

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

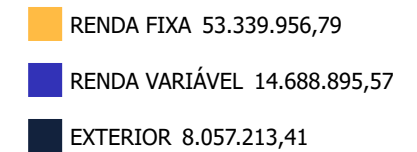
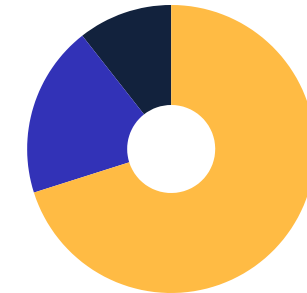
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	248.024,18	0,33%	770	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	733.927,93	0,96%	650	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	9.959.730,03	13,09%	1.140	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	1.742.545,80	2,29%	140	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.031.936,99	1,36%	964	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	560.667,87	0,74%	1.057	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.092.145,59	1,44%	1.013	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	979.394,58	1,29%	863	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.600.110,03	9,99%	1.264	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.092.474,22	1,44%	587	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	9.646.489,91	12,68%	768	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	525.860,60	0,69%	173	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	18.126.649,06	23,82%	790	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	715.637,28	0,94%	2.466	0,06%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.428.759,39	1,88%	59	1,33%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	866.308,31	1,14%	906	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	401.548,97	0,53%	16.687	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.057.623,54	1,39%	8.138	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	548.070,98	0,72%	56.614	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	518.224,69	0,68%	10.879	0,19%	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
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	618.026,95	0,81%	6.097	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.652.975,13	3,49%	135	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	5.277.738,24	6,94%	113.953	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	603.982,09	0,79%	3.847	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	1.388.488,66	1,82%	1.295	0,68%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.802.822,93	3,68%	24.127	0,24%	Artigo 9º - A, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.865.901,82	5,08%	494	0,12%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>76.086.065,77</b>				

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

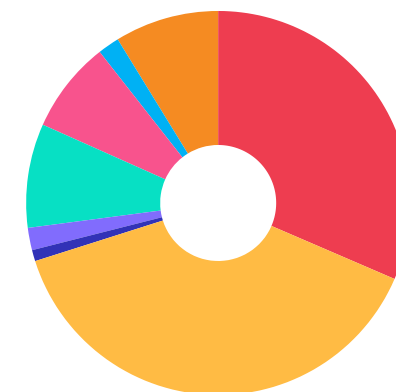
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	7.608.606,58
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	23.948.483,00	31,48%	11,52%	48,00%	67,00%	27.029.181,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	29.391.473,79	38,63%	4,07%	17,06%	40,00%	1.042.952,52
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>53.339.956,79</b>	<b>70,10%</b>	<b>15,59%</b>	<b>70,06%</b>	<b>117,00%</b>	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	715.637,28	0,94%	0,50%	1,50%	5,00%	3.088.666,01
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	1.428.759,39	1,88%	1,50%	3,00%	4,00%	1.614.683,24
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	6.662.778,57	8,76%	3,65%	18,24%	20,00%	8.554.434,58
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.881.720,33	7,73%	3,00%	6,50%	10,00%	1.726.886,25
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>14.688.895,57</b>	<b>19,31%</b>	<b>8,65%</b>	<b>29,24%</b>	<b>39,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	1.388.488,66	1,82%	0,00%	0,00%	3,00%	894.093,31
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	6.668.724,75	8,76%	0,00%	0,70%	10,00%	939.881,83
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>8.057.213,41</b>	<b>10,59%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,70%</b>	<b>13,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	38.340.148,32	50,39	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.092.942,32	46,12	0,00
VINCI PARTNERS	2.652.975,13	3,49	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 ' b '	23.948.483,00	31,48	11,52	72,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	29.391.473,79	38,63	4,07	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	6.662.778,57	8,76	18,24	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.881.720,33	7,73	3,09	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	1.388.488,66	1,82	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	6.668.724,75	8,76	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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	1,53%	0,87%	1,48%	2,16%	6,42%	0,30%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	-2,51%	-1,69%	0,37%	4,45%	6,20%	2,16%	0,06%
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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	2,28%	1,19%	1,90%	2,87%	6,32%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,53%	2,65%	1,48%	2,31%	3,31%	6,30%	0,13%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	2,64%	1,31%	2,13%	3,23%	6,30%	0,03%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA (Benchmark)</b>	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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	3,51%	1,92%	3,52%	6,84%	13,46%	0,57%	0,02%
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
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-7,98%	-9,65%	-14,44%	-7,16%	9,34%	9,32%	11,95%	0,22%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-1,88%	-4,23%	-6,58%	-0,76%	15,82%	9,79%	11,04%	0,20%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-6,48%	-6,78%	-12,33%	-4,85%	16,73%	5,37%	12,37%	0,23%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-7,71%	-3,23%	-14,35%	-5,38%	16,49%	8,55%	12,73%	0,21%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,51%	2,24%	1,24%	1,86%	2,70%	6,74%	0,23%	0,00%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,46%	2,51%	1,22%	1,93%	3,43%	8,16%	0,04%	0,00%

