

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

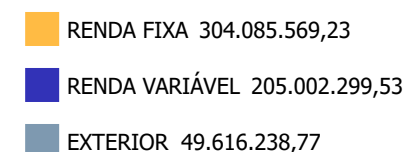
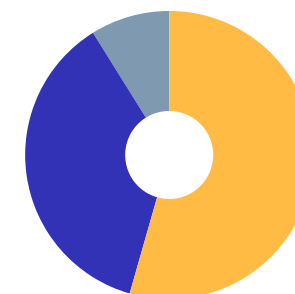
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			51.476.646,42	9,21%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	13.046.649,17	2,34%	1.014	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	14.513.724,51	2,60%	770	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	49.672.923,77	8,89%	1.057	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	64.274.219,92	11,50%	1.013	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.557.337,91	2,78%	300	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	36.924.937,57	6,61%	863	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	234,58	0,00%	1.264	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	20.073.016,48	3,59%	9.687	1,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.723.035,17	2,46%	113	1,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.041.966,56	0,19%	790	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.168.716,84	3,43%	106	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	733.810,55	0,13%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.098.706,28	0,55%	33	2,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	0,01	0,00%	13	100,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	779.643,49	0,14%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	22.929.065,76	4,10%	2.466	2,05%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	21.748.488,53	3,89%	27.215	1,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.693.212,03	0,48%	137	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	21.955.431,88	3,93%	36.305	0,56%	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
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	19.559.820,47	3,50%	53	2,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	13.739.149,32	2,46%	111	1,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	13.808.755,01	2,47%	2.512	0,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	18.741.356,06	3,35%	4.541	5,44%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	13.811.039,13	2,47%	7.251	2,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	15.254.572,34	2,73%	19.023	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	16.100.627,45	2,88%	1.276	0,68%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	15.146.139,77	2,71%	58.919	0,64%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	758.118,35	0,14%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	764.420,72	0,14%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.759.117,27	0,85%	28	3,47%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.343.902,22	0,42%		1,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	8.434.151,43	1,51%	8.695	1,31%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	13.687.412,41	2,45%	15.859	0,87%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	15.795.997,00	2,83%	13.296	0,78%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	11.698.677,93	2,09%	494	0,35%	Artigo 9º - A, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	889.083,22	0,16%		0,46%	Desenquadrado - RV
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1.944.469,50	0,35%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			558.704.107,53				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.944.469,50	Artigo 6º			
PL Total			560.648.577,03				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	51.476.646,42	9,21%	0,00%	0,50%	50,00%	227.875.407,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	214.063.043,91	38,31%	15,00%	43,50%	90,00%	288.770.652,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.935.205,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	50,00%	34.667.529,12	6,20%	2,00%	8,00%	40,00%	188.814.113,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	10,00%	3.878.349,78	0,69%	0,00%	2,00%	5,00%	24.056.855,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.935.205,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.935.205,38
Total Renda Fixa	100,00%	304.085.569,23	54,43%	17,00%	54,00%	200,00%	

