

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
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
TÍTULOS PÚBLICOS			256.959.275,13	17,97%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.495.955,87	1,43%	578	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	67.102.298,26	4,69%	770	1,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	29.147.729,34	2,04%	581	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	27.772.214,81	1,94%	964	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	57.649.484,88	4,03%	1.013	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	31.969.915,86	2,24%	361	2,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	28.079.322,90	1,96%	29	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	20.626.804,58	1,44%	69	2,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	72.885.412,98	5,10%	178	6,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	36.855.486,24	2,58%	182	3,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	31.972.461,39	2,24%	22	2,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	14.626.268,93	1,02%	12.636	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	16.448.594,27	1,15%	9.687	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	14.897.371,58	1,04%	293	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI...	D+3	Não há	2.473.915,83	0,17%	1.785	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.665.894,67	0,47%	1.922	6,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	37.230.033,81	2,60%	587	0,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.664.749,13	0,96%	254	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	30.985.136,86	2,17%	148	2,67%	Artigo 7º, Inciso IV, 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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	29.473.032,87	2,06%	113	2,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	26.520.379,82	1,85%	249	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	4.406.185,69	0,31%	467	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	D+45 a ...	01/08/2016	8.678.635,31	0,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	10.970,32	0,00%	28	4,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		100,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	35.467.862,80	2,48%	11	3,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.406.256,76	0,80%	8.252	2,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	47.673.798,56	3,33%	5.979	2,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	10.326.856,53	0,72%	34	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.221.422,61	0,16%	5.641	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	Não há	14.019.366,81	0,98%	175	1,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	32.871.743,69	2,30%	135	4,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	9.046.068,28	0,63%	6.223	0,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.372.050,14	0,94%	286	3,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	30.876.154,34	2,16%	36.305	0,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.803.368,99	0,48%	53	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	28.662.215,18	2,00%	111	3,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	29.592.472,52	2,07%	12.342	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	13.370.233,78	0,94%	3.380	1,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

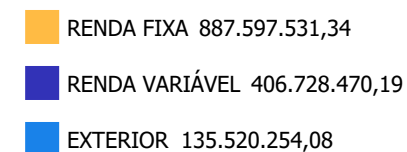
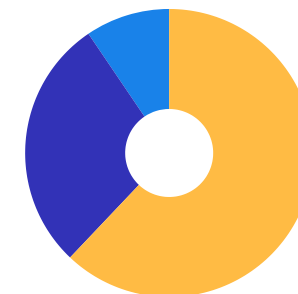
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.705.483,73	0,12%	2.314	0,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.985.798,89	0,56%	30	0,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.082.789,85	0,29%	37	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.811.206,32	0,41%	2.099	4,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC ...	D+2	27 meses	4.268.849,90	0,30%	723	4,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC...	D+2	22 meses	4.830.642,40	0,34%	668	4,35%	Artigo 8º, Inciso III
MAG FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.806.047,33	0,41%	34	4,94%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	37.692.607,79	2,64%	58.919	1,60%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	481.013,31	0,03%	21	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	6.979.939,68	0,49%	99	0,70%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL II FIC FUNDOS DE INVEST. EM PARTICIP...	Não se ...	Não se aplica	1.877.763,14	0,13%	39	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO MULTIESTRAT...	Não se ...	Não se aplica	3.468.588,40	0,24%		1,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.034.278,94	0,35%		14,08%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I M...	Não se ...	Não se aplica	18.239.770,58	1,28%		1,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FI...	Não se ...	Não se aplica	4.270.722,04	0,30%	46	3,69%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	5.321.096,90	0,37%		5,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	3.162.000,00	0,22%		4,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	21.660.261,60	1,51%	89	0,92%	Artigo 9º - A, Inciso II
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVES...	D+5 du	Não há	14.810.568,66	1,04%	4.412	3,77%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	31.647.512,93	2,21%	15.859	2,02%	Artigo 9º - A, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.813.419,76	0,34%	4.137	2,72%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	18.551.250,48	1,30%	13.296	0,92%	Artigo 9º - A, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	6.264.940,88	0,44%	358	2,34%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR I...	D+5 du	Não há	5.543.706,78	0,39%	1.191	2,59%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	32.228.592,99	2,25%	145.494	0,83%	Artigo 9º - A, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		2.248.569,39	0,16%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.429.846.255,61				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.248.569,39				Artigo 6º
PL Total			1.432.094.825,00				

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 ' a '	100,00%	256.959.275,13	17,97%	17,00%	25,00%	40,00%	314.979.227,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	455.631.950,31	31,87%	20,00%	22,00%	50,00%	259.291.177,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	17.371.287,41	1,21%	1,00%	5,00%	35,00%	483.074.902,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	148.945.412,85	10,42%	1,00%	6,00%	40,00%	422.993.089,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	8.689.605,64	0,61%	1,00%	2,00%	3,00%	34.205.782,03
Total Renda Fixa	100,00%	887.597.531,34	62,08%	40,00%	60,00%	168,00%	



