

Relatório Analítico dos Investimentos

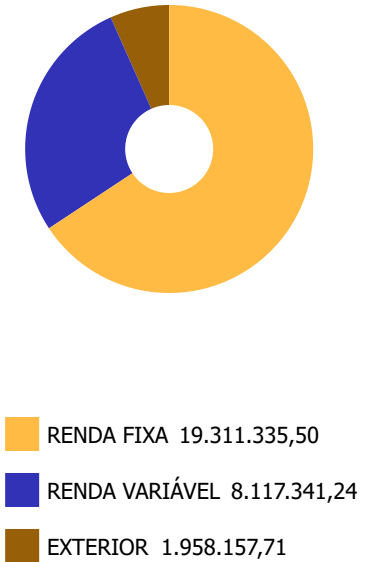
em setembro e 3º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	150.370,04	0,51%	137	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	661.136,94	2,25%	10.718	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	163.098,41	0,56%	4.416	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	298.910,22	1,02%	18	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	644.341,44	2,19%	25.438	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	252.760,99	0,86%	113.953	0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	809.558,82	2,75%	16.031	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	707.929,62	2,41%	131	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.078.821,93	3,67%	1.276	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	205.547,73	0,70%	114	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.752.609,98	5,96%	494	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		4.843,37	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			29.386.834,45				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.843,37				Artigo 6º
PL Total			29.391.677,82				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2021)

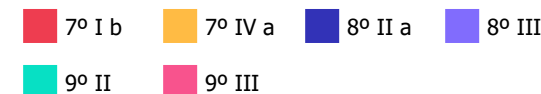
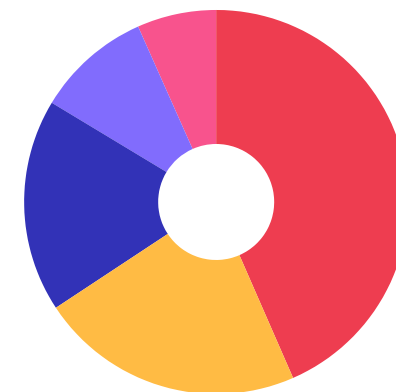
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	29.386.834,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	12.766.108,31	43,44%	0,00%	59,50%	100,00%	16.620.726,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	29.386.834,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	17.632.100,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	17.632.100,67
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	6.545.227,19	22,27%	0,00%	14,00%	40,00%	5.209.506,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	11.754.733,78
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	5.877.366,89
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	4.408.025,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.469.341,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.469.341,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.469.341,72
Total Renda Fixa	100,00%	19.311.335,50	65,71%	0,00%	73,50%	550,00%	



Enquadramento 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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	8.816.050,34
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	8.816.050,34
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.268.269,88	17,93%	0,00%	13,00%	20,00%	609.097,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	5.877.366,89
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.849.071,36	9,70%	0,00%	5,00%	10,00%	89.612,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.469.341,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.469.341,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.469.341,72
Total Renda Variável	30,00%	8.117.341,24	27,62%	0,00%	18,00%	125,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.938.683,45
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	2.938.683,45
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.958.157,71	6,66%	0,00%	6,50%	10,00%	980.525,74
Total Exterior	10,00%	1.958.157,71	6,66%	0,00%	8,50%	30,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.654.524,27	49,87	0,00
CAIXA DTVM	12.098.629,47	41,17	-
ITAÚ UNIBANCO	2.334.770,49	7,94	0,00
ITAÚ DTVM	298.910,22	1,02	0,00

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)

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 '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,73%	-5,87%	-2,65%	-1,15%	-3,14%	4,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,78%	-6,12%	-2,78%	-1,40%	-3,39%	3,69%	2,06%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,26%	-6,63%	-4,19%	-1,61%	3,20%	1,48%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,27%	-6,87%	-4,33%	-1,81%	2,97%	0,80%	3,71%	0,10%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,38%	1,59%	0,89%	1,54%	2,25%	6,68%	0,29%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,98%	2,30%	1,13%	2,53%	5,69%	13,00%	0,81%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	-2,47%	-1,66%	0,40%	4,49%	6,40%	2,18%	0,06%
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%

