

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2021

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			21.837.192,48	5,87%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	50.272.366,50	13,52%	569	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	22.115.529,34	5,95%	1.136	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	7.962.645,32	2,14%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	28.270.725,82	7,60%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	2.152.722,63	0,58%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.462.609,50	2,01%	238	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	61.418.533,08	16,52%	959	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.795.623,73	1,83%	587	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	71.836,53	0,02%	810	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	19.978.452,54	5,37%	195	1,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	13.157.839,82	3,54%	1.436	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.346,69	0,00%	306	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	3.885.326,78	1,04%	137	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.832.272,09	1,30%	92	0,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.661.266,09	0,72%	73	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	5.123.360,11	1,38%	102	2,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	D+20	Não há	12.718.672,34	3,42%	1.415	3,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	2.948.619,61	0,79%	90.639	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	11.807.831,39	3,18%	176	1,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

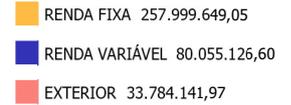
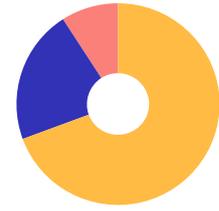
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.494.997,65	0,40%	5.099	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	11.026.014,58	2,97%	20.607	1,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.616.079,58	1,78%	35.951	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.420.016,34	2,53%	2.443	0,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	814.196,84	0,22%	3.257	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	3.535.638,71	0,95%	126.331	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	1.823.020,60	0,49%	4.763	0,71%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.175.393,83	0,32%	15.334	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	15.139.189,36	4,07%	1.270	0,65%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.535.455,77	0,41%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	1.609.820,36	0,43%	8.622	0,23%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	932.604,87	0,25%	84	0,07%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	2.007.587,25	0,54%	1.325	0,90%	Artigo 9º - A, Inciso II
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EX...	D+6 du	Não há	776.435,69	0,21%	4.533	0,25%	Artigo 9º - A, Inciso II
J ESG EMERGING MARKETS DÓLAR ADVISORY INVESTIMEN...	D+6 du	Não há	1.039.239,03	0,28%	476	7,04%	Artigo 9º - A, Inciso II
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	D+4 du	Não há	1.909.698,75	0,51%	142	0,76%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	22.107.716,73	5,95%	15.227	1,35%	Artigo 9º - A, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL...	D+2 du	Não há	782.550,37	0,21%	3.789	0,85%	Artigo 9º - A, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.618.488,92	0,70%	509	0,07%	Artigo 9º - A, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		474.344,39	0,13%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			371.838.917,62				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			474.344,39				Artigo 6º
		PL Total	372.313.262,01				

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

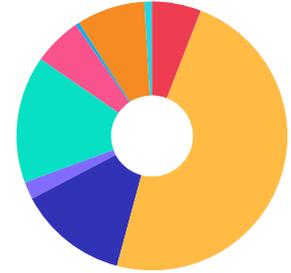
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	21.837.192,48	5,87%	0,00%	1,00%	100,00%	350.001.725,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	179.655.132,19	48,32%	40,00%	50,00%	100,00%	192.183.785,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	371.838.917,62
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.591.945,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	223.103.350,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	223.103.350,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	48.722.698,18	13,10%	0,00%	5,00%	40,00%	100.012.868,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	50,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	148.735.567,05
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	74.367.783,52
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	55.775.837,64
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	55.775.837,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.591.945,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	7.784.626,20	2,09%	0,00%	1,00%	5,00%	10.807.319,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.591.945,88
Total Renda Fixa	100,00%	257.999.649,05	69,38%	40,00%	59,00%	570,00%	