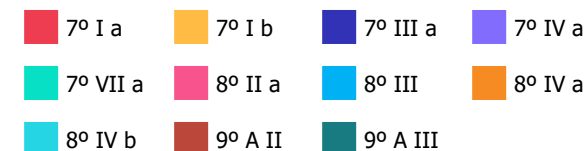
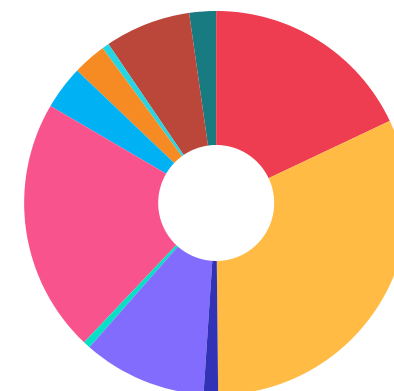
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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%	1,00%	1,00%	5,00%	71.492.312,78
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	305.295.149,78	21,35%	6,00%	18,00%	25,00%	52.166.414,12
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	52.598.147,42	3,68%	1,00%	6,00%	10,00%	90.386.478,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	40.352.076,09	2,82%	1,00%	3,00%	3,00%	2.543.311,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	8.483.096,90	0,59%	1,00%	2,00%	5,00%	63.009.215,88
Total Renda Variável	35,00%	406.728.470,19	28,45%	10,00%	30,00%	48,00%	

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%	103.291.661,09	7,22%	1,00%	8,00%	10,00%	39.692.964,47
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	32.228.592,99	2,25%	1,00%	2,00%	10,00%	110.756.032,57
Total Exterior	10,00%	135.520.254,08	9,48%	2,00%	10,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	256.959.275,13	17,97	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	189.301.028,01	13,24	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	164.670.796,78	11,52	0,04
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	141.388.479,43	9,89	0,02
WESTERN ASSET	106.724.070,49	7,46	0,21
ITAÚ UNIBANCO	99.430.799,48	6,95	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	76.072.806,52	5,32	0,27
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	60.458.169,73	4,23	0,01
VINCI PARTNERS	55.244.622,39	3,86	0,03
XP ASSET MANAGEMENT	42.272.139,01	2,96	0,88
ICATU VANGUARDA	37.125.391,18	2,60	0,08
ARX INVESTIMENTOS	35.467.862,80	2,48	0,07
MOAT CAPITAL	29.592.472,52	2,07	0,22
KINEA INVESTIMENTOS	23.274.049,52	1,63	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	20.626.804,58	1,44	0,01
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	14.626.268,93	1,02	0,05
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	14.547.713,83	1,02	0,00
OCCAM BRASIL	13.370.233,78	0,94	0,05
OLIVEIRA TRUST	8.678.635,31	0,61	0,07
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	8.279.963,16	0,58	0,08
TARPON INVESTIMENTOS	7.985.798,89	0,56	0,12
ITAÚ DTVM	6.803.368,99	0,48	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	6.264.940,88	0,44	0,10
BV ASSET	5.321.096,90	0,37	0,01
REAG GESTORA DE RECURSOS	3.162.000,00	0,22	0,69
PERFIN INVESTIMENTOS	1.705.483,73	0,12	0,01
BRZ INVESTIMENTOS	481.013,31	0,03	0,02

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	0,54%	3,42%	1,53%	2,63%	4,22%	9,22%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	0,65%	4,41%	1,87%	3,29%	5,56%	11,08%	-	0,00%

CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,73%	5,17%	2,13%	3,80%	6,58%	14,23%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-18,13%	-57,66%	-33,38%	-47,56%	-54,43%	-51,70%	-	0,25%

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%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,99%	2,33%	1,12%	2,52%	5,72%	13,16%	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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,95%	1,69%	1,01%	2,43%	4,98%	12,47%	0,81%	0,02%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,67%	-1,44%	-0,23%	1,10%	2,93%	11,68%	1,06%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,13%	-2,44%	-1,62%	0,46%	4,43%	6,22%	2,18%	0,06%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,20%	-3,14%	-1,80%	0,31%	3,79%	5,90%	2,08%	0,06%
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%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,62%	-4,91%	-2,80%	-0,57%	2,21%	5,16%	2,34%	0,07%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,15%	-2,50%	-1,65%	0,38%	4,42%	6,07%	2,17%	0,06%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	-0,38%	-2,91%	-1,91%	0,15%	4,03%	6,14%	2,48%	0,06%

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 (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%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,34%	-3,09%	-1,50%	-0,33%	-1,07%	4,87%	1,42%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,50%	2,89%	1,37%	2,34%	3,54%	6,21%	0,04%	0,00%
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	-0,16%	-0,69%	-0,67%	-0,15%	-0,23%	3,81%	0,97%	0,01%
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%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	-0,85%	-0,46%	0,90%	2,78%	-	0,67%	0,03%
Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-90,00%	-	0,00%	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-1,25%	-4,68%	-4,34%	-2,06%	2,00%	3,32%	1,94%	0,06%

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 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-1,38%	-0,70%	0,51%	1,75%	5,52%	0,80%	0,03%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	0,96%	2,10%	1,00%	2,40%	5,46%	12,70%	0,84%	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
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	2,35%	18,65%	6,80%	12,39%	26,71%	50,29%	-	-
BTG PACTUAL II FIC FUNDOS DE INVEST. EM PARTICIPAÇÕES INFRAESTRUT...	-0,11%	-13,13%	-0,33%	-25,05%	-11,28%	28,99%	0,00%	0,31%
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,73%	12,43%	4,83%	8,38%	17,93%	30,14%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-9,74%	-93,23%	-21,05%	-27,08%	-92,81%	-93,76%	32,84%	0,17%
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%
IBX (Benchmark)	-6,99%	-5,99%	-13,61%	-5,31%	17,82%	7,71%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-4,19%	-1,53%	-13,08%	-1,14%	15,16%	14,06%	7,51%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-6,60%	-8,41%	-13,64%	-6,12%	11,40%	5,54%	11,68%	0,21%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,46%	-12,63%	-18,55%	-11,38%	-6,81%	-7,15%	11,93%	0,17%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-7,98%	-9,65%	-14,44%	-7,16%	9,34%	9,32%	11,95%	0,22%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,84%	-15,32%	-18,94%	-14,07%	-4,83%	0,46%	13,25%	0,17%

