

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.468.286,28	4,42%	569	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	2.315.154,81	1,21%	253	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	1.253.813,25	0,66%	121	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	37.073.412,80	19,37%	959	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	21.860.747,03	11,42%	1.062	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.502.588,75	8,62%	1.018	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	8.215.813,67	4,29%	293	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.136.931,06	1,64%	853	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	23.212.579,19	12,13%	1.252	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	9.391.707,62	4,91%	282	0,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL IMA GERAL FI REND...	D+0	Não há	17.374,23	0,01%	89	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	11.587.254,58	6,05%	587	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.001.655,82	0,52%	810	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.063.793,68	0,56%	252	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.687.358,94	0,88%	813	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	2.765.075,87	1,44%	112	0,26%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	498.330,52	0,26%	5.839	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.291.239,94	2,24%	2.795	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB FI AÇÕES	D+4	Não há	551.125,05	0,29%	20.704	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	183.816,90	0,10%	7.910	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

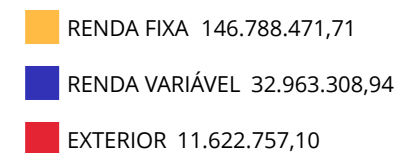
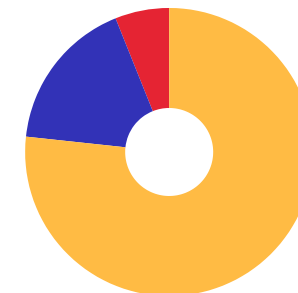
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	212.138,41	0,11%	6.894	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	189.686,16	0,10%	17.761	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	238.853,06	0,12%	5.420	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.193.056,87	2,71%	2.182	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	126.983,32	0,07%	4.286	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	194.662,20	0,10%	176	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	165.512,64	0,09%	5.824	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+6 ou ...	Não há	196.430,76	0,10%	88	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	445.184,73	0,23%	250	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	114.791,91	0,06%	6.961	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	663.764,41	0,35%	197	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	239.982,99	0,13%	13	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	14.263.702,57	7,45%	19.129	0,41%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	393.132,17	0,21%	25	0,63%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.623.416,35	0,85%	389	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se ...	Não se aplica	223.092,36	0,12%		0,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	D+6 du	Não há	1.982.780,26	1,04%	27	0,76%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	9.404.481,82	4,91%	120	0,42%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	235.495,02	0,12%	34.408	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
BNP PARIBAS STRATÉGIE FI AÇÕES	D+3 du	Não há	189.329,75	0,10%	15	0,50%	Desenquadrado - RV

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			191.374.537,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			195.120,83				Artigo 6º
		PL Total	191.569.658,58				