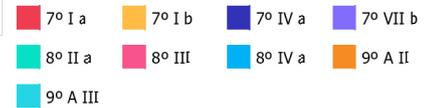
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 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%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	111.551.675,29
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	111.551.675,29
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	56.846.428,33	15,29%	0,00%	17,00%	20,00%	17.521.355,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	74.367.783,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	21.673.242,50	5,83%	0,00%	8,00%	10,00%	15.510.649,26
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	1.535.455,77	0,41%	0,00%	1,00%	5,00%	17.056.490,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	18.591.945,88
Total Renda Variável	40,00%	80.055.126,60	21,53%	0,00%	30,00%	120,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	37.183.891,76
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	30.383.102,68	8,17%	0,00%	4,00%	10,00%	6.800.789,08
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	3.401.039,29	0,91%	0,00%	5,00%	10,00%	33.782.852,47
Total Exterior	10,00%	33.784.141,97	9,09%	0,00%	10,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	125.553.509,91	33,77	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	72.344.709,88	19,46	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	40.598.901,86	10,92	0,00
ITAU UNIBANCO	25.640.595,72	6,90	0,00
XP ASSET MANAGEMENT	25.533.211,81	6,87	0,41
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	21.837.192,48	5,87	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	12.718.672,34	3,42	0,44
VINCI PARTNERS	11.807.831,39	3,18	0,01
INDIE CAPITAL	11.026.014,58	2,97	0,32
NAVI CAPITAL	9.420.016,34	2,53	0,64
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	4.832.272,09	1,30	0,00
ALASKA ASSET MANAGEMENT	2.948.619,61	0,79	0,03
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	1.909.698,75	0,51	0,02
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	1.823.020,60	0,49	0,00
LAD CAPITAL	1.535.455,77	0,41	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	1.494.997,65	0,40	0,11
OCCAM BRASIL	814.196,84	0,22	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 '	21.837.192,48	5,87	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	179.655.132,19	48,32	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	48.722.698,18	13,10	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 VI, Alínea ' b '	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 '	7.784.626,20	2,09	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 '	56.846.428,33	15,29	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	21.673.242,50	5,83	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.535.455,77	0,41	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	30.383.102,68	8,17	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	3.401.039,29	0,91	0,00	10,00

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
IRF-M 1 (Benchmark)	-0,54%	1,23%	0,23%	0,83%	1,78%	5,91%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,52%	1,00%	0,18%	0,70%	1,52%	5,24%	0,74%	0,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,55%	1,01%	0,19%	0,79%	1,54%	5,26%	0,73%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-1,24%	1,22%	-0,10%	0,49%	4,43%	10,39%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,83%	2,53%	0,64%	1,83%	5,58%	11,95%	1,24%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	-2,54%	-4,79%	-3,73%	-2,67%	1,83%	0,81%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,50%	4,14%	1,25%	3,04%	6,63%	11,48%	0,91%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,40%	2,07%	1,05%	1,72%	2,23%	4,34%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,38%	2,16%	1,03%	1,73%	2,33%	4,75%	0,01%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,31%	1,46%	0,80%	1,27%	1,51%	2,36%	0,01%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,84%	4,60%	2,82%	4,40%	5,13%	10,08%	0,52%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,25%	8,24%	3,32%	5,73%	10,67%	15,01%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-1,20%	0,49%	-0,09%	0,30%	3,88%	9,48%	2,11%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,10%	1,74%	0,32%	0,95%	5,10%	11,30%	1,72%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,66%	-1,82%	-1,75%	-2,29%	0,30%	4,82%	0,96%	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
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,72%	-2,35%	-1,37%	-0,82%	0,85%	2,10%	1,48%	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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,55%	1,08%	-0,02%	0,90%	1,84%	4,42%	1,12%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-1,40%	-0,48%	-1,47%	-1,15%	2,52%	7,44%	2,31%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,63%	-2,98%	-2,07%	-1,74%	0,17%	1,97%	1,99%	0,04%

