.435,43	7.842.868,89	7.741.678,55	338.723.779,25	3.485.153,48	-2.420.957,90	1,04%	-0,71%	1,42%	3,38%	-21,15%	5,68%
Abril	338.723.779,25	21.625.227,38	32.043.705,29	332.497.678,48	4.192.377,14	1.771.419,24	1,24%	0,51%	0,73%	4,14%	12,44%	3,74%
Mai	332.497.678,48	17.571.156,59	4.796.384,87	352.543.132,32	7.270.682,12	9.042.101,36	2,11%	2,63%	1,28%	5,47%	48,13%	4,59%
Junho	352.543.132,32	13.227.780,95	11.903.851,28	355.895.941,49	2.028.879,50	11.070.980,86	0,57%	3,22%	0,98%	6,50%	49,55%	3,68%
Julho	355.895.941,49	3.427.315,18	2.028.090,93	354.873.601,11	-2.421.564,63	8.649.416,23	-0,68%	2,52%	1,43%	8,02%	31,42%	4,52%
Agosto	354.873.601,11	13.610.462,20	12.578.067,63	354.381.276,15	-1.524.719,53	7.124.696,70	-0,43%	2,08%	1,34%	9,47%	21,98%	4,88%
Setembro	354.381.276,15	5.330.510,35	4.313.195,17	351.480.956,75	-3.917.634,58	3.207.062,12	-1,10%	0,96%	1,61%	11,23%	8,51%	5,91%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



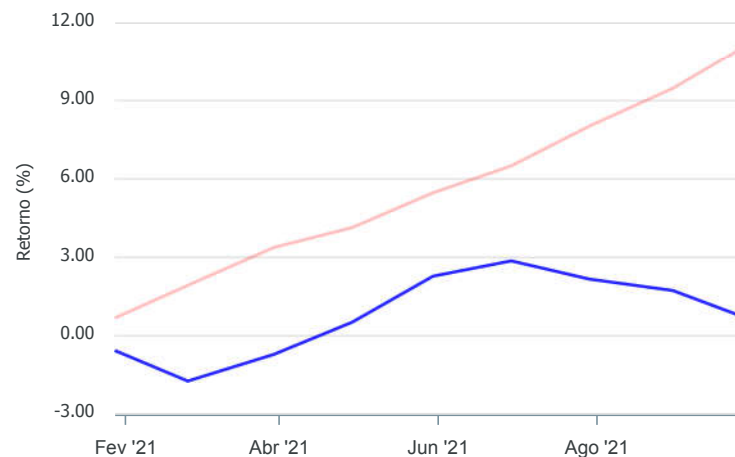
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	137.601.454,20	0,00	0,00	139.204.047,63	1.602.593,43	1,16%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	43.093.959,42	0,00	0,00	43.516.739,20	422.779,78	0,98%	0,98%	0,81%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	27.703.943,04	0,00	0,00	27.967.229,48	263.286,44	0,95%	0,95%	0,81%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.202.592,77	0,00	0,00	1.213.268,63	10.675,86	0,89%	0,89%	0,86%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	4.555.697,69	0,00	0,00	4.586.632,83	30.935,14	0,68%	0,68%	1,36%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.854,97	0,00	0,00	4.879,29	24,32	0,50%	0,50%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.940.004,90	2.217.315,18	1.200.000,00	2.969.788,73	12.468,65	0,30%	0,46%	0,03%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	1.170.502,98	0,00	0,00	1.170.502,98	0,00	0,00%	-	-
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	3.501.941,71	0,00	0,00	3.497.447,77	-4.493,94	-0,13%	-0,13%	0,13%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.337.177,38	0,00	0,00	1.335.272,15	-1.905,23	-0,14%	-0,14%	2,20%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.301.431,02	0,00	0,00	1.296.725,59	-4.705,43	-0,36%	-0,36%	1,28%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	29.239.578,74	0,00	0,00	28.858.963,87	-380.614,87	-1,30%	-1,30%	3,81%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	418.388,03	0,00	0,00	411.814,14	-6.573,89	-1,57%	-	-
Total Renda Fixa	253.071.526,85	2.217.315,18	1.200.000,00	256.033.312,29	1.944.470,26	0,77%		1,57%