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

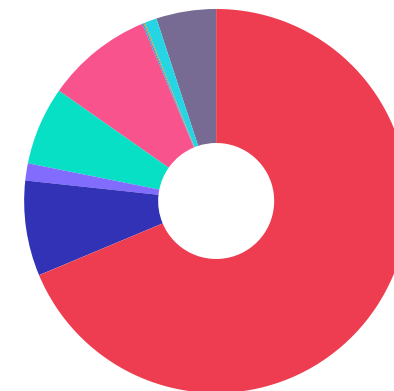
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	131.431.034,46	68,68%	40,00%	50,00%	100,00%	59.943.503,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	17.374,23	0,01%	1,00%	5,00%	70,00%	133.944.802,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	15.340.063,02	8,02%	15,00%	20,00%	40,00%	61.209.752,08
Total Renda Fixa	100,00%	146.788.471,71	76,70%	56,00%	75,00%	210,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	2.765.075,87	1,44%	2,00%	5,00%	30,00%	54.647.285,46
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	12.601.812,47	6,58%	5,00%	15,00%	20,00%	25.673.095,08
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	17.183.998,49	8,98%	5,00%	5,00%	10,00%	1.953.455,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	223.092,36	0,12%	1,00%	2,50%	5,00%	9.345.634,53
Desenquadrado - RV	0,00%	189.329,75	0,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-189.329,75
Total Renda Variável	30,00%	32.963.308,94	17,22%	13,00%	27,50%	65,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	1.982.780,26	1,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.982.780,26
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.639.976,84	5,04%	0,50%	2,50%	10,00%	9.497.476,94
Total Exterior	10,00%	11.622.757,10	6,07%	0,50%	2,50%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	143.790.132,53	75,14	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.404.486,39	22,68	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	1.623.416,35	0,85	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	498.330,52	0,26	0,00
META ASSET MANAGEMENT	445.184,73	0,23	0,18
ITAÚ UNIBANCO	393.132,17	0,21	0,00
BV ASSET	239.982,99	0,13	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	238.853,06	0,12	0,00
OLIVEIRA TRUST	223.092,36	0,12	0,00
EQUITAS INVESTIMENTOS	196.430,76	0,10	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	189.329,75	0,10	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	114.791,91	0,06	0,00
BANRISUL CORRETORA	17.374,23	0,01	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 ' b '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	70,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	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 III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-1,47%	1,56%	-0,12%	0,25%	4,62%	11,66%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,29%	1,46%	-0,03%	0,47%	4,40%	10,83%	1,97%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	-1,31%	-1,68%	-1,71%	-0,86%	1,05%	3,75%	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL IMA GERAL FI RENDA FIXA LP	-1,40%	-2,32%	-1,75%	-1,13%	0,41%	2,22%	1,97%	0,03%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,39%	-2,44%	-1,78%	-1,19%	0,32%	2,14%	1,95%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-3,44%	-9,10%	-5,21%	-5,61%	-5,90%	-1,54%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-3,49%	-9,40%	-5,35%	-5,88%	-6,24%	-2,10%	3,96%	0,06%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-3,87%	-10,25%	-7,19%	-5,85%	-1,01%	-6,80%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-3,98%	-10,58%	-7,43%	-6,14%	-1,35%	-7,51%	5,29%	0,10%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,93%	-10,45%	-7,30%	-6,06%	-1,35%	-7,32%	5,36%	0,10%
IRF-M 1 (Benchmark)	-0,54%	1,23%	0,23%	0,83%	1,78%	5,91%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,54%	1,05%	0,18%	0,71%	1,56%	5,47%	0,73%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-1,24%	1,22%	-0,10%	0,49%	4,43%	10,39%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,24%	1,03%	-0,14%	0,39%	4,19%	9,79%	1,99%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	-2,54%	-4,79%	-3,73%	-2,67%	1,83%	0,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,56%	-5,00%	-3,82%	-2,82%	1,58%	0,15%	3,57%	0,07%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,59%	-4,97%	-3,80%	-2,78%	1,54%	0,12%	3,61%	0,07%

CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,50%	3,17%	1,53%	2,55%	3,70%	6,36%	0,08%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,40%	2,07%	1,05%	1,72%	2,23%	4,34%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,63%	-2,98%	-2,07%	-1,74%	0,17%	1,97%	1,99%	0,04%

IPCA (Benchmark)	1,25%	8,24%	3,32%	5,73%	10,67%	15,01%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,66%	-1,82%	-1,75%	-2,29%	0,30%	4,82%	0,96%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,90%	-1,74%	-1,24%	-0,71%	1,93%	-	1,43%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	-6,27%	-12,20%	-16,31%	-13,99%	11,64%	-2,23%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-6,64%	-12,29%	-16,92%	-14,48%	10,67%	-3,67%	11,61%	0,24%

IDIV (Benchmark)	-4,23%	-8,71%	-8,99%	-7,55%	13,78%	1,74%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-4,31%	-11,26%	-11,69%	-11,00%	10,90%	-0,23%	11,59%	0,22%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,28%	-11,43%	-9,92%	-7,83%	10,79%	-4,15%	11,94%	0,25%

IBX (Benchmark)	-6,81%	-12,40%	-16,15%	-14,19%	10,40%	-1,79%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-7,72%	-26,84%	-21,94%	-24,08%	-11,64%	-10,57%	15,10%	0,24%

Ibovespa (Benchmark)	-6,74%	-13,04%	-15,02%	-12,95%	10,16%	-3,47%	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-11,57%	-19,55%	-21,17%	-17,61%	-2,15%	-21,79%	13,31%	0,24%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-10,13%	-15,27%	-17,46%	-16,11%	2,63%	-4,49%	12,63%	0,22%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-9,70%	-13,52%	-12,95%	-11,98%	6,98%	-1,86%	14,69%	0,23%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-13,06%	-26,38%	-26,15%	-26,03%	-15,80%	-14,66%	15,08%	0,22%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-5,92%	-21,37%	-16,83%	-15,40%	3,01%	-26,12%	17,48%	0,28%
BB FI AÇÕES	-1,47%	-23,37%	-8,61%	-1,22%	0,22%	-36,10%	18,21%	0,36%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-10,51%	-7,64%	-17,76%	-16,25%	14,63%	14,63%	13,92%	0,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,54%	-7,69%	-9,59%	-7,39%	19,55%	9,52%	11,11%	0,25%
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-15,73%	-21,02%	-24,98%	-22,09%	-4,40%	-23,43%	18,33%	0,28%