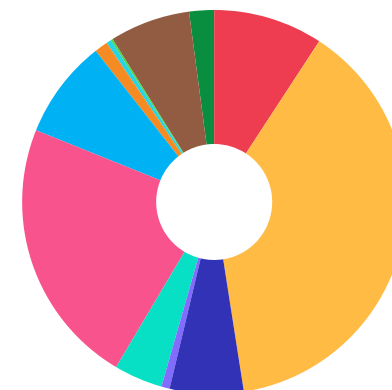


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

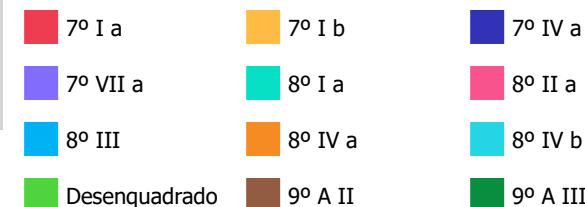


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	40,00%	22.929.065,76	4,10%	0,00%	5,00%	10,00%	32.941.344,99
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.935.205,38
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	126.057.252,43	22,56%	7,00%	25,00%	30,00%	41.553.979,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	55.870.410,75
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	46.501.339,56	8,32%	0,00%	3,00%	10,00%	9.369.071,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.281.656,34	1,12%	0,00%	2,00%	5,00%	21.653.549,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	2.343.902,22	0,42%	0,00%	1,00%	5,00%	25.591.303,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.935.205,38
Desenquadrado - RV	0,00%	889.083,22	0,16%	0,00%	0,00%	0,00%	-889.083,22
Total Renda Variável	40,00%	205.002.299,53	36,69%	7,00%	36,00%	80,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	37.917.560,84	6,79%	0,00%	8,00%	10,00%	17.952.849,91
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	11.698.677,93	2,09%	0,00%	2,00%	5,00%	16.236.527,45
Total Exterior	10,00%	49.616.238,77	8,88%	0,00%	10,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	197.118.082,61	35,28	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	72.237.927,97	12,93	0,00
ITAÚ UNIBANCO	70.963.925,49	12,70	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	51.476.646,42	9,21	-
WESTERN ASSET	35.219.156,25	6,30	0,07
XP ASSET MANAGEMENT	22.121.563,84	3,96	0,46
ITAÚ DTVM	19.559.820,47	3,50	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	18.741.356,06	3,35	1,34
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	15.795.997,00	2,83	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	13.811.039,13	2,47	0,05
NAVI CAPITAL	13.808.755,01	2,47	0,82
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.723.035,17	2,46	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.956.062,54	1,25	3,91
KPTL	4.759.117,27	0,85	1,24
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.522.539,07	0,27	0,16
CADENCE GESTORA	889.083,22	0,16	-
PLURAL	0,01	0,00	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	51.476.646,42	9,21	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	214.063.043,91	38,31	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	34.667.529,12	6,20	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	3.878.349,78	0,69	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 '	22.929.065,76	4,10	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	126.057.252,43	22,56	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	46.501.339,56	8,32	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.281.656,34	1,12	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.343.902,22	0,42	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	37.917.560,84	6,79	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	11.698.677,93	2,09	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	2,79%	1,21%	2,82%	5,92%	13,71%	0,78%	0,02%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,73%	12,43%	4,83%	8,38%	17,93%	30,14%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,48%	-1,60%	0,51%	1,01%	-0,54%	-7,02%	0,62%	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-2,38%	-3,97%	-3,65%	-4,05%	-3,89%	-25,56%	-	0,06%

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%

120% do CDI (Benchmark)	0,53%	3,02%	1,47%	2,42%	3,60%	8,04%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-

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%
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%
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%

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-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,20%	-3,14%	-1,80%	0,31%	3,79%	5,90%	2,08%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	-2,51%	-1,69%	0,37%	4,45%	6,20%	2,16%	0,06%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,26%	-1,84%	-0,98%	1,61%	5,15%	8,50%	2,39%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	2,65%	1,48%	2,31%	3,31%	6,30%	0,13%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,36%	-1,87%	-1,72%	-0,97%	-0,55%	-3,27%	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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,01%	15,17%	5,71%	10,15%	21,77%	38,78%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,10%	2,21%	-0,37%	-2,01%	1,88%	-	-	0,04%

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 + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,89%	14,00%	5,34%	9,40%	20,13%	35,04%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,08%	-0,77%	-0,24%	-0,48%	-1,16%	-	0,00%	0,00%

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%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-7,31%	-9,02%	-13,82%	-4,95%	6,68%	-9,83%	13,50%	0,21%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-5,45%	-3,29%	-12,34%	-4,26%	17,01%	2,20%	12,56%	0,21%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,98%	-3,26%	-8,58%	-1,61%	23,96%	25,09%	11,83%	0,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,10%	-3,73%	-12,45%	0,03%	13,48%	-13,14%	12,57%	0,22%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,54%	0,64%	-9,43%	2,92%	23,25%	17,30%	12,02%	0,22%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,52%	-0,57%	-11,40%	-1,65%	19,26%	6,71%	10,48%	0,18%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-1,11%	-0,28%	-0,68%	-3,41%	-	0,00%	0,00%