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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-4,58%	-7,51%	-14,14%	-4,51%	8,01%	-2,82%	10,03%	0,18%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,33%	-10,78%	-10,45%	-3,56%	3,82%	-12,73%	9,33%	0,21%
OCCAM FIC AÇÕES	-6,93%	-8,92%	-12,94%	-6,39%	11,87%	5,28%	11,32%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,10%	-3,73%	-12,45%	0,03%	13,48%	-13,14%	12,57%	0,22%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,61%	-11,00%	-13,82%	-8,35%	6,94%	-11,33%	10,86%	0,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,52%	-0,57%	-11,40%	-1,65%	19,26%	6,71%	10,48%	0,18%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-6,97%	-8,19%	-12,76%	-6,02%	11,25%	12,61%	11,57%	0,20%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO	-0,17%	0,52%	0,43%	1,40%	2,26%	6,68%	1,66%	0,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	0,67%	0,03%	1,43%	1,40%	2,05%	-	1,37%	0,03%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,60%	-3,00%	-10,78%	-3,58%	-	-	12,18%	-
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	1,09%	17,66%	-6,41%	12,80%	44,83%	-	11,75%	0,23%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
MAG FI MULTIMERCADO	0,33%	0,50%	0,85%	2,01%	2,65%	4,47%	0,23%	0,02%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,93%	14,39%	5,46%	9,65%	20,68%	36,28%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS MULTISTRATÉGIA FIP	-0,07%	62,97%	0,66%	63,50%	58,13%	27,78%	0,00%	0,63%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-2,26%	-37,83%	-18,51%	-17,68%	-29,78%	-54,77%	8,48%	0,44%

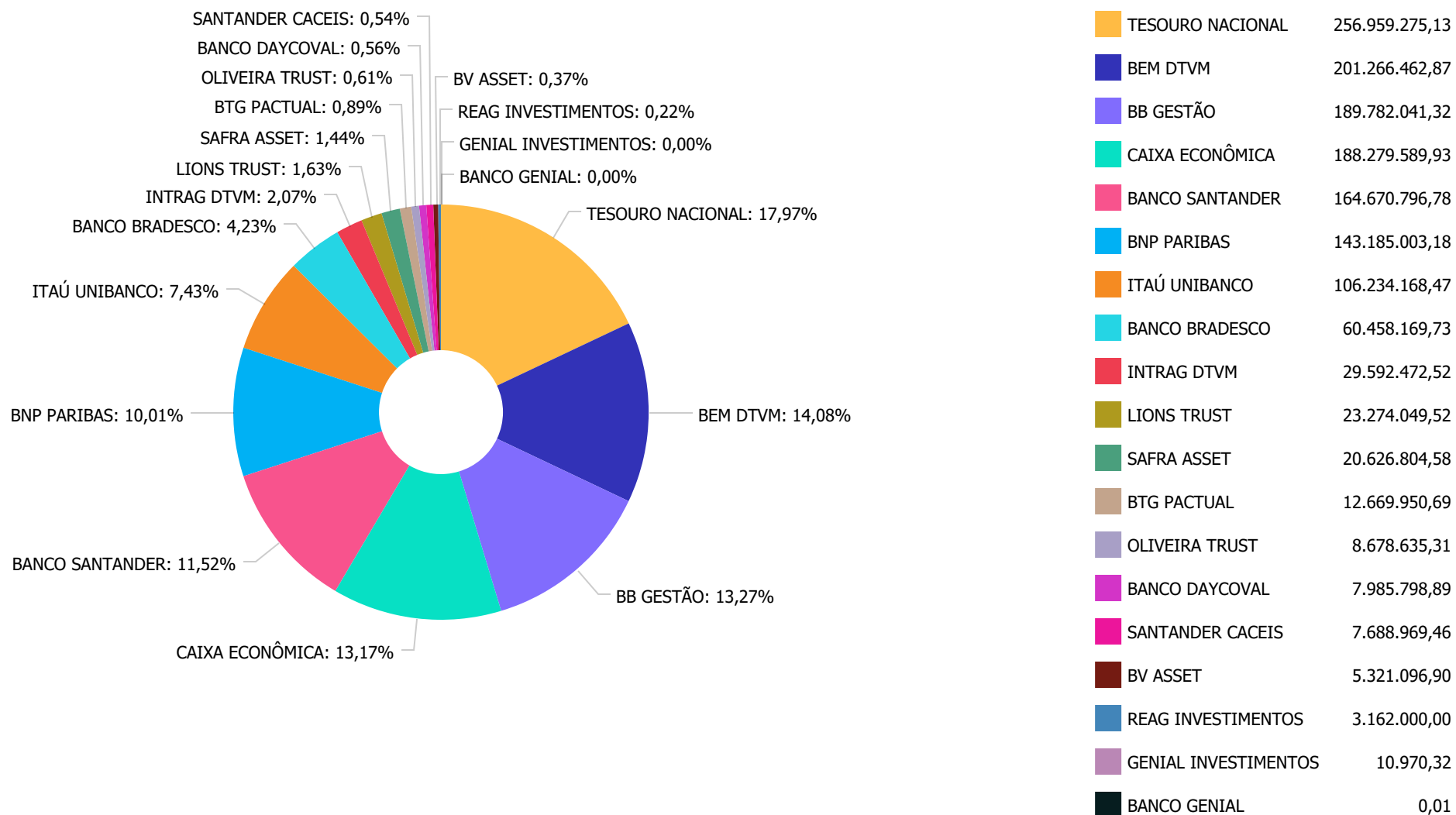
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,04%	-0,12%	-0,13%	-0,53%	-13,35%	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FI...	-1,09%	25,36%	-3,05%	-4,50%	24,54%	-	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	-1,45%	-7,48%	-2,44%	-4,88%	46,79%	-	1,91%	0,63%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-8,30%	-	-4,28%	-5,77%	-	-	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,87%	-7,28%	-8,61%	-4,19%	16,44%	-0,38%	11,32%	0,22%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,21%	-1,54%	-13,10%	-1,15%	15,18%	-	7,55%	0,18%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	-4,00%	-15,18%	-15,84%	-9,44%	3,36%	-	12,75%	0,25%