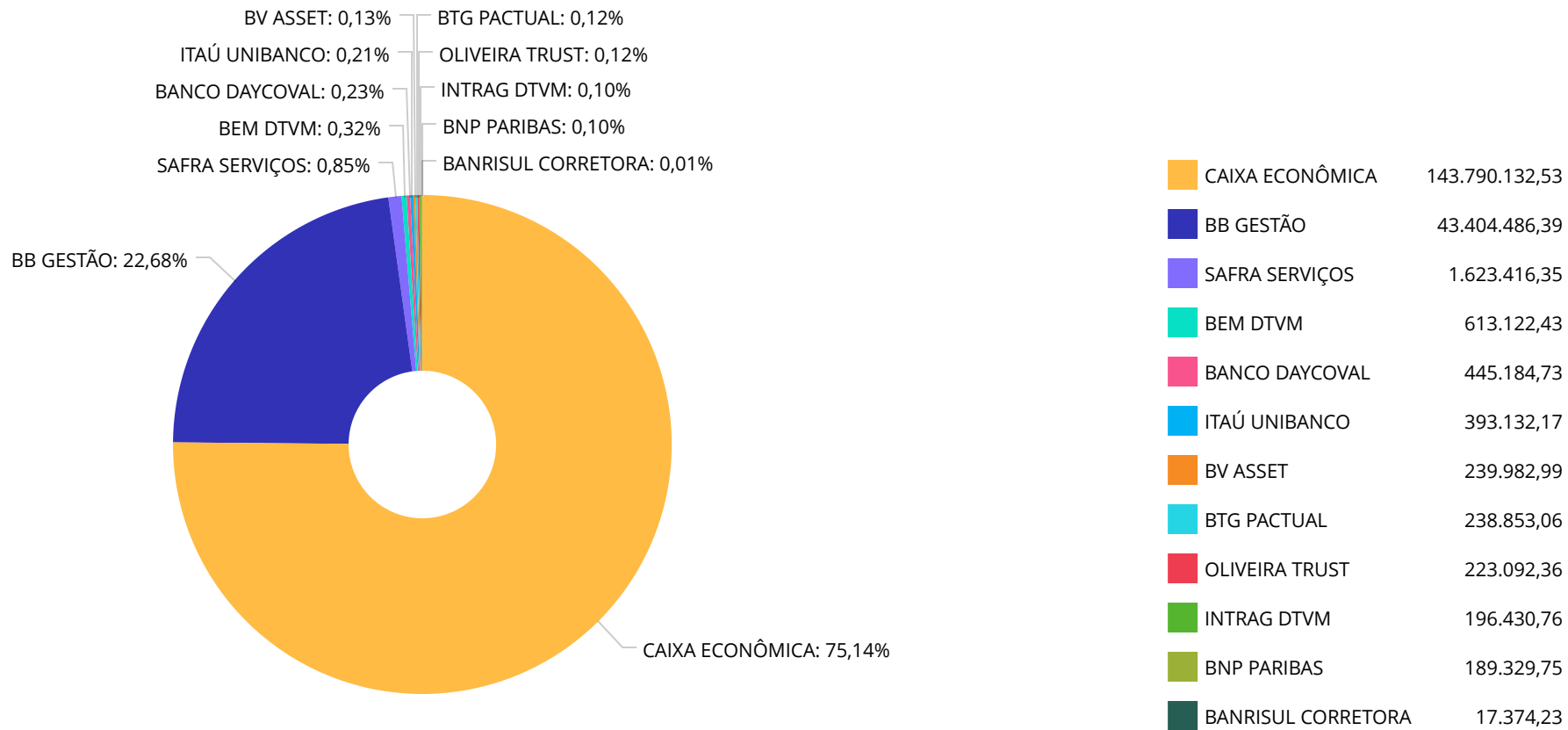
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BNP PARIBAS STRATÉGIE FI AÇÕES	-7,57%	-14,78%	-16,25%	-13,98%	6,87%	-5,17%	11,57%	-
SMLL (Benchmark)	-12,53%	-17,37%	-21,28%	-20,14%	3,62%	-2,77%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-6,62%	-8,04%	-15,06%	-13,66%	9,74%	2,78%	7,47%	0,20%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-12,78%	-20,56%	-22,90%	-21,62%	-0,43%	-12,21%	17,34%	0,28%
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	7,55%	25,96%	6,04%	12,17%	43,56%	51,04%	5,78%	0,13%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,20%	1,80%	0,46%	1,16%	3,96%	5,49%	0,65%	0,01%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-1,02%	2,38%	-0,15%	1,65%	7,07%	12,99%	1,99%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,29%	2,89%	1,32%	2,30%	3,40%	6,81%	0,22%	0,01%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,97%	25,22%	13,38%	10,89%	32,23%	96,53%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	7,64%	26,45%	6,08%	12,36%	44,33%	49,77%	5,83%	0,13%
IFIX (Benchmark)	-1,47%	-6,78%	-5,26%	-6,48%	-3,29%	-4,17%	-	-
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	1,07%	-1,28%	-3,65%	-0,44%	-1,31%	-4,14%	7,12%	0,06%