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
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.103.450,88	0,00	3.113.195,17	0,00	9.744,29	0,31%	0,27%	1,68%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.671.030,49	3.113.195,17	0,00	5.558.679,84	-225.545,82	-3,90%	-4,61%	6,14%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	25.491.598,30	0,00	0,00	24.495.764,17	-995.834,13	-3,91%	-3,91%	12,89%
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	8.814.137,97	0,00	0,00	8.399.778,89	-414.359,08	-4,70%	-4,70%	6,12%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	4.093.397,20	0,00	0,00	3.897.635,58	-195.761,62	-4,78%	-4,78%	5,97%
GERAÇÃO FI AÇÕES	6.612.796,83	0,00	0,00	6.190.698,67	-422.098,16	-6,38%	-6,38%	11,74%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	14.139.859,89	0,00	0,00	13.212.870,56	-926.989,33	-6,56%	-6,56%	12,44%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.169.375,61	0,00	0,00	3.893.942,52	-275.433,09	-6,61%	-6,61%	10,86%
ICATU VANGUARDA IBX FI AÇÕES	9.030.242,96	0,00	0,00	8.415.246,91	-614.996,05	-6,81%	-6,81%	12,33%
OCCAM FIC AÇÕES	10.614.654,25	0,00	0,00	9.879.296,81	-735.357,44	-6,93%	-6,93%	11,32%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	10.629.812,27	0,00	0,00	9.737.671,74	-892.140,53	-8,39%	-8,39%	12,68%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.939.392,65	0,00	0,00	1.766.058,77	-173.333,88	-8,94%	-8,94%	12,22%
Total Renda Variável	101.309.749,30	3.113.195,17	3.113.195,17	95.447.644,46	-5.862.104,84	-5,61%		11,15%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	134.708.848,87	1.999.711,40	1.592.843,56	139.204.047,63	4.088.330,92	2,99%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	43.030.377,78	0,00	0,00	43.516.739,20	486.361,42	1,13%	1,13%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	27.688.072,20	0,00	0,00	27.967.229,48	279.157,28	1,01%	1,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	505.462,72	8.642.066,16	6.213.315,00	2.969.788,73	35.574,85	0,39%	1,31%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	4.560.361,57	0,00	0,00	4.586.632,83	26.271,26	0,58%	0,58%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.202.775,79	0,00	0,00	1.213.268,63	10.492,84	0,87%	0,87%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.876,60	0,00	0,00	4.879,29	2,69	0,06%	0,06%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	1.170.502,98	0,00	0,00	1.170.502,98	0,00	0,00%	0,00%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	3.513.423,26	0,00	0,00	3.497.447,77	-15.975,49	-0,45%	-0,45%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.357.588,49	0,00	0,00	1.335.272,15	-22.316,34	-1,64%	-1,64%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.319.523,84	0,00	0,00	1.296.725,59	-22.798,25	-1,73%	-1,73%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	491.848,93	0,00	0,00	411.814,14	-80.034,79	-16,27%	-16,27%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	32.232.254,85	0,00	2.000.000,00	28.858.963,87	-1.373.290,98	-4,26%	-4,26%
				Total Renda Fixa	3.411.775,41	1,35%	

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 (%)	(%) Instt
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	8.323.146,74	0,00	0,00	8.399.778,89	76.632,15	0,92%	0,92%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	3.897.635,58	-102.364,42	-2,56%	0,67%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.218.495,23	0,00	3.113.195,17	0,00	-105.300,06	-3,27%	-3,31%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	5.726.510,17	0,00	5.558.679,84	-167.830,33	-2,93%	1,14%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.766.058,77	-233.941,23	-11,70%	-15,00%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.518.127,45	0,00	0,00	3.893.942,52	-624.184,93	-13,82%	-13,82%
GERAÇÃO FI AÇÕES	7.079.297,16	0,00	0,00	6.190.698,67	-888.598,49	-12,55%	-12,55%
ICATU VANGUARDA IBX FI AÇÕES	9.758.075,99	0,00	0,00	8.415.246,91	-1.342.829,08	-13,76%	-13,76%
OCCAM FIC AÇÕES	11.347.253,46	0,00	0,00	9.879.296,81	-1.467.956,65	-12,94%	-12,94%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	11.535.185,23	0,00	0,00	9.737.671,74	-1.797.513,49	-15,58%	-15,58%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	15.090.320,16	0,00	0,00	13.212.870,56	-1.877.449,60	-12,44%	-12,44%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	33.240.122,19	0,00	6.000.000,00	24.495.764,17	-2.744.358,02	-8,26%	-9,75%
				Total Renda Variável	-11.275.694,15	-10,57%	

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.