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 (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,35%	1,66%	0,90%	1,43%	1,88%	4,33%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,91%	4,86%	3,56%	4,36%	5,59%	14,70%	1,19%	0,02%
IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-
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%

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%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-4,61%	17,45%	1,14%	9,99%	30,80%	44,41%	6,14%	0,14%
Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%
IDIV (Benchmark)	-4,48%	-4,67%	-6,59%	-1,51%	19,58%	7,85%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,58%	-7,47%	-9,12%	-2,23%	15,77%	1,62%	11,60%	0,24%
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,52%	-2,28%	-6,51%	0,33%	29,38%	17,40%	12,52%	0,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-3,96%	0,09%	-8,42%	3,65%	23,99%	17,42%	10,28%	0,21%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	-1,47%	16,36%	-4,64%	5,18%	42,42%	52,97%	12,61%	0,16%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-7,71%	-3,23%	-14,35%	-5,38%	16,49%	8,55%	12,73%	0,21%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-10,45%	-29,00%	-23,07%	-22,29%	-16,01%	-33,42%	15,27%	0,30%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-2,67%	3,21%	-8,93%	0,84%	29,62%	29,94%	12,79%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,75%	6,80%	-10,94%	3,12%	28,12%	29,33%	14,09%	0,20%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-6,06%	-12,35%	-14,65%	-8,05%	-3,11%	-4,25%	12,64%	0,17%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,98%	-3,26%	-8,58%	-1,61%	23,96%	25,09%	11,83%	0,24%

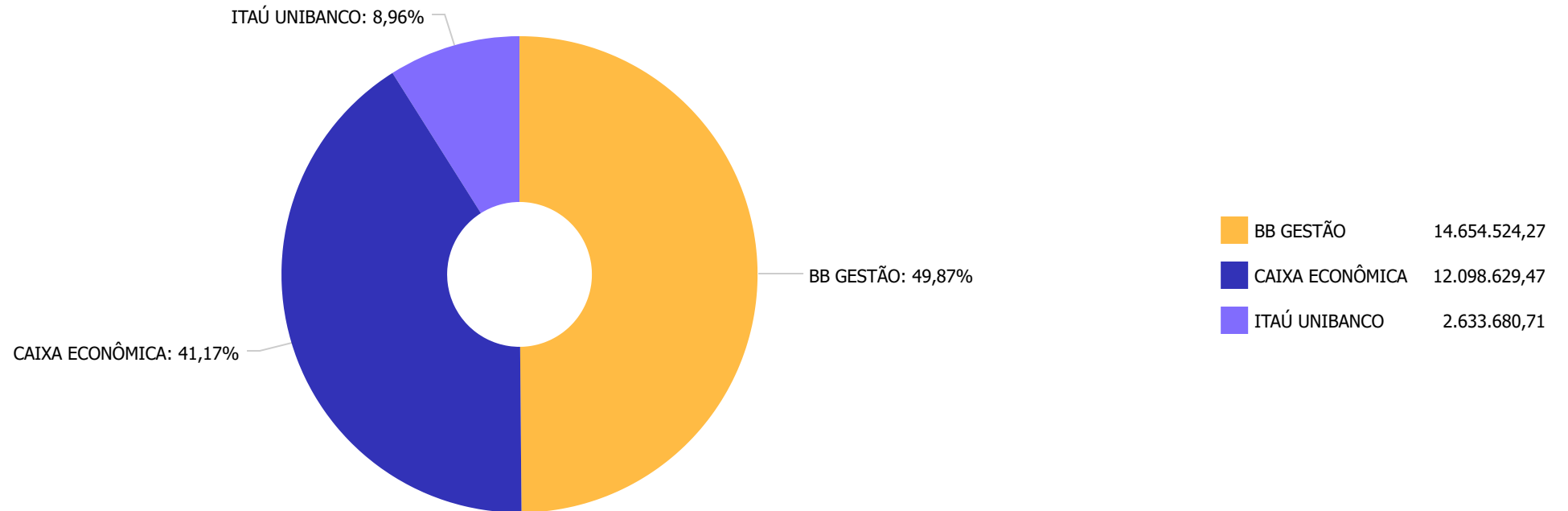
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-6,72%	-9,41%	-14,40%	-6,59%	8,07%	9,83%	11,73%	0,19%
SMLL (Benchmark)	-6,43%	-5,54%	-15,22%	-4,70%	15,75%	13,69%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-4,58%	-0,06%	-12,67%	-1,50%	21,79%	16,48%	12,90%	0,21%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,74%	0,59%	-2,45%	-0,11%	4,85%	8,05%	1,80%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,79%	1,44%	-1,87%	0,04%	5,61%	-	2,46%	0,04%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,46%	2,51%	1,22%	1,93%	3,43%	8,16%	0,04%	0,00%