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
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%
IBX (Benchmark)	-6,81%	-12,40%	-16,15%	-14,19%	10,40%	-1,79%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	-14,37%	-21,56%	-25,50%	-21,53%	-6,80%	-2,96%	15,36%	0,25%
Ibovespa (Benchmark)	-6,74%	-13,04%	-15,02%	-12,95%	10,16%	-3,47%	-	-
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	-5,37%	-7,62%	-11,38%	-11,07%	8,65%	7,91%	15,28%	0,19%
OCCAM FIC AÇÕES	-4,90%	-13,38%	-13,65%	-13,99%	6,72%	-0,81%	9,85%	0,21%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-6,92%	-8,05%	-14,17%	-14,35%	10,91%	0,45%	12,20%	0,22%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,13%	-9,55%	-14,70%	-10,43%	14,07%	2,11%	12,85%	0,25%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-6,85%	-5,28%	-13,74%	-13,04%	8,00%	1,18%	11,47%	0,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-7,54%	-8,06%	-15,47%	-11,98%	9,73%	-3,63%	9,84%	0,20%
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,89%	-0,30%	-2,96%	-2,10%	4,27%	6,17%	1,70%	0,04%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,38%	2,90%	1,28%	2,12%	3,65%	8,02%	0,24%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 FIP MULTIELABORAÇÃO	-	-	-	-	-	-	-	-

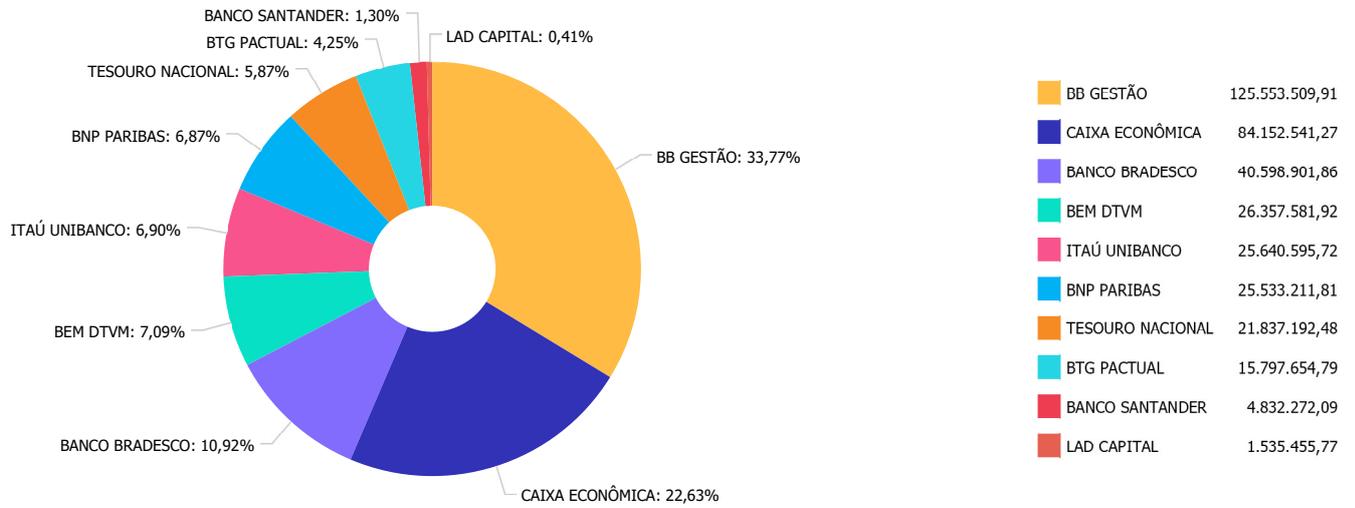
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	7,63%	26,41%	6,12%	12,21%	44,35%	52,17%	5,83%	0,13%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7,70%	27,35%	6,26%	12,78%	45,56%	-	5,85%	0,13%