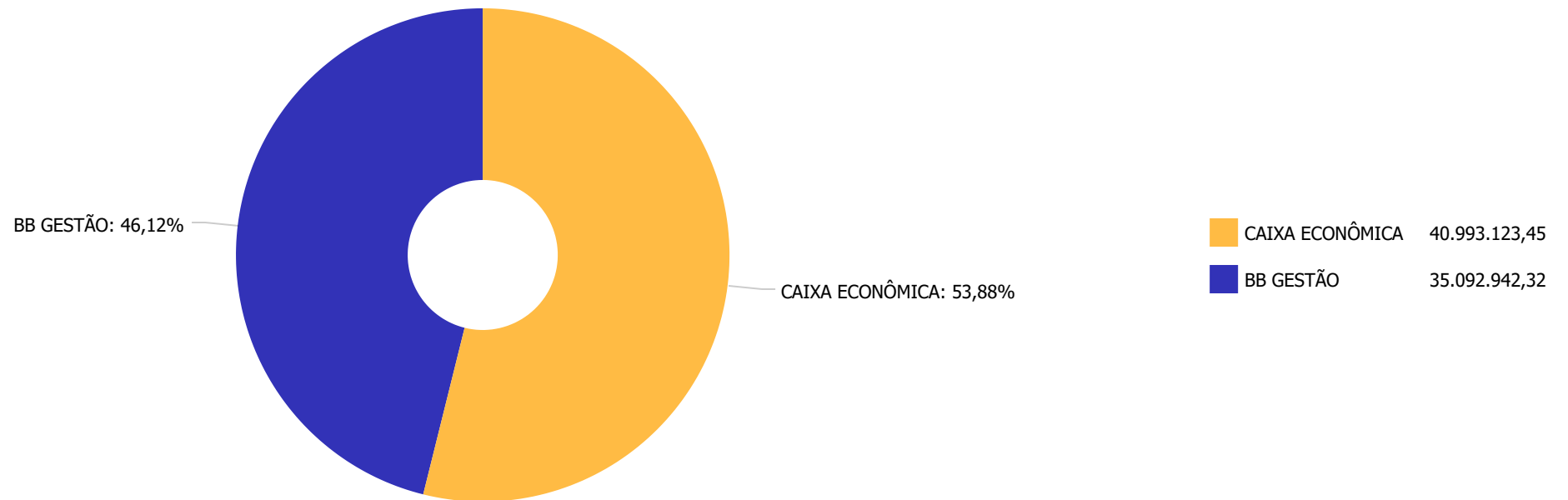
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	-10,69%	-29,08%	-23,22%	-22,47%	-16,16%	-33,94%	15,26%	0,30%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-7,05%	-8,20%	-14,12%	-5,86%	14,97%	0,89%	12,29%	0,23%