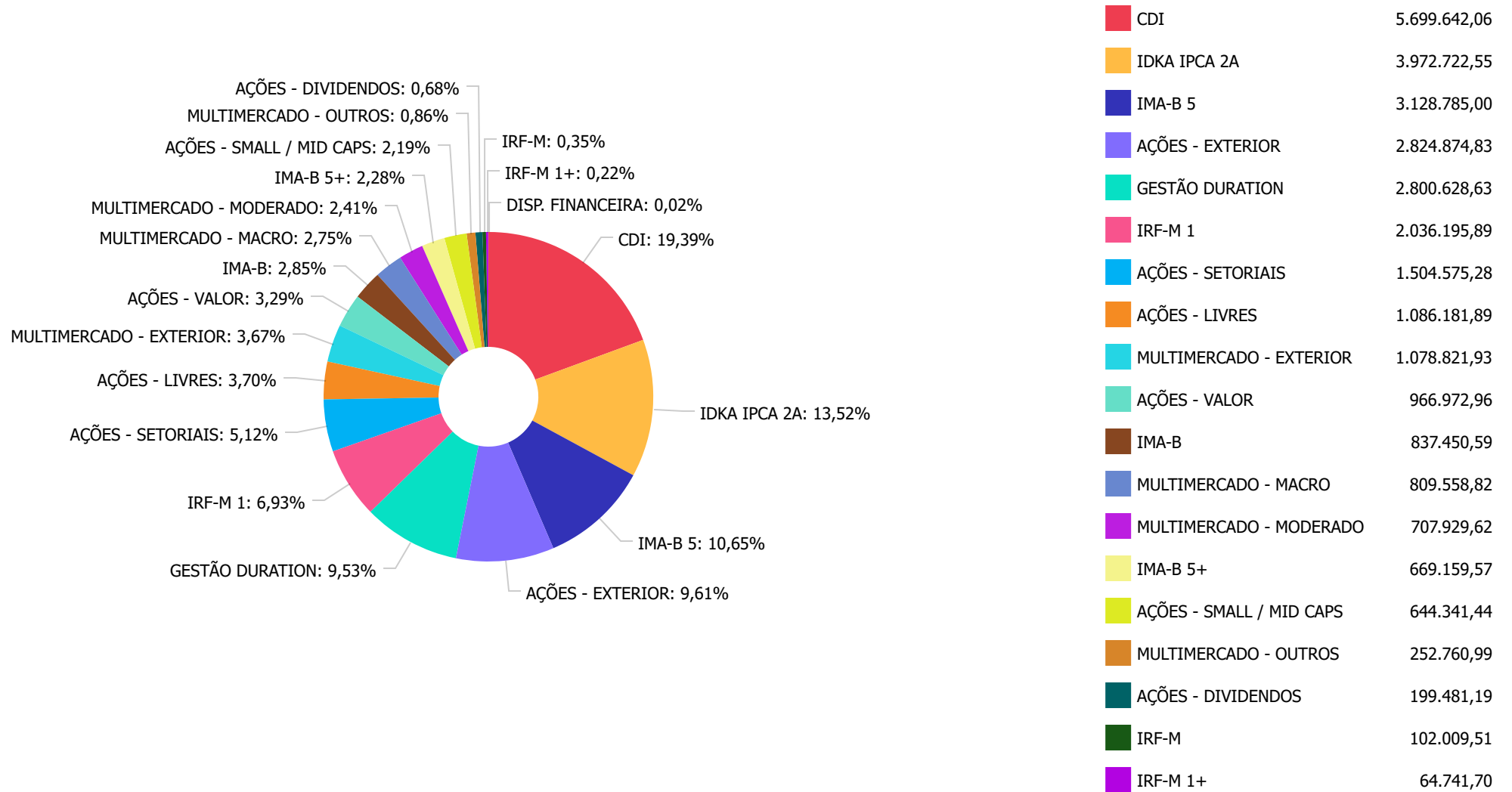
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,71%	18,67%	9,36%	4,49%	19,87%	90,75%	6,92%	0,10%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%