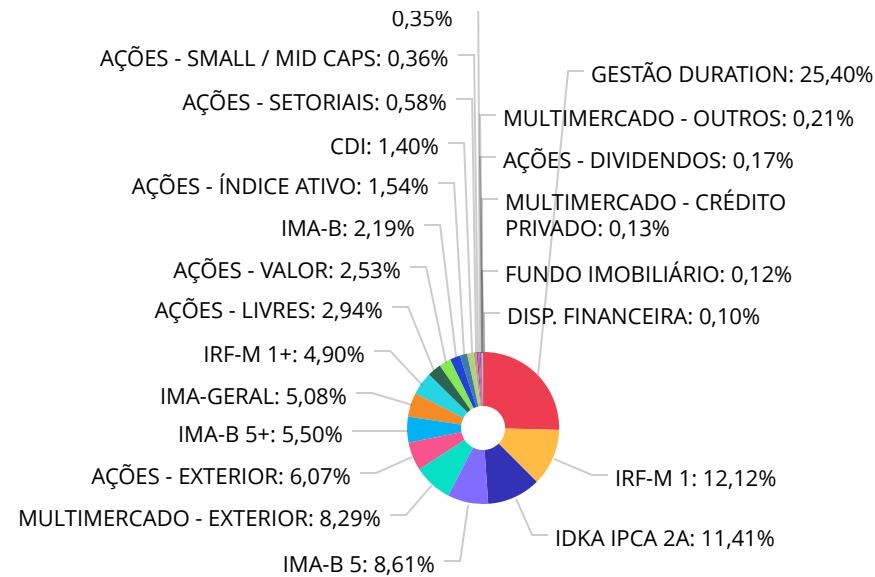
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	11,15%	32,29%	13,49%	15,25%	36,93%	118,76%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,84%	-1,57%	-13,87%	-10,90%	10,74%	33,72%	11,00%	0,16%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,65%	31,31%	14,88%	15,18%	34,98%	111,28%	7,49%	0,13%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,97%	25,22%	13,38%	10,89%	32,23%	96,53%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	8,50%	23,70%	11,02%	9,30%	27,43%	78,47%	7,66%	0,12%

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



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

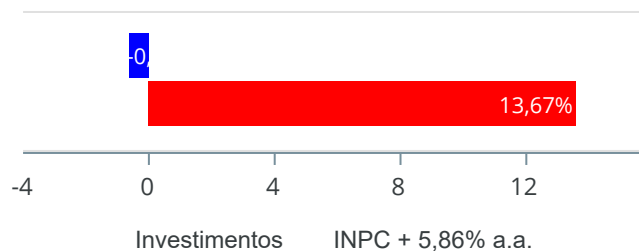


■ GESTÃO DURATION	48.660.667,38	■ IRF-M 1	23.212.579,19	■ IDKA IPCA 2A	21.860.747,03
■ IMA-B 5	16.502.588,75	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	15.887.118,92	■ AÇÕES - EXTERIOR	11.622.757,10
■ IMA-B 5+	10.530.968,48	■ IMA-GERAL	9.739.473,76	■ IRF-M 1+	9.391.707,62
■ AÇÕES - LIVRES	5.628.340,69	■ AÇÕES - VALOR	4.851.216,58	■ IMA-B	4.200.724,74
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.954.405,62	■ CDI	2.689.014,76	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.112.593,00
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	688.016,68	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	663.764,41	■ MULTIMERCADO - OUTROS	393.132,17
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	321.645,52	■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	239.982,99	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	223.092,36
■ DISP. FINANCEIRA	195.120,83				