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-10,45%	-29,00%	-23,07%	-22,29%	-16,01%	-33,42%	15,27%	0,30%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-6,75%	-5,50%	-13,47%	-4,90%	17,56%	7,93%	12,21%	0,22%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-2,67%	3,21%	-8,93%	0,84%	29,62%	29,94%	12,79%	0,20%

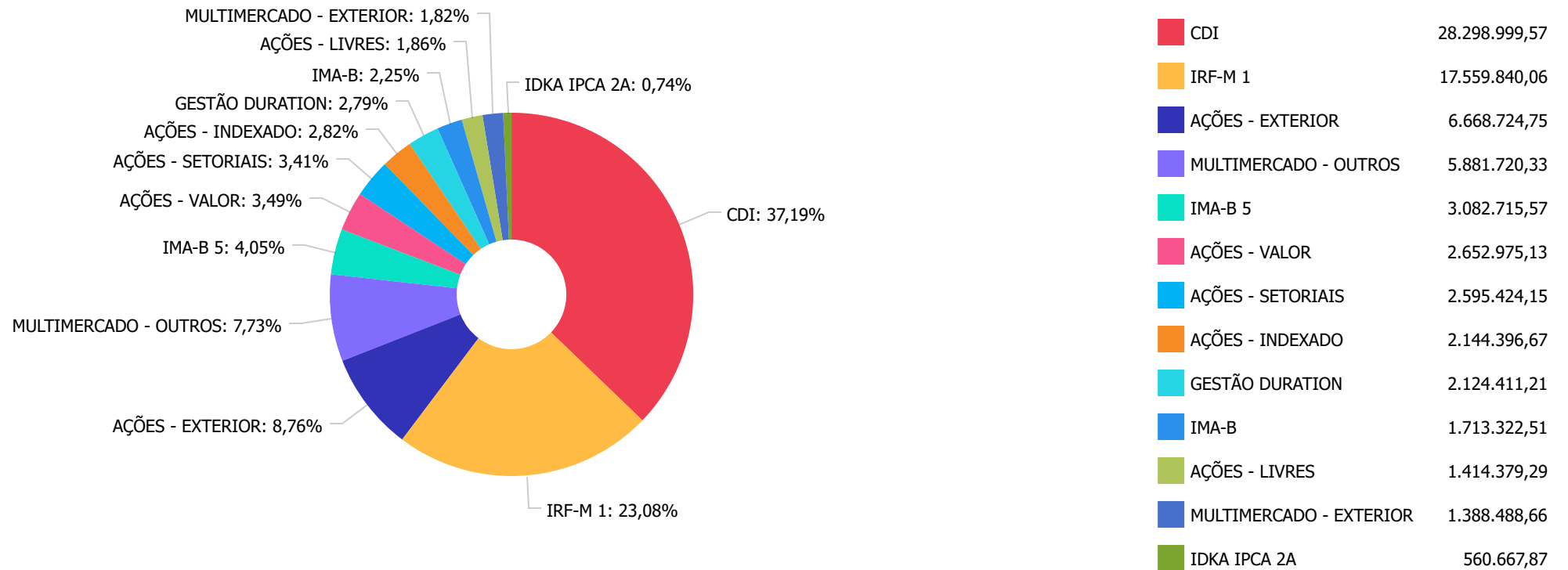
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-0,17%	19,02%	8,14%	4,70%	21,04%	94,03%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,62%	17,77%	9,07%	3,96%	18,60%	85,75%	6,92%	0,10%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,25%	16,72%	7,72%	3,03%	18,26%	90,64%	6,75%	0,10%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-0,74%	7,27%	4,12%	0,96%	-	-	5,84%	-