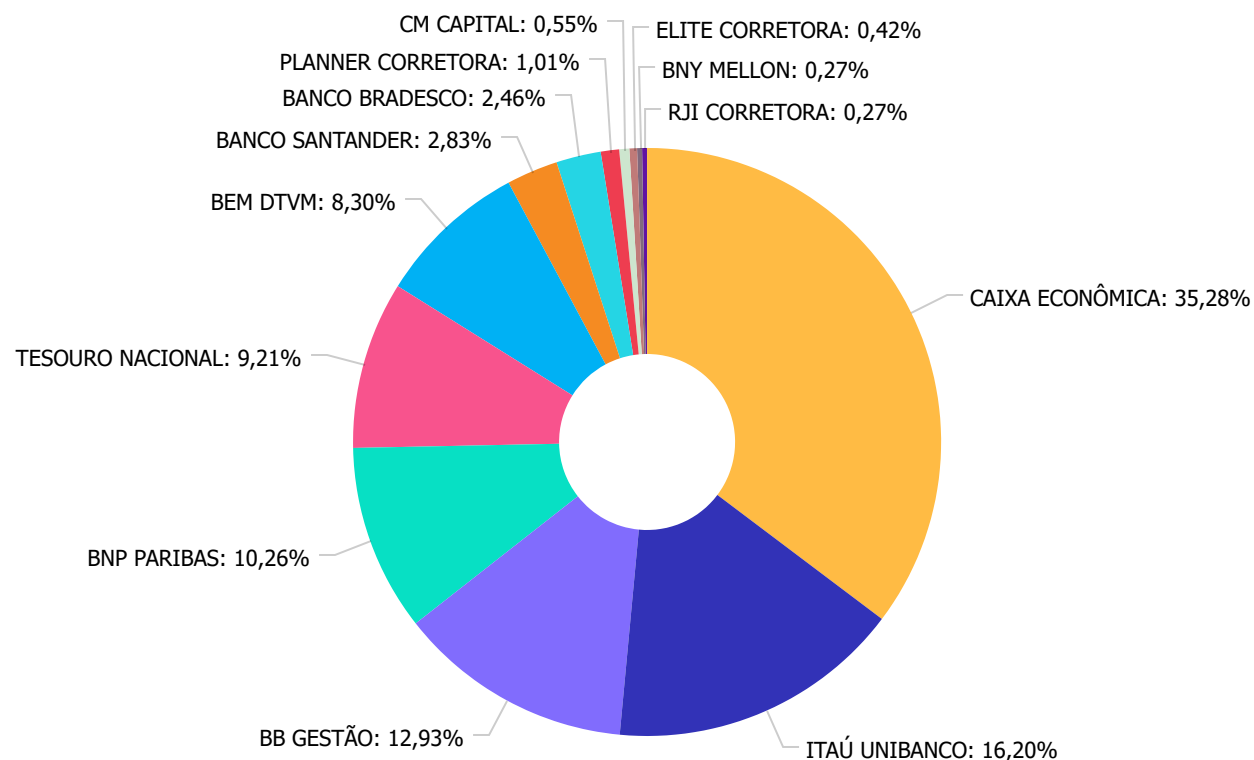
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	3,55%	0,21%	-0,19%	3,13%	204.930.044,17%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,10%	-0,97%	-0,31%	-0,61%	-1,43%	-	-	0,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,64%	17,47%	1,14%	9,99%	30,72%	42,05%	6,15%	0,13%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,75%	6,80%	-10,94%	3,12%	28,12%	29,33%	14,09%	0,20%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-6,75%	-5,50%	-13,47%	-4,90%	17,56%	7,93%	12,21%	0,22%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,61%	17,45%	1,14%	9,99%	30,80%	44,41%	6,14%	0,14%