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



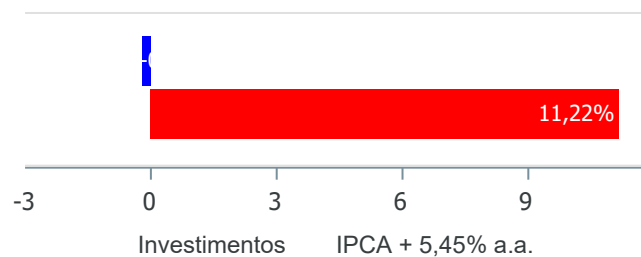
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

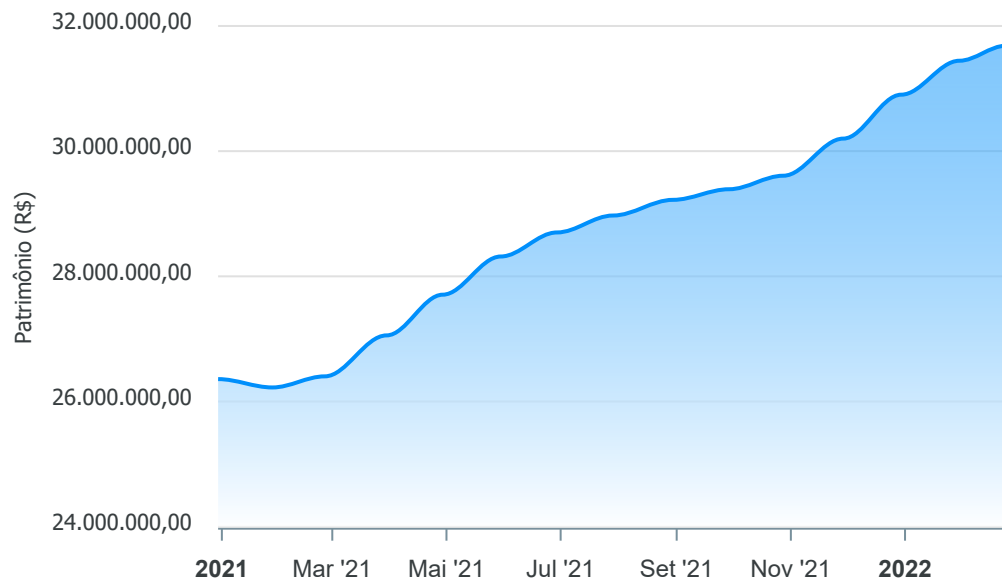
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	26.350.158,92	1.028.062,44	1.076.496,63	26.216.529,61	-85.195,12	-85.195,12	-0,32%	-0,32%	0,67%	0,67%	-48,03%	3,27%
Fevereiro	26.216.529,61	1.249.912,84	858.456,23	26.396.974,78	-211.011,44	-296.206,56	-0,79%	-1,11%	1,24%	1,92%	-57,87%	2,64%
Março	26.396.974,78	2.823.280,04	2.430.931,63	27.050.308,09	260.984,90	-35.221,66	0,97%	-0,15%	1,42%	3,37%	-4,46%	3,65%
Abril	27.050.308,09	2.223.471,40	1.831.109,46	27.700.496,46	257.826,43	222.604,77	0,94%	0,79%	0,73%	4,13%	19,07%	2,41%
Mai	27.700.496,46	3.959.431,19	3.564.486,87	28.310.677,68	215.236,90	437.841,67	0,77%	1,56%	1,28%	5,46%	28,57%	2,56%
Junho	28.310.677,68	2.809.817,61	2.408.771,85	28.695.889,39	-15.834,05	422.007,62	-0,06%	1,50%	0,98%	6,49%	23,18%	2,29%
Julho	28.695.889,39	11.045.016,73	10.653.445,65	28.966.613,69	-120.846,78	301.160,84	-0,42%	1,08%	1,43%	8,01%	13,51%	3,01%
Agosto	28.966.613,69	3.322.884,76	2.926.340,43	29.217.173,81	-145.984,21	155.176,63	-0,50%	0,58%	1,34%	9,46%	6,13%	2,96%
Setembro	29.217.173,81	3.007.672,18	2.608.221,09	29.386.834,45	-229.790,45	-74.613,82	-0,78%	-0,20%	1,61%	11,22%	-1,79%	3,31%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