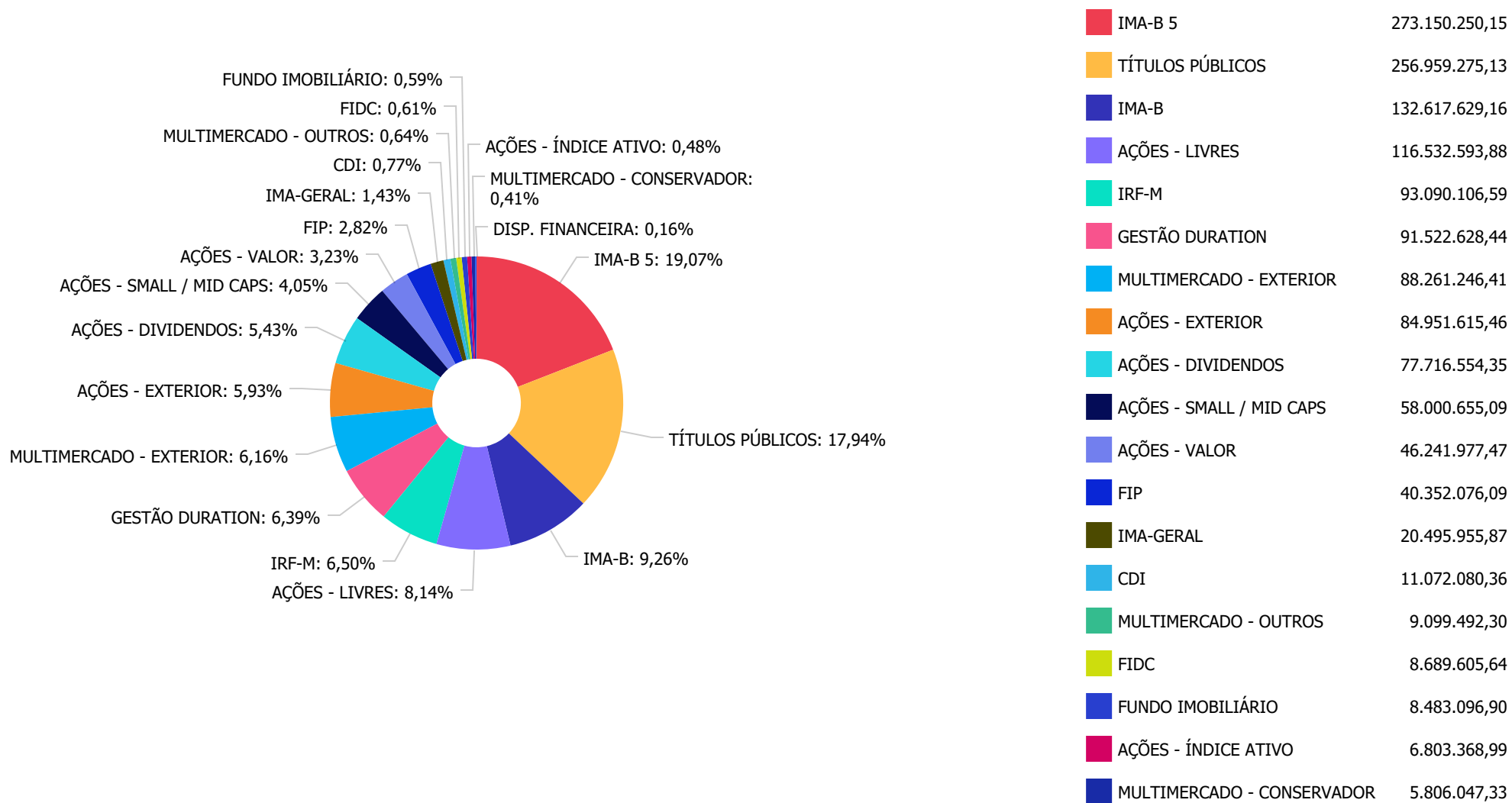
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,33%	15,97%	7,99%	2,32%	20,85%	95,63%	6,11%	0,10%
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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY FIC IE ...	-0,18%	18,91%	9,58%	2,96%	27,94%	74,99%	7,13%	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	0,61%	5,53%	3,25%	-0,98%	8,39%	-	7,76%	0,10%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INVESTIMENTO NO EX...	4,14%	4,11%	9,83%	4,99%	1,36%	43,88%	5,29%	0,09%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,50%	17,34%	9,62%	7,13%	17,85%	105,44%	6,82%	0,10%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	1,46%	20,32%	10,07%	5,44%	29,65%	-	5,72%	0,11%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERI...	-4,44%	12,17%	1,31%	11,89%	20,65%	55,04%	6,19%	0,14%