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

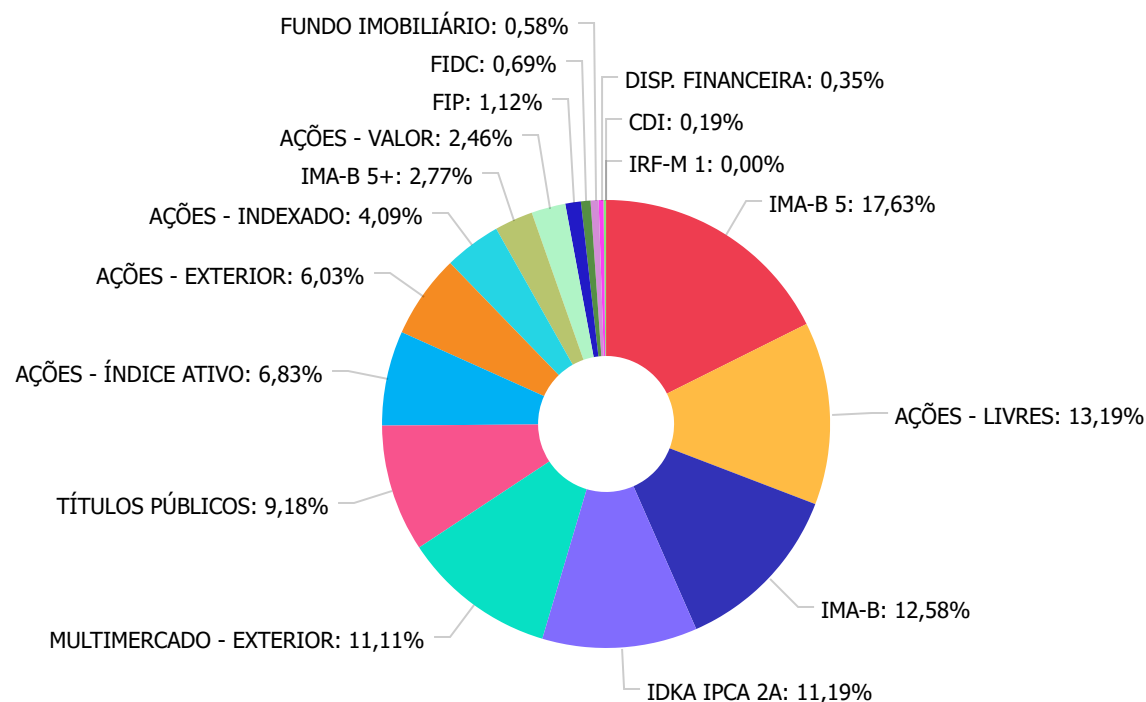
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	1,22%	16,99%	8,36%	2,09%	22,47%	80,14%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,33%	15,97%	7,99%	2,32%	20,85%	95,63%	6,11%	0,10%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	0,61%	5,53%	3,25%	-0,98%	8,39%	-	7,76%	0,10%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-5,03%	11,28%	-0,78%	11,47%	25,20%	-	7,46%	0,15%

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



CAIXA ECONÔMICA	197.118.082,61
ITAÚ UNIBANCO	90.523.745,96
BB GESTÃO	72.237.927,97
BNP PARIBAS	57.340.720,09
TESOURO NACIONAL	51.476.646,42
BEM DTVM	46.361.150,20
BANCO SANTANDER	15.795.997,00
BANCO BRADESCO	13.723.035,17
PLANNER CORRETORA	5.648.200,49
CM CAPITAL	3.098.706,28
ELITE CORRETORA	2.343.902,22
BNY MELLON	1.522.539,07
RJI CORRETORA	1.513.454,05

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



IMA-B 5	98.860.960,91
AÇÕES - LIVRES	73.945.036,77
IMA-B	70.550.500,13
IDKA IPCA 2A	62.719.572,94
MULTIMERCADO - EXTERIOR	62.297.336,56
TÍTULOS PÚBLICOS	51.476.646,42
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	38.301.176,53
AÇÕES - EXTERIOR	33.820.241,77
AÇÕES - INDEXADO	22.929.065,76
IMA-B 5+	15.557.337,91
AÇÕES - VALOR	13.811.039,13
FIP	6.281.656,34
FIDC	3.878.349,78
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.232.985,44
DISP. FINANCEIRA	1.944.469,50
CDI	1.041.966,56
IRF-M 1	234,58