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



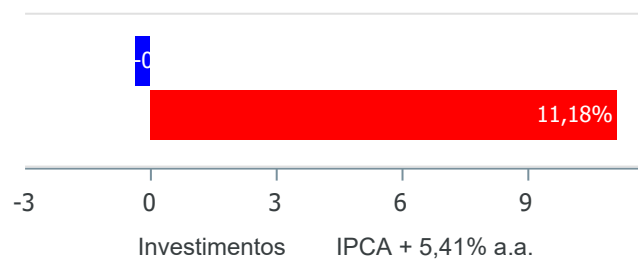
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)



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	76.519.327,28	11.382.611,57	11.119.958,49	76.152.512,06	-629.468,30	-629.468,30	-0,82%	-0,82%	0,67%	0,67%	-122,35%	4,37%
Fevereiro	76.152.512,06	9.483.114,76	9.383.001,27	75.627.350,15	-625.275,40	-1.254.743,70	-0,82%	-1,63%	1,24%	1,92%	-85,12%	3,43%
Março	75.627.350,15	5.203.418,02	5.148.850,50	76.886.019,04	1.204.101,37	-50.642,33	1,59%	-0,07%	1,42%	3,36%	-2,02%	3,72%
Abril	76.886.019,04	2.830.000,00	2.792.499,28	77.854.032,51	930.512,75	879.870,42	1,21%	1,14%	0,73%	4,12%	27,71%	2,39%
Mai	77.854.032,51	924.999,36	840.000,00	78.672.564,48	733.532,61	1.613.403,03	0,94%	2,09%	1,27%	5,44%	38,44%	2,48%
Junho	78.672.564,48	8.993.380,78	8.908.000,00	78.403.103,29	-354.841,97	1.258.561,06	-0,45%	1,63%	0,97%	6,47%	25,24%	2,53%
Julho	78.403.103,29	3.620.011,71	3.620.536,29	77.983.547,85	-419.030,86	839.530,20	-0,53%	1,09%	1,43%	7,99%	13,64%	3,16%
Agosto	77.983.547,85	19.294.837,53	18.992.286,83	77.543.850,93	-742.247,62	97.282,58	-0,95%	0,13%	1,34%	9,43%	1,39%	2,03%
Setembro	77.543.850,93	1.282.510,24	2.895.156,62	75.560.205,17	-370.999,38	-273.716,80	-0,48%	-0,35%	1,61%	11,18%	-3,11%	2,36%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



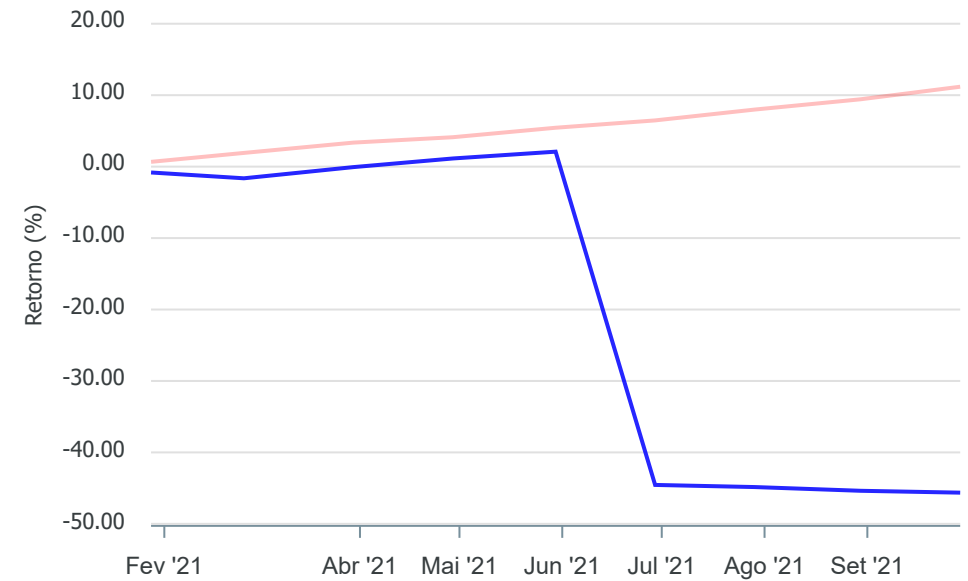
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO  36M