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



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



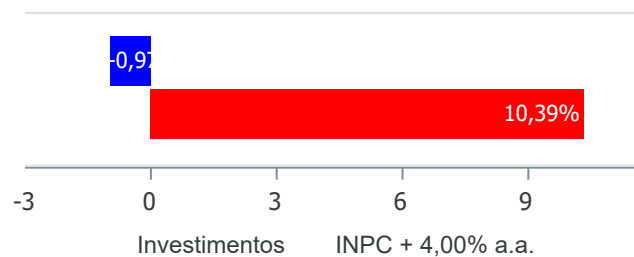
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2.000	2.593,340767	3.873,171283	5.186.681,53	7.746.342,57	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	31/05/2021	7.600	3825,999376	3.873,171283	29.077.595,26	29.436.101,75	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	3.898,088335	10.048.181,87	13.253.500,34	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	4.125,912891	14.651.394,86	14.234.399,47	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	4.125,912891	7.520.551,00	13.202.921,25	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	4.125,912891	13.087.396,08	16.503.651,56	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	4.125,912891	25.480.686,71	24.755.477,35	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	4.125,912891	36.097.639,50	35.070.259,57	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	4.125,912891	55.208.154,53	53.636.867,58	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.122,070764	24.699.419,65	24.732.424,58	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.233,049255	25.347.747,49	25.398.295,53	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	1.320.231.395,12	35.973.755,95	20.643.927,70	1.324.155.868,46	-11.405.354,91	-11.405.354,91	-0,85%	-0,85%	0,58%	0,58%	-146,58%	6,17%
Fevereiro	1.324.155.868,46	13.599.501,88	2.905.461,40	1.322.668.875,91	-12.181.033,03	-23.586.387,94	-0,91%	-1,76%	1,10%	1,69%	-103,95%	5,38%
Março	1.322.668.875,91	19.786.890,41	2.255.094,70	1.352.915.564,03	12.714.892,41	-10.871.495,53	0,95%	-0,83%	1,22%	2,93%	-28,17%	6,31%
Abril	1.352.915.564,03	30.923.340,78	5.109.519,98	1.399.842.495,29	21.113.110,46	10.241.614,93	1,53%	0,69%	0,69%	3,65%	18,97%	3,94%
Mai	1.399.842.495,29	83.985.765,84	65.161.724,13	1.438.277.214,52	19.610.677,52	29.852.292,45	1,38%	2,08%	1,29%	4,99%	41,80%	4,20%
Junho	1.438.277.214,52	6.736.515,45	5.396,65	1.447.926.778,84	2.918.445,52	32.770.737,97	0,20%	2,29%	0,93%	5,96%	38,42%	3,28%
Julho	1.447.926.778,84	5.983.707,30	2.918.196,69	1.438.353.625,33	-12.638.664,12	20.132.073,85	-0,87%	1,40%	1,37%	7,41%	18,88%	4,22%
Agosto	1.438.353.625,33	20.573.111,35	4.377.555,31	1.440.958.008,85	-13.591.172,52	6.540.901,33	-0,93%	0,45%	1,23%	8,73%	5,18%	4,25%
Setembro	1.440.958.008,85	64.143.603,00	54.789.933,32	1.429.846.255,61	-20.465.422,92	-13.924.521,59	-1,41%	-0,97%	1,53%	10,39%	-9,30%	4,73%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