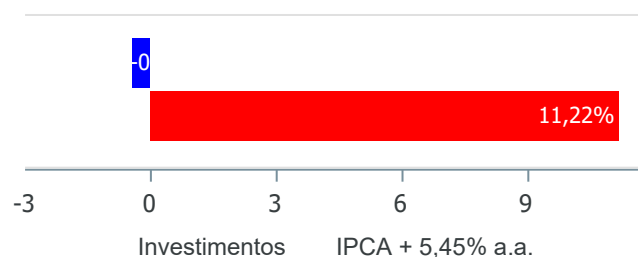
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2021)

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	31/07/2019	414	4.824,512202	5.447,641071	1.997.348,05	2.255.323,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.667,693470	34.966,87	39.673,85	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	03/08/2021	1.293	4563,054091	4.286,890304	5.900.028,94	5.542.949,16	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	13/09/2021	9.500	4428,231791	4.286,890304	42.068.202,01	40.725.457,89	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	14/09/2021	145	4428,231791	4.286,890304	642.093,61	621.599,09	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

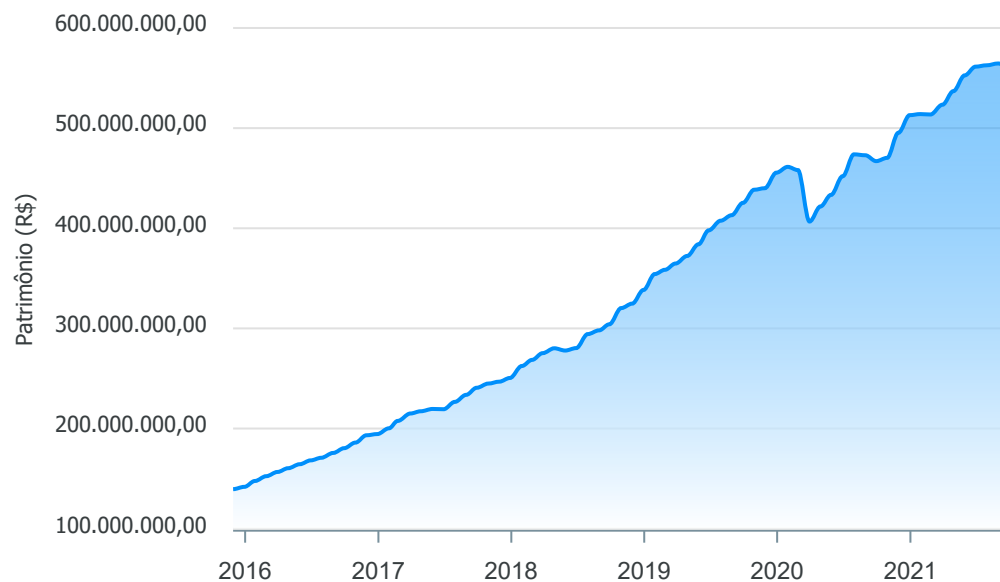
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	512.952.614,29	4.945.695,25	0,00	513.893.154,64	-4.005.154,90	-4.005.154,90	-0,77%	-0,77%	0,67%	0,67%	-114,89%	4,38%
Fevereiro	513.893.154,64	6.448.247,79	1.003.800,52	513.031.226,96	-6.306.374,95	-10.311.529,85	-1,21%	-1,98%	1,24%	1,92%	-102,79%	4,20%
Março	513.031.226,96	116.168.816,36	112.295.101,39	523.370.005,29	6.465.063,36	-3.846.466,49	1,25%	-0,75%	1,42%	3,37%	-22,31%	4,86%
Abril	523.370.005,29	66.412.997,51	60.037.378,76	536.928.524,22	7.182.900,18	3.336.433,69	1,36%	0,59%	0,73%	4,13%	14,37%	3,62%
Maio	536.928.524,22	7.921.199,17	2.562.230,39	552.663.619,47	10.376.126,47	13.712.560,16	1,91%	2,52%	1,28%	5,46%	46,12%	4,22%
Junho	552.663.619,47	1.059.601,75	482.323,30	554.943.073,91	1.702.175,99	15.414.736,15	0,31%	2,83%	0,98%	6,49%	43,67%	3,31%
Julho	554.943.073,91	12.844.816,18	987.327,50	562.576.164,83	-4.224.397,76	11.190.338,39	-0,75%	2,07%	1,43%	8,01%	25,81%	4,27%
Agosto	562.576.164,83	12.180.164,49	6.448.943,08	564.403.650,41	-3.903.735,83	7.286.602,56	-0,69%	1,37%	1,34%	9,46%	14,45%	4,40%
Setembro	564.403.650,41	89.391.887,53	85.013.586,47	558.704.107,53	-10.077.843,94	-2.791.241,38	-1,77%	-0,43%	1,61%	11,22%	-3,83%	5,57%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