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	174.029.009,33	24.036,95	1.152.545,37	172.033.466,15	-867.034,76	-867.034,76	-0,50%	-0,50%	0,72%	0,72%	-68,79%	2,19%
Fevereiro	172.033.466,15	17.533.693,88	13.501.438,11	174.657.677,61	-1.408.044,31	-2.275.079,07	-0,80%	-1,29%	1,23%	1,96%	-65,88%	2,26%
Março	174.657.677,61	3.469.020,67	1.289.489,25	177.952.025,71	1.114.816,68	-1.160.262,39	0,63%	-0,67%	1,39%	3,38%	-19,89%	2,75%
Abril	177.952.025,71	2.191.117,93	307.061,86	181.608.472,47	1.772.390,69	612.128,30	0,99%	0,31%	0,83%	4,24%	7,25%	1,86%
Mai	181.608.472,47	1.968.190,87	15.000,00	185.237.881,45	1.676.218,11	2.288.346,41	0,91%	1,22%	1,44%	5,74%	21,31%	1,97%
Junho	185.237.881,45	3.124.900,00	2.733.539,48	185.808.953,64	179.711,67	2.468.058,08	0,10%	1,32%	1,08%	6,88%	19,20%	1,85%
Julho	185.808.953,64	27.467.531,19	26.292.616,93	186.402.111,76	-581.756,14	1.886.301,94	-0,31%	1,01%	1,52%	8,51%	11,82%	2,49%
Agosto	186.402.111,76	4.201.057,98	1.188.472,49	188.621.609,59	-793.087,66	1.093.214,28	-0,42%	0,58%	1,38%	10,01%	5,82%	2,69%
Setembro	188.621.609,59	2.106.576,08	1.029.635,21	188.551.901,00	-1.146.649,46	-53.435,18	-0,60%	-0,02%	1,68%	11,86%	-0,21%	2,63%
Outubro	188.551.901,00	3.967.208,09	0,00	191.374.537,75	-1.144.571,34	-1.198.006,52	-0,59%	-0,62%	1,62%	13,67%	-4,53%	3,39%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