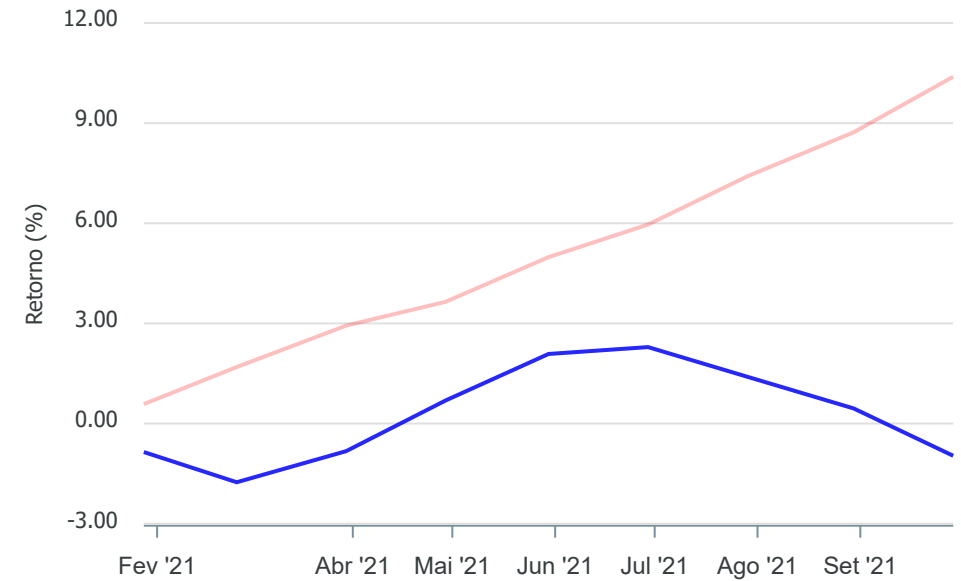
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	72.173.699,59	0,00	0,00	72.885.412,98	711.713,39	0,99%	0,99%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	57.089.400,76	0,00	0,00	57.649.484,88	560.084,12	0,98%	0,98%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	66.452.666,85	0,00	0,00	67.102.298,26	649.631,41	0,98%	0,98%	0,82%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	27.813.263,63	0,00	0,00	28.079.322,90	266.059,27	0,96%	0,96%	0,84%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	30.693.439,51	0,00	0,00	30.985.136,86	291.697,35	0,95%	0,95%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	26.300.266,83	0,00	0,00	26.520.379,82	220.112,99	0,84%	0,84%	0,54%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.338.495,16	0,00	0,00	16.448.594,27	110.099,11	0,67%	0,67%	1,06%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	8.623.007,86	0,00	0,00	8.678.635,31	55.627,45	0,65%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	4.384.249,39	0,00	0,00	4.406.185,69	21.936,30	0,50%	0,50%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	27.673.984,96	0,00	0,00	27.772.214,81	98.229,85	0,35%	0,35%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	37.190.160,54	0,00	0,00	37.230.033,81	39.873,27	0,11%	0,11%	0,67%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.497.044,69	0,00	0,00	20.495.955,87	-1.088,82	-0,01%	-0,01%	0,80%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.678.780,40	0,00	10.000.000,00	13.664.749,13	-14.031,27	-0,06%	-0,13%	2,18%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	47.532.226,06	0,00	18.000.000,00	29.473.032,87	-59.193,19	-0,12%	-0,20%	2,08%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	14.918.627,78	0,00	0,00	14.897.371,58	-21.256,20	-0,14%	-0,14%	2,20%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	36.911.850,63	0,00	0,00	36.855.486,24	-56.364,39	-0,15%	-0,15%	2,17%
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.676.317,76	0,00	0,00	6.665.894,67	-10.423,09	-0,16%	-0,16%	0,97%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.257.688,29	0,00	0,00	29.147.729,34	-109.958,95	-0,38%	-0,38%	1,41%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	2.483.250,57	0,00	0,00	2.473.915,83	-9.334,74	-0,38%	-0,38%	2,48%

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
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.171.747,42	0,00	10.000.000,00	31.972.461,39	-199.286,03	-0,47%	-0,34%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	44.199.066,67	0,00	12.000.000,00	31.969.915,86	-229.150,81	-0,52%	-0,37%	1,41%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	20.756.322,87	0,00	0,00	20.626.804,58	-129.518,29	-0,62%	-0,62%	2,34%
TÍTULOS PÚBLICOS	209.334.822,37	50.047.167,14	0,00	256.959.275,13	-2.422.714,38	-0,93%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	14.811.183,68	0,00	0,00	14.626.268,93	-184.914,75	-1,25%	-1,25%	1,94%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	13.400,32	0,00	0,00	10.970,32	-2.430,00	-18,13%	-	-
Total Renda Fixa	887.974.964,60	50.047.167,14	50.000.000,00	887.597.531,34	-424.600,40	-0,05%		1,16%

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
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	3.593.227,99	642.617,55	0,00	4.270.722,04	34.876,50	0,82%	-1,45%	1,91%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.798.722,52	0,00	0,00	4.830.642,40	31.919,88	0,67%	0,67%	1,37%
MAG FI MULTIMERCADO	5.787.082,03	0,00	0,00	5.806.047,33	18.965,30	0,33%	0,33%	0,23%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.032.361,49	0,00	0,00	5.034.278,94	1.917,45	0,04%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS MULTIESTRATÉGIA ...	481.325,26	0,00	0,00	481.013,31	-311,95	-0,06%	-0,06%	0,00%
BTG PACTUAL II FIC FUNDOS DE INVEST. EM PARTICIPAÇ...	1.879.732,05	0,00	0,00	1.877.763,14	-1.968,91	-0,10%	-0,10%	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.276.017,78	0,00	0,00	4.268.849,90	-7.167,88	-0,17%	-0,17%	1,66%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	0,00	8.011.693,04	0,00	7.985.798,89	-25.894,15	-0,32%	1,09%	11,75%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO MULTIESTRATÉG...	3.499.622,60	0,00	0,00	3.468.588,40	-31.034,20	-0,89%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	18.440.071,26	0,00	0,00	18.239.770,58	-200.300,68	-1,09%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	5.444.140,52	0,00	10.793,30	5.321.096,90	-112.250,32	-2,06%	-2,26%	8,48%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.011.541,76	0,00	0,00	5.811.206,32	-200.335,44	-3,33%	-3,33%	9,33%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	36.791.740,64	0,00	0,00	35.467.862,80	-1.323.877,84	-3,60%	-3,60%	12,18%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	30.824.318,06	0,00	0,00	29.592.472,52	-1.231.845,54	-4,00%	-4,00%	12,75%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	49.758.309,10	0,00	0,00	47.673.798,56	-2.084.510,54	-4,19%	-4,19%	7,51%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.780.705,58	0,00	0,00	10.326.856,53	-453.849,05	-4,21%	-4,21%	7,55%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.953.816,88	0,00	0,00	11.406.256,76	-547.560,12	-4,58%	-4,58%	10,03%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	39.510.827,90	0,00	0,00	37.692.607,79	-1.818.220,11	-4,60%	-4,60%	6,16%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.056.484,70	0,00	0,00	13.372.050,14	-684.434,56	-4,87%	-4,87%	11,32%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	6.796.956,31	662.985,25	0,00	6.979.939,68	-480.001,88	-6,43%	-	-