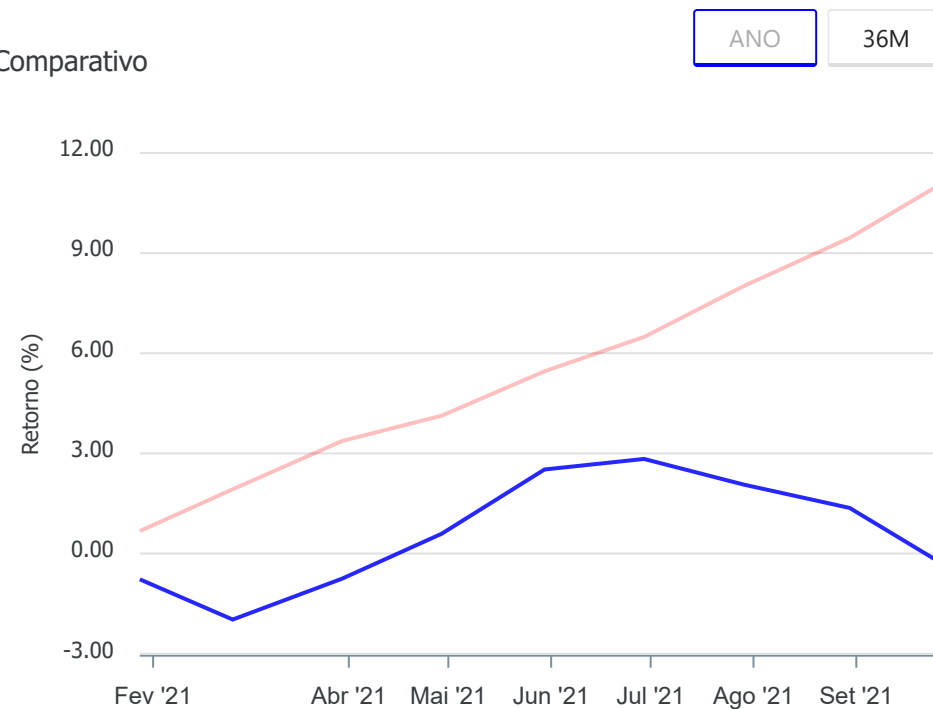


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	49.143.007,85	0,00	0,00	49.672.923,77	529.915,92	1,08%	1,08%	0,78%
TÍTULOS PÚBLICOS	8.227.274,72	42.710.680,27	0,00	51.476.646,42	538.691,43	1,06%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.913.198,18	0,00	0,00	13.046.649,17	133.450,99	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	63.649.774,23	0,00	0,00	64.274.219,92	624.445,69	0,98%	0,98%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.373.214,10	0,00	0,00	14.513.724,51	140.510,41	0,98%	0,98%	0,82%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.938.657,19	0,00	0,00	20.073.016,48	134.359,29	0,67%	0,67%	1,06%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	775.892,68	0,00	0,00	779.643,49	3.750,81	0,48%	0,48%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	233,70	0,00	0,00	234,58	0,88	0,38%	0,38%	0,29%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.118.676,76	0,00	0,00	19.168.716,84	50.040,08	0,26%	0,26%	2,39%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	908.932,76	42.439.176,86	42.320.818,07	1.041.966,56	14.675,01	0,03%	0,53%	0,13%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	42.706.440,66	0,00	42.692.768,40	0,00	-13.672,26	-0,03%	0,35%	0,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	36.982.547,49	0,00	0,00	36.924.937,57	-57.609,92	-0,16%	-0,16%	2,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.750.951,44	0,00	0,00	13.723.035,17	-27.916,27	-0,20%	-0,20%	2,08%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	736.473,33	0,00	0,00	733.810,55	-2.662,78	-0,36%	-0,36%	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.756.687,28	0,00	0,00	15.557.337,91	-199.349,37	-1,27%	-1,27%	3,71%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.174.394,10	0,00	0,00	3.098.706,28	-75.687,82	-2,38%	-	-
Total Renda Fixa	302.156.356,48	85.149.857,13	85.013.586,47	304.085.569,23	1.792.942,09	0,59%		1,39%

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