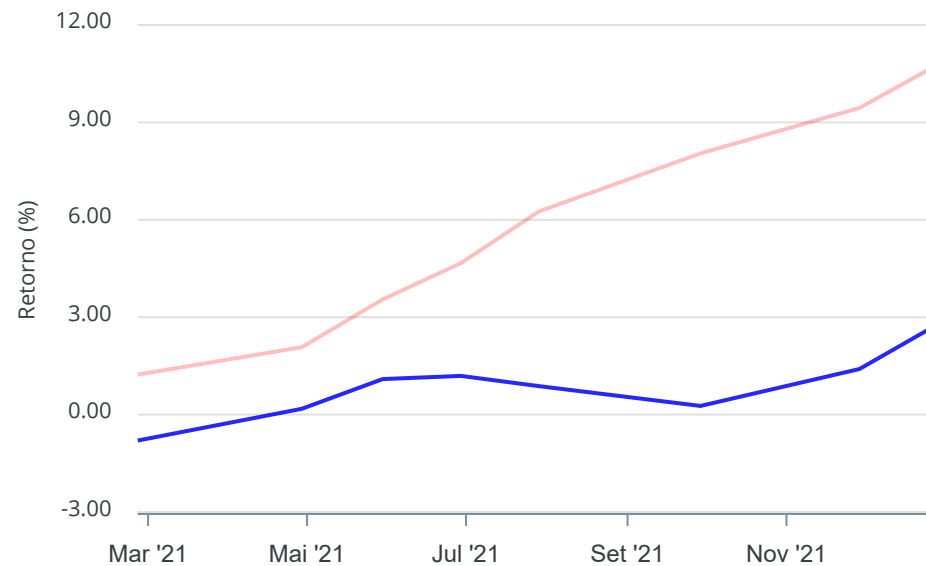
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Outubro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	648.633,17	1.035.100,00	0,00	1.687.358,94	3.625,77	0,22%	0,50%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.001.407,88	0,00	1.001.655,82	247,94	0,02%	0,40%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.247.014,39	90.000,00	0,00	23.212.579,19	-124.435,20	-0,53%	-0,54%	0,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	37.320.185,05	0,00	0,00	37.073.412,80	-246.772,25	-0,66%	-0,66%	0,96%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.692.045,98	0,00	0,00	11.587.254,58	-104.791,40	-0,90%	-0,90%	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.710.473,97	0,00	0,00	16.502.588,75	-207.885,22	-1,24%	-1,24%	1,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	22.146.940,90	0,00	0,00	21.860.747,03	-286.193,87	-1,29%	-1,29%	1,97%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	1.271.487,09	0,00	0,00	1.253.813,25	-17.673,84	-1,39%	-1,39%	1,95%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL IMA GERAL FI RENDA ...	17.620,72	0,00	0,00	17.374,23	-246,49	-1,40%	-1,40%	1,97%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.608.285,61	0,00	0,00	8.468.286,28	-139.999,33	-1,63%	-1,63%	1,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.219.400,47	0,00	0,00	3.136.931,06	-82.469,41	-2,56%	-2,56%	3,57%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.092.081,49	0,00	0,00	1.063.793,68	-28.287,81	-2,59%	-2,59%	3,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	9.731.657,15	0,00	0,00	9.391.707,62	-339.949,53	-3,49%	-3,49%	3,96%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.409.827,33	0,00	0,00	2.315.154,81	-94.672,52	-3,93%	-3,93%	5,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	8.556.372,62	0,00	0,00	8.215.813,67	-340.558,95	-3,98%	-3,98%	5,29%
Total Renda Fixa	146.672.025,94	2.126.507,88	0,00	146.788.471,71	-2.010.062,11	-1,35%		1,86%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.250.997,56	0,00	0,00	14.263.702,57	1.012.705,01	7,64%	7,64%	5,83%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.509.509,95	0,00	0,00	1.623.416,35	113.906,40	7,55%	7,55%	5,78%
ITAU INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	392.009,84	0,00	0,00	393.132,17	1.122,33	0,29%	0,29%	0,22%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	662.410,80	0,00	0,00	663.764,41	1.353,61	0,20%	0,20%	0,65%
BV ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	242.457,62	0,00	0,00	239.982,99	-2.474,63	-1,02%	-1,02%	1,99%
BB FI AÇÕES	559.329,35	0,00	0,00	551.125,05	-8.204,30	-1,47%	-1,47%	18,21%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	226.433,88	0,00	0,00	223.092,36	-3.341,52	-1,48%	1,07%	7,12%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	132.657,61	0,00	0,00	126.983,32	-5.674,29	-4,28%	-4,28%	11,94%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	203.420,70	0,00	0,00	194.662,20	-8.758,50	-4,31%	-4,31%	11,59%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.542.988,52	0,00	0,00	4.291.239,94	-251.748,58	-5,54%	-5,54%	11,11%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	225.488,29	0,00	0,00	212.138,41	-13.349,88	-5,92%	-5,92%	17,48%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	533.629,21	0,00	0,00	498.330,52	-35.298,69	-6,61%	-6,61%	7,47%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	2.961.776,85	0,00	0,00	2.765.075,87	-196.700,98	-6,64%	-6,64%	11,61%
BNP PARIBAS STRATÉGIE FI AÇÕES	204.826,68	0,00	0,00	189.329,75	-15.496,93	-7,57%	-7,57%	11,57%
META VALOR FI AÇÕES	482.405,20	0,00	0,00	445.184,73	-37.220,47	-7,72%	-7,72%	15,10%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	183.286,27	0,00	0,00	165.512,64	-17.773,63	-9,70%	-9,70%	14,69%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	4.938.599,49	831.350,00	0,00	5.193.056,87	-576.892,62	-10,00%	-10,13%	12,63%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	205.411,80	0,00	0,00	183.816,90	-21.594,90	-10,51%	-10,51%	13,92%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	129.808,22	0,00	0,00	114.791,91	-15.016,31	-11,57%	-11,57%	13,31%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	217.489,45	0,00	0,00	189.686,16	-27.803,29	-12,78%	-12,78%	17,34%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	274.731,94	0,00	0,00	238.853,06	-35.878,88	-13,06%	-13,06%	15,08%
EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	233.093,07	0,00	0,00	196.430,76	-36.662,31	-15,73%	-15,73%	18,33%
Total Renda Variável	32.312.762,30	831.350,00	0,00	32.963.308,94	-180.803,36	-0,55%		8,73%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.489.570,41	1.009.350,21	0,00	9.404.481,82	905.561,20	10,66%	10,65%	7,49%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO ETF INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI ...	1.827.443,04	0,00	0,00	1.982.780,26	155.337,22	8,50%	8,50%	7,66%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	250.099,31	0,00	0,00	235.495,02	-14.604,29	-5,84%	-5,84%	11,00%
Total Exterior	9.567.112,76	1.009.350,21	0,00	11.622.757,10	1.046.294,13	9,89%		7,59%

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.