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 VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	14.991.670,17	0,00	0,00	14.019.366,81	-972.303,36	-6,49%	-6,49%	10,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	33.030.319,03	0,00	0,00	30.876.154,34	-2.154.164,69	-6,52%	-6,52%	10,48%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.284.398,55	0,00	0,00	6.803.368,99	-481.029,56	-6,60%	-6,60%	11,68%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.685.930,45	0,00	0,00	9.046.068,28	-639.862,17	-6,61%	-6,61%	10,86%
OCCAM FIC AÇÕES	14.365.436,31	0,00	0,00	13.370.233,78	-995.202,53	-6,93%	-6,93%	11,32%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.388.867,97	0,00	0,00	4.082.789,85	-306.078,12	-6,97%	-6,97%	11,57%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	35.720.883,63	0,00	0,00	32.871.743,69	-2.849.139,94	-7,98%	-7,98%	11,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	31.187.154,50	0,00	0,00	28.662.215,18	-2.524.939,32	-8,10%	-8,10%	12,57%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.436.867,98	0,00	0,00	2.221.422,61	-215.445,37	-8,84%	-8,84%	13,25%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	3.490.000,00	0,00	0,00	3.162.000,00	-328.000,00	-9,40%	-9,74%	32,84%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.904.614,22	0,00	0,00	1.705.483,73	-199.130,49	-10,46%	-10,46%	11,93%
Total Renda Variável	418.203.147,24	9.317.295,84	10.793,30	406.728.470,19	-20.781.179,59	-4,86%		9,96%

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
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	5.323.093,26	0,00	0,00	5.543.706,78	220.613,52	4,14%	4,14%	5,29%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	21.196.122,94	0,00	0,00	21.660.261,60	464.138,66	2,19%	2,19%	6,22%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	6.175.041,29	0,00	0,00	6.264.940,88	89.899,59	1,46%	1,46%	5,72%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	18.307.699,94	0,00	0,00	18.551.250,48	243.550,54	1,33%	1,33%	6,11%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	0,00	4.779.140,02	0,00	4.813.419,76	34.279,74	0,72%	-0,18%	7,13%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	31.456.096,49	0,00	0,00	31.647.512,93	191.416,44	0,61%	0,61%	7,76%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	4.754.992,78	0,00	4.779.140,02	0,00	24.147,24	0,51%	-0,66%	2,44%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	32.068.994,29	0,00	0,00	32.228.592,99	159.598,70	0,50%	0,50%	6,82%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	15.497.856,02	0,00	0,00	14.810.568,66	-687.287,36	-4,43%	-4,43%	6,19%
Total Exterior	134.779.897,01	4.779.140,02	4.779.140,02	135.520.254,08	740.357,07	0,53%		6,68%

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
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	61.521.178,60	14.808.396,69	4.300.000,00	72.885.412,98	855.837,69	1,12%	1,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	66.361.322,49	7.555,31	0,00	67.102.298,26	733.420,46	1,11%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	57.005.169,94	0,00	0,00	57.649.484,88	644.314,94	1,13%	1,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.548.186,84	2.638.196,69	0,00	26.520.379,82	333.996,29	1,28%	1,30%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	30.675.856,08	0,00	0,00	30.985.136,86	309.280,78	1,01%	1,01%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	27.800.766,54	0,00	0,00	28.079.322,90	278.556,36	1,00%	1,00%
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	8.519.352,08	0,00	0,00	8.678.635,31	159.283,23	1,87%	1,87%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	2.384.558,56	2.313.677,18	350.000,00	4.406.185,69	57.949,95	1,23%	1,37%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,02	0,00	0,00	0,01	-0,01	-50,00%	0,00%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	16.467,25	0,00	0,00	10.970,32	-5.496,93	-33,38%	-33,38%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.485.929,65	0,00	0,00	16.448.594,27	-37.335,38	-0,23%	-0,23%
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.710.742,99	0,00	0,00	6.665.894,67	-44.848,32	-0,67%	-0,67%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	2.522.049,66	0,00	0,00	2.473.915,83	-48.133,83	-1,91%	-1,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.640.997,56	0,00	0,00	20.495.955,87	-145.041,69	-0,70%	-0,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	37.035.718,54	362.644,21	0,00	37.230.033,81	-168.328,94	-0,45%	-0,46%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	15.146.350,62	0,00	0,00	14.897.371,58	-248.979,04	-1,64%	-1,64%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.038.294,64	0,00	10.000.000,00	13.664.749,13	-373.545,51	-1,55%	-1,62%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	29.595.373,38	0,00	0,00	29.147.729,34	-447.644,04	-1,51%	-1,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	28.300.548,10	0,00	0,00	27.772.214,81	-528.333,29	-1,87%	-1,87%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	21.220.839,63	0,00	0,00	20.626.804,58	-594.035,05	-2,80%	-2,80%