OSASCO PROPERTIES FII	889.083,22	0,00	0,00	889.083,22	0,00	0,00%	0,00%	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	765.015,57	0,00	0,00	764.420,72	-594,85	-0,08%	-0,08%	0,00%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.763.733,39	0,00	0,00	4.759.117,27	-4.616,12	-0,10%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	758.864,66	0,00	0,00	758.118,35	-746,31	-0,10%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.346.931,15	0,00	0,00	2.343.902,22	-3.028,93	-0,13%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.798.017,83	0,00	0,00	2.693.212,03	-104.805,80	-3,75%	-3,75%	14,09%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	22.650.432,93	0,00	0,00	21.748.488,53	-901.944,40	-3,98%	-3,98%	11,83%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.538.713,26	2.242.030,40	0,00	15.146.139,77	-634.603,89	-4,02%	-4,60%	6,16%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.899.262,60	2.000.000,00	0,00	15.254.572,34	-644.690,26	-4,05%	-4,64%	6,15%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.466.133,52	0,00	0,00	13.808.755,01	-657.378,51	-4,54%	-4,54%	12,02%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	16.878.265,98	0,00	0,00	16.100.627,45	-777.638,53	-4,61%	-4,61%	6,14%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	19.821.405,03	0,00	0,00	18.741.356,06	-1.080.048,97	-5,45%	-5,45%	12,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	23.487.216,42	0,00	0,00	21.955.431,88	-1.531.784,54	-6,52%	-6,52%	10,48%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	20.942.789,96	0,00	0,00	19.559.820,47	-1.382.969,49	-6,60%	-6,60%	11,68%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	24.589.194,00	0,00	0,00	22.929.065,76	-1.660.128,24	-6,75%	-6,75%	12,21%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	14.900.315,70	0,00	0,00	13.811.039,13	-1.089.276,57	-7,31%	-7,31%	13,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14.949.471,63	0,00	0,00	13.739.149,32	-1.210.322,31	-8,10%	-8,10%	12,57%
Total Renda Variável	212.444.846,85	4.242.030,40	0,00	205.002.299,53	-11.684.577,72	-5,39%		10,47%