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.721.929,03	0,00	0,00	1.742.545,80	20.616,77	1,20%	1,20%	0,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	554.686,61	0,00	0,00	560.667,87	5.981,26	1,08%	1,08%	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.081.535,02	0,00	0,00	1.092.145,59	10.610,57	0,98%	0,98%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	245.623,01	0,00	0,00	248.024,18	2.401,17	0,98%	0,98%	0,82%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.031.129,42	0,00	0,00	18.126.649,06	95.519,64	0,53%	0,53%	0,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	9.222.973,59	379.911,25	0,00	9.646.489,91	43.605,07	0,45%	0,46%	0,03%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	568.906,82	0,00	45.393,36	525.860,60	2.347,14	0,41%	0,42%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.968.061,62	0,00	398.000,00	7.600.110,03	30.048,41	0,38%	0,38%	0,29%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.028.287,05	0,00	0,00	1.031.936,99	3.649,94	0,35%	0,35%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.471.062,82	902.598,99	450.000,00	9.959.730,03	36.068,22	0,35%	0,37%	0,30%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.091.304,19	0,00	0,00	1.092.474,22	1.170,03	0,11%	0,11%	0,67%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	735.056,64	0,00	0,00	733.927,93	-1.128,71	-0,15%	-0,15%	2,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	980.922,62	0,00	0,00	979.394,58	-1.528,04	-0,16%	-0,16%	2,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	357.370,18	0,00	356.255,09	0,00	-1.115,09	-0,31%	-0,01%	0,80%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>53.058.848,62</b>	<b>1.282.510,24</b>	<b>1.249.648,45</b>	<b>53.339.956,79</b>	<b>248.246,38</b>	<b>0,47%</b>		<b>0,28%</b>

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 JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	600.918,88	0,00	0,00	603.982,09	3.063,21	0,51%	0,51%	0,23%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	5.253.513,47	0,00	0,00	5.277.738,24	24.224,77	0,46%	0,46%	0,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.690.427,52	0,00	1.690.901,53	0,00	474,01	0,03%	0,04%	0,63%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	629.897,03	0,00	0,00	618.026,95	-11.870,08	-1,88%	-1,88%	11,04%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	1.086.630,11	0,00	0,00	1.057.623,54	-29.006,57	-2,67%	-2,67%	12,79%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.527.673,63	0,00	0,00	1.428.759,39	-98.914,24	-6,47%	-6,47%	12,37%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	767.451,41	0,00	0,00	715.637,28	-51.814,13	-6,75%	-6,75%	12,21%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	932.035,90	0,00	0,00	866.308,31	-65.727,59	-7,05%	-7,05%	12,29%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	593.879,74	0,00	0,00	548.070,98	-45.808,76	-7,71%	-7,71%	12,73%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.882.920,26	0,00	0,00	2.652.975,13	-229.945,13	-7,98%	-7,98%	11,95%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	448.426,29	0,00	0,00	401.548,97	-46.877,32	-10,45%	-10,45%	15,27%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	580.224,10	0,00	0,00	518.224,69	-61.999,41	-10,69%	-10,69%	15,26%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>16.993.998,34</b>	<b>0,00</b>	<b>1.690.901,53</b>	<b>14.688.895,57</b>	<b>-614.201,24</b>	<b>-3,61%</b>		<b>7,52%</b>



## 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 GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.785.537,94	0,00	0,00	2.802.822,93	17.284,99	0,62%	0,62%	6,92%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.875.594,51	0,00	0,00	3.865.901,82	-9.692,69	-0,25%	-0,25%	6,75%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	1.398.778,34	0,00	0,00	1.388.488,66	-10.289,68	-0,74%	-0,61%	5,84%
<b>Total Exterior</b>	<b>8.059.910,79</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8.057.213,41</b>	<b>-2.697,38</b>	<b>-0,03%</b>		<b>6,65%</b>