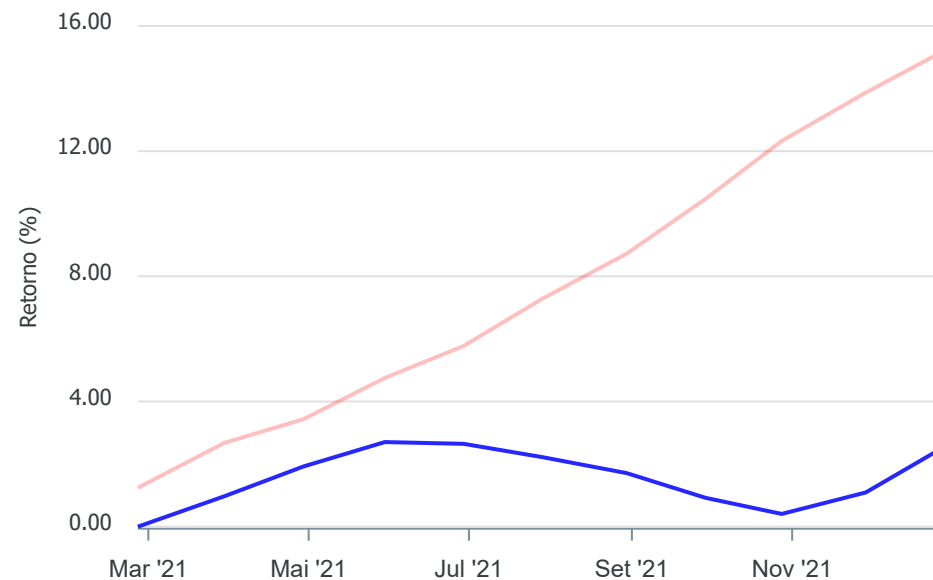
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	605.000,00	0,00	611.607,12	6.607,12	1,09%	1,91%	1,19%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.932.086,54	0,00	0,00	3.972.722,55	40.636,01	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.098.387,81	0,00	0,00	3.128.785,00	30.397,19	0,98%	0,98%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.940.293,90	450.000,00	128.538,94	4.281.003,77	19.248,81	0,44%	0,46%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.028.524,02	0,00	0,00	2.036.195,89	7.671,87	0,38%	0,38%	0,29%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.597.435,47	0,00	650.000,00	1.955.043,50	7.608,03	0,29%	0,35%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	844.679,51	0,00	0,00	845.585,13	905,62	0,11%	0,11%	0,67%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	76.288,22	1.427.154,74	696.887,45	807.031,17	475,66	0,03%	0,35%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	682.309,88	0,00	682.273,64	0,00	-36,24	-0,01%	-0,01%	0,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	838.738,51	0,00	0,00	837.450,59	-1.287,92	-0,15%	-0,15%	2,18%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	234.371,07	0,00	234.003,62	0,00	-367,45	-0,16%	-0,02%	0,91%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	102.394,34	0,00	0,00	102.009,51	-384,83	-0,38%	-0,38%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	65.250,33	0,00	0,00	64.741,70	-508,63	-0,78%	-0,78%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	677.734,09	0,00	0,00	669.159,57	-8.574,52	-1,27%	-1,27%	3,71%
Total Renda Fixa	19.118.493,69	2.482.154,74	2.391.703,65	19.311.335,50	102.390,72	0,53%		0,67%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	251.600,82	0,00	0,00	252.760,99	1.160,17	0,46%	0,46%	0,04%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	815.592,51	0,00	0,00	809.558,82	-6.033,69	-0,74%	-0,74%	1,80%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	713.544,02	0,00	0,00	707.929,62	-5.614,40	-0,79%	-0,79%	2,46%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	262.915,46	0,00	0,00	259.062,92	-3.852,54	-1,47%	-1,47%	12,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	991.987,12	0,00	0,00	966.972,96	-25.014,16	-2,52%	-2,52%	12,52%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	255.590,76	0,00	0,00	248.768,01	-6.822,75	-2,67%	-2,67%	12,79%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	156.221,66	0,00	0,00	150.370,04	-5.851,62	-3,75%	-3,75%	14,09%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	37.882,24	0,00	0,00	36.382,78	-1.499,46	-3,96%	-3,96%	10,28%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	349.259,57	0,00	0,00	335.351,99	-13.907,58	-3,98%	-3,98%	11,83%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	201.561,89	0,00	30.000,00	163.098,41	-8.463,48	-4,20%	-4,57%	11,60%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.079.506,80	50.000,00	0,00	1.078.821,93	-50.684,87	-4,49%	-4,61%	6,14%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	675.256,35	0,00	0,00	644.341,44	-30.914,91	-4,58%	-4,58%	12,90%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	824.345,15	84.000,00	0,00	866.717,12	-41.628,03	-4,58%	-4,78%	5,97%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	703.811,47	0,00	0,00	661.136,94	-42.674,53	-6,06%	-6,06%	12,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	320.426,90	0,00	0,00	298.910,22	-21.516,68	-6,72%	-6,72%	11,73%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	326.753,71	0,00	0,00	301.549,64	-25.204,07	-7,71%	-7,71%	12,73%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	374.786,63	0,00	0,00	335.607,41	-39.179,22	-10,45%	-10,45%	15,27%
Total Renda Variável	8.341.043,06	134.000,00	30.000,00	8.117.341,24	-327.701,82	-3,88%		8,75%