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.588.618,85	0,00	0,00	15.795.997,00	207.378,15	1,33%	1,33%	6,11%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	13.604.625,63	0,00	0,00	13.687.412,41	82.786,78	0,61%	0,61%	7,76%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.728.009,18	0,00	0,00	11.698.677,93	-29.331,25	-0,25%	-0,25%	6,75%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	8.881.193,42	0,00	0,00	8.434.151,43	-447.041,99	-5,03%	-5,03%	7,46%
Total Exterior	49.802.447,08	0,00	0,00	49.616.238,77	-186.208,31	-0,37%		6,95%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	63.221.143,65	336.401,70	1.288,74	64.274.219,92	717.963,31	1,13%	1,13%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.213.675,36	48.610.709,21	0,00	51.476.646,42	652.261,85	1,28%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	49.265.394,51	0,00	185.955,35	49.672.923,77	593.484,61	1,20%	1,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.879.444,21	0,00	0,00	13.046.649,17	167.204,96	1,30%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.355.097,76	0,00	0,00	14.513.724,51	158.626,75	1,11%	1,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.294.193,06	49.288.247,58	49.569.844,56	1.041.966,56	29.370,48	0,06%	1,48%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	775.669,72	0,00	0,00	779.643,49	3.973,77	0,51%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	232,51	0,00	0,00	234,58	2,07	0,89%	0,89%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	746.711,96	0,00	0,00	733.810,55	-12.901,41	-1,73%	-1,72%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	20.118.578,66	0,00	0,00	20.073.016,48	-45.562,18	-0,23%	-0,23%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.215.980,31	0,00	0,00	3.098.706,28	-117.274,03	-3,65%	-3,65%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.359.061,29	0,00	0,00	19.168.716,84	-190.344,45	-0,98%	-0,98%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.974.392,62	0,00	0,00	13.723.035,17	-251.357,45	-1,80%	-1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	37.557.642,01	0,00	0,00	36.924.937,57	-632.704,44	-1,68%	-1,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.261.355,22	0,00	0,00	15.557.337,91	-704.017,31	-4,33%	-4,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	43.673.351,71	0,00	42.692.768,40	0,00	-980.583,31	-2,25%	-1,87%
				Total Renda Fixa	-611.856,78	-0,20%	

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	15.919.831,45	0,00	0,00	16.100.627,45	180.796,00	1,14%	1,14%
OSASCO PROPERTIES FII	889.083,22	0,00	0,00	889.083,22	0,00	0,00%	0,21%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	766.294,10	0,00	0,00	764.420,72	-1.873,38	-0,24%	-0,24%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	760.482,26	0,00	0,00	758.118,35	-2.363,91	-0,31%	-0,31%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.353.450,12	0,00	0,00	2.343.902,22	-9.547,90	-0,41%	-0,28%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.277.617,02	4.885.576,56	0,00	15.146.139,77	-17.053,81	-0,11%	1,13%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.776.620,73	0,00	0,00	4.759.117,27	-17.503,46	-0,37%	-0,37%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	10.277.535,33	5.000.000,00	0,00	15.254.572,34	-22.962,99	-0,15%	1,14%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	2.693.212,03	-306.787,97	-10,23%	-10,94%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	15.246.425,46	0,00	0,00	13.808.755,01	-1.437.670,45	-9,43%	-9,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	15.692.542,99	0,00	0,00	13.739.149,32	-1.953.393,67	-12,45%	-12,45%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	23.788.308,26	0,00	0,00	21.748.488,53	-2.039.819,73	-8,57%	-8,57%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	16.024.950,77	0,00	0,00	13.811.039,13	-2.213.911,64	-13,82%	-13,82%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	21.380.058,99	0,00	0,00	18.741.356,06	-2.638.702,93	-12,34%	-12,34%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	24.779.138,58	0,00	0,00	21.955.431,88	-2.823.706,70	-11,40%	-11,40%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	22.649.930,39	0,00	0,00	19.559.820,47	-3.090.109,92	-13,64%	-13,64%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	26.498.079,94	0,00	0,00	22.929.065,76	-3.569.014,18	-13,47%	-13,47%
				Total Renda Variável	-19.963.626,64	-8,87%	

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	14.626.753,64	0,00	0,00	15.795.997,00	1.169.243,36	7,99%	7,99%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10.860.496,53	0,00	0,00	11.698.677,93	838.181,40	7,72%	7,72%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	13.256.398,28	0,00	0,00	13.687.412,41	431.014,13	3,25%	3,25%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	5.207.151,28	3.295.933,15	0,00	8.434.151,43	-68.933,00	-0,81%	-0,77%
			Total Exterior		2.369.505,89	5,02%	

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.