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
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	37.474.790,59	0,00	0,00	36.855.486,24	-619.304,35	-1,65%	-1,65%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	15.289.178,61	0,00	0,00	14.626.268,93	-662.909,68	-4,34%	-4,34%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.669.908,69	0,00	10.000.000,00	31.972.461,39	-697.447,30	-1,63%	-1,50%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	44.690.312,39	0,00	12.000.000,00	31.969.915,86	-720.396,53	-1,61%	-1,46%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	48.304.584,01	0,00	18.000.000,00	29.473.032,87	-831.551,14	-1,72%	-1,80%
TÍTULOS PÚBLICOS	214.197.012,18	50.047.167,14	0,00	256.959.275,13	-7.284.904,19	-2,76%	-
				Total Renda Fixa	-10.085.595,52	-1,12%	

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	37.271.310,64	0,00	0,00	37.692.607,79	421.297,15	1,13%	1,13%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL MULTIESTRATÉGIA FIP	3.336.991,51	3.360.768,06	0,00	6.979.939,68	282.180,11	4,21%	-4,28%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS MULTIESTRATÉGIA ...	293.173,74	0,00	0,00	481.013,31	187.839,57	64,07%	0,66%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.762.532,66	0,00	0,00	4.830.642,40	68.109,74	1,43%	1,43%
MAG FI MULTIMERCADO	5.756.907,33	0,00	0,00	5.806.047,33	49.140,00	0,85%	0,85%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.250.411,84	0,00	0,00	4.268.849,90	18.438,06	0,43%	0,43%
VINCI CAPITAL PARTNERS III MULTIESTRATÉGIA II FIP	3.408.985,71	861.996,07	0,00	4.270.722,04	-259,74	-0,01%	-2,44%
BTG PACTUAL II FIC FUNDOS DE INVEST. EM PARTICIPAÇ...	1.883.948,00	0,00	0,00	1.877.763,14	-6.184,86	-0,33%	-0,33%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.040.921,50	0,00	0,00	5.034.278,94	-6.642,56	-0,13%	-0,13%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.647.008,27	0,00	2.638.196,69	0,00	-8.811,58	-0,33%	-0,12%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	0,00	8.011.693,04	0,00	7.985.798,89	-25.894,15	-0,32%	-6,41%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO MULTIESTRATÉG...	0,00	3.509.187,24	0,00	3.468.588,40	-40.598,84	-1,16%	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.093.867,86	0,00	0,00	1.705.483,73	-388.384,13	-18,55%	-18,55%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.740.601,99	0,00	0,00	2.221.422,61	-519.179,38	-18,94%	-18,94%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MUL...	18.813.834,03	0,00	0,00	18.239.770,58	-574.063,45	-3,05%	-3,05%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.680.175,31	0,00	0,00	4.082.789,85	-597.385,46	-12,76%	-12,76%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.489.486,01	0,00	0,00	5.811.206,32	-678.279,69	-10,45%	-10,45%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	3.990.000,00	0,00	0,00	3.162.000,00	-828.000,00	-20,75%	-21,05%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.878.182,45	0,00	0,00	6.803.368,99	-1.074.813,46	-13,64%	-13,64%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	6.425.251,49	0,00	18.348,61	5.321.096,90	-1.085.805,98	-16,90%	-18,51%

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
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	14.632.032,98	0,00	0,00	13.372.050,14	-1.259.982,84	-8,61%	-8,61%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.496.120,35	0,00	0,00	9.046.068,28	-1.450.052,07	-13,82%	-13,82%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.883.010,61	0,00	0,00	10.326.856,53	-1.556.154,08	-13,10%	-13,10%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	15.689.583,03	0,00	0,00	14.019.366,81	-1.670.216,22	-10,65%	-10,65%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.284.172,55	0,00	0,00	11.406.256,76	-1.877.915,79	-14,14%	-14,14%
OCCAM FIC AÇÕES	15.356.905,91	0,00	0,00	13.370.233,78	-1.986.672,13	-12,94%	-12,94%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	34.847.162,71	0,00	0,00	30.876.154,34	-3.971.008,37	-11,40%	-11,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	32.737.328,45	0,00	0,00	28.662.215,18	-4.075.113,27	-12,45%	-12,45%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	39.750.837,41	0,00	0,00	35.467.862,80	-4.282.974,61	-10,77%	-10,77%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	38.420.416,57	0,00	0,00	32.871.743,69	-5.548.672,88	-14,44%	-14,44%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	35.161.921,27	0,00	0,00	29.592.472,52	-5.569.448,75	-15,84%	-15,84%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	54.847.547,09	0,00	0,00	47.673.798,56	-7.173.748,53	-13,08%	-13,08%
				Total Renda Variável	-45.229.258,19	-10,01%	

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
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	29.401.371,61	0,00	0,00	32.228.592,99	2.827.221,38	9,62%	9,62%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	19.676.485,28	0,00	0,00	21.660.261,60	1.983.776,32	10,08%	10,08%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	17.178.059,14	0,00	0,00	18.551.250,48	1.373.191,34	7,99%	7,99%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	30.650.938,50	0,00	0,00	31.647.512,93	996.574,43	3,25%	3,25%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	5.691.917,04	0,00	0,00	6.264.940,88	573.023,84	10,07%	10,07%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	5.047.691,64	0,00	0,00	5.543.706,78	496.015,14	9,83%	9,83%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	14.619.549,20	0,00	0,00	14.810.568,66	191.019,46	1,31%	1,31%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES INVESTIMENTO NO ...	4.634.647,52	0,00	4.779.140,02	0,00	144.492,50	3,12%	1,92%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	0,00	4.779.140,02	0,00	4.813.419,76	34.279,74	0,72%	9,58%
				Total Exterior	8.619.594,15	6,55%	

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.