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 AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	205.000,00	0,00	205.547,73	547,73	0,27%	0,71%	6,92%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	186.517,44	0,00	186.517,44	0,00	0,00	0,00%	-0,61%	5,84%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.571.119,62	186.517,44	0,00	1.752.609,98	-5.027,08	-0,29%	-0,25%	6,75%
Total Exterior	1.757.637,06	391.517,44	186.517,44	1.958.157,71	-4.479,35	-0,23%		6,77%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.681.770,90	2.750.933,46	192.657,35	4.281.003,77	40.956,76	0,92%	1,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.668.531,94	2.368.954,00	100.000,00	3.972.722,55	35.236,61	0,87%	1,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.115.933,50	1.990.068,91	0,00	3.128.785,00	22.782,59	0,73%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.016.640,31	0,00	1.000.000,00	2.036.195,89	19.555,58	0,65%	0,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.357.986,54	0,00	2.368.954,00	0,00	10.967,46	0,47%	1,21%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	605.000,00	0,00	611.607,12	6.607,12	1,09%	3,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.984.977,25	0,00	1.990.068,91	0,00	5.091,66	0,26%	1,11%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	727.391,27	0,00	732.062,76	0,00	4.671,49	0,64%	-1,52%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	78.602,81	6.170.411,04	5.444.909,93	807.031,17	2.927,25	0,05%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	203.249,12	0,00	205.626,06	0,00	2.376,94	1,17%	-1,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	924.543,46	0,00	925.933,46	0,00	1.390,00	0,15%	1,30%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	5.076,65	9.920,02	10.153,30	4.843,37	0,00	0,00%	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	235.572,37	0,00	234.003,62	0,00	-1.568,75	-0,67%	-0,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	66.593,01	0,00	0,00	64.741,70	-1.851,31	-2,78%	-2,78%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	200.304,05	0,00	95.000,00	102.009,51	-3.294,54	-1,64%	-1,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	849.483,69	0,00	0,00	845.585,13	-3.898,56	-0,46%	-0,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	687.101,81	0,00	682.273,64	0,00	-4.828,17	-0,70%	-0,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	49.960,34	805.626,06	0,00	837.450,59	-18.135,81	-2,12%	-1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	99.868,25	600.000,00	0,00	669.159,57	-30.708,68	-4,39%	-4,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.087.280,07	732.062,76	1.780.000,00	1.955.043,50	-84.299,33	-2,21%	-1,87%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Fixa	3.978,31	0,02%	