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.357.897,41	3.529.302,20	0,00	18.126.649,06	239.449,45	1,34%	1,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.714.960,07	5.844.099,09	0,00	9.646.489,91	87.430,75	0,91%	1,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.238.219,89	2.973.958,19	1.332.746,76	9.959.730,03	80.298,71	0,72%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.716.424,78	3.600.000,00	777.911,56	7.600.110,03	61.596,81	0,74%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.755.990,04	0,00	46.405,55	1.742.545,80	32.961,31	1,88%	1,92%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	664.269,28	0,00	145.463,34	525.860,60	7.054,66	1,06%	1,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	553.970,55	0,00	0,00	560.667,87	6.697,32	1,21%	1,21%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	747.746,33	0,00	500.000,00	248.024,18	277,85	0,04%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.892.552,81	0,00	1.800.000,00	1.092.145,59	-407,22	-0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	505.331,43	0,00	502.943,42	0,00	-2.388,01	-0,47%	-0,53%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	560.422,73	0,00	557.794,95	0,00	-2.627,78	-0,47%	-1,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	359.880,03	0,00	356.255,09	0,00	-3.624,94	-1,01%	-0,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	543.538,94	0,00	538.818,10	0,00	-4.720,84	-0,87%	-2,78%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	746.319,91	0,00	0,00	733.927,93	-12.391,98	-1,66%	-1,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.108.535,74	0,00	2.000.000,00	1.092.474,22	-16.061,52	-0,52%	-0,46%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	908.836,75	0,00	887.844,00	0,00	-20.992,75	-2,31%	-4,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.012.074,33	0,00	966.358,78	0,00	-45.715,55	-4,52%	-4,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.494.241,39	0,00	1.400.000,00	1.031.936,99	-62.304,40	-2,50%	-1,87%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.857.123,08	0,00	1.800.000,00	979.394,58	-77.728,50	-2,72%	-1,68%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>266.803,37</b>	<b>0,50%</b>	

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
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	5.250.000,00	0,00	5.277.738,24	27.738,24	0,53%	1,22%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.685.648,22	0,00	1.690.901,53	0,00	5.253,31	0,31%	0,32%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	600.000,00	0,00	603.982,09	3.982,09	0,66%	1,24%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.153.168,43	0,00	1.400.000,00	618.026,95	-135.141,48	-6,28%	-6,58%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	3.662.113,78	0,00	2.950.000,00	548.070,98	-164.042,80	-4,48%	-14,35%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.909.672,26	0,00	1.000.000,00	715.637,28	-194.034,98	-10,16%	-13,47%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.629.711,56	0,00	0,00	1.428.759,39	-200.952,17	-12,33%	-12,33%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	2.317.882,40	0,00	1.200.000,00	866.308,31	-251.574,09	-10,85%	-14,12%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	1.379.700,10	0,00	600.000,00	518.224,69	-261.475,41	-18,95%	-23,22%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	3.332.409,64	0,00	2.000.000,00	1.057.623,54	-274.786,10	-8,25%	-8,93%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	1.915.686,94	0,00	1.200.000,00	401.548,97	-314.137,97	-16,40%	-23,07%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.100.791,07	0,00	0,00	2.652.975,13	-447.815,94	-14,44%	-14,44%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-2.206.987,30</b>	<b>-7,63%</b>	

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	3.588.919,50	0,00	0,00	3.865.901,82	276.982,32	7,72%	7,72%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.653.333,18	1.000.000,00	0,00	2.802.822,93	149.489,75	5,63%	9,07%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	0,00	1.400.000,00	0,00	1.388.488,66	-11.511,34	-0,82%	4,12%
				<b>Total Exterior</b>	<b>414.960,73</b>	<b>5,43%</b>	

## 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.