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 PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	801.751,31	270.000,00	0,00	1.078.821,93	7.070,62	0,66%	1,14%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	419.538,71	50.000,00	220.000,00	252.760,99	3.222,28	0,69%	1,22%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	39.727,97	0,00	0,00	36.382,78	-3.345,19	-8,42%	-8,42%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	273.239,04	606.000,00	0,00	866.717,12	-12.521,92	-1,42%	0,67%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	237.064,26	35.000,00	0,00	259.062,92	-13.001,34	-4,78%	-4,64%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	721.389,70	0,00	0,00	707.929,62	-13.460,08	-1,87%	-1,87%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	168.840,56	0,00	0,00	150.370,04	-18.470,52	-10,94%	-10,94%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	211.630,40	0,00	30.000,00	163.098,41	-18.531,99	-8,76%	-9,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	829.896,75	0,00	0,00	809.558,82	-20.337,93	-2,45%	-2,45%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	273.166,40	0,00	0,00	248.768,01	-24.398,39	-8,93%	-8,93%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	366.805,10	0,00	0,00	335.351,99	-31.453,11	-8,57%	-8,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	349.201,64	0,00	0,00	298.910,22	-50.291,42	-14,40%	-14,40%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	352.081,99	0,00	0,00	301.549,64	-50.532,35	-14,35%	-14,35%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.034.256,95	0,00	0,00	966.972,96	-67.283,99	-6,51%	-6,51%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	737.854,39	0,00	0,00	644.341,44	-93.512,95	-12,67%	-12,67%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	436.272,01	0,00	0,00	335.607,41	-100.664,60	-23,07%	-23,07%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	774.651,58	0,00	0,00	661.136,94	-113.514,64	-14,65%	-14,65%
				Total Renda Variável	-621.027,52	-7,11%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.454.905,02	186.517,44	0,00	1.752.609,98	111.187,52	6,77%	7,72%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	177.824,92	0,00	186.517,44	0,00	8.692,52	4,89%	4,12%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	205.000,00	0,00	205.547,73	547,73	0,27%	9,36%
			Total Exterior		120.427,77	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 4.963/2021, 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 4.963 de 25 de novembro de 2021 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.