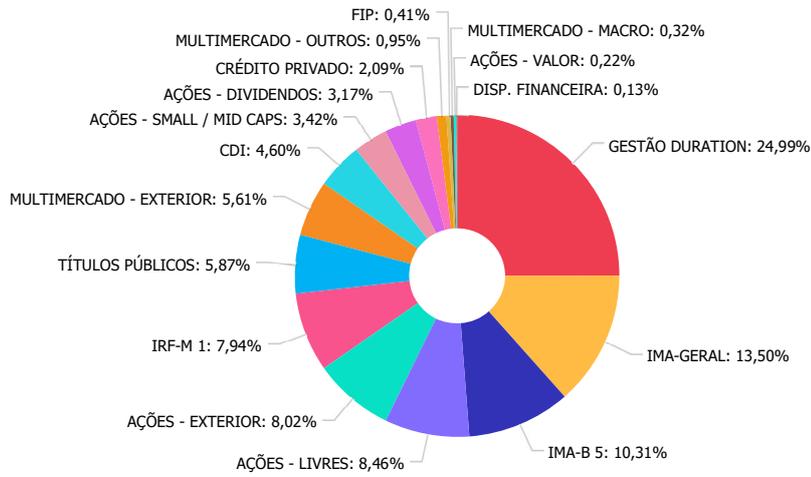
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	9,54%	28,15%	13,97%	12,82%	35,37%	100,32%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	7,72%	28,87%	11,13%	12,14%	39,18%	128,07%	10,98%	0,13%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	10,93%	29,48%	13,35%	13,59%	33,55%	114,42%	7,94%	0,13%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÃO...	7,38%	13,32%	9,59%	3,69%	17,60%	-	11,61%	0,12%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	5,53%	17,43%	3,05%	9,05%	34,24%	-	7,84%	0,15%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	7,56%	15,38%	7,63%	6,82%	-	-	9,36%	-
J ESG EMERGING MARKETS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	4,39%	10,19%	7,81%	1,41%	-	-	10,06%	-
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,77%	0,97%	8,14%	-1,38%	-	-	8,95%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	8,26%	21,07%	12,22%	12,79%	31,97%	-	8,80%	0,19%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I FIC AÇÕES	2,63%	-4,84%	1,26%	-6,93%	-	-	7,91%	-

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



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



GESTÃO DURATION	93.024.881,44
IMA-GERAL	50.272.366,50
IMA-B 5	38.386.093,77
AÇÕES - LIVRES	31.505.777,76
AÇÕES - EXTERIOR	29.866.855,97
IRF-M 1	29.578.138,84
TÍTULOS PÚBLICOS	21.837.192,48
MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.879.495,96
CDI	17.116.349,82
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	12.718.672,34
AÇÕES - DIVIDENDOS	11.807.831,39
CRÉDITO PRIVADO	7.784.626,20
MULTIMERCADO - OUTROS	3.535.638,71
FIP	1.535.455,77
MULTIMERCADO - MACRO	1.175.393,83
AÇÕES - VALOR	814.196,84
DISP. FINANCEIRA	474.344,39

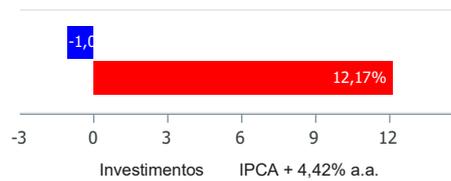
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	28/10/2021	1.182	3.841,54349408	3.841,543490	4.540.704,41	4.540.704,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	26/11/2021	209	3937,183068	3.827,803895	822.871,26	800.011,01	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	28/10/2021	703	3.876,39758179	3.876,397584	2.725.107,50	2.725.107,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	26/11/2021	124	3978,085407	3.857,162890	493.282,59	478.288,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	28/10/2021	465	3.903,17739785	3.903,177398	1.814.977,49	1.814.977,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	26/11/2021	82	4021,180278	3.882,921394	329.736,78	318.399,55	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	28/10/2021	38	4.021,07210526	4.021,072229	152.800,74	152.800,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	26/11/2021	6	4050,420287	3.984,934096	24.302,52	23.909,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/10/2021	659	4.185,49223065	4.185,492224	2.758.239,38	2.758.239,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	28/10/2021	454	4.072,15259912	4.072,152589	1.848.757,28	1.848.757,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	26/11/2021	74	4104,522721	4.047,718829	303.734,68	299.531,19	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	28/10/2021	540	4.043,04522222	4.043,045221	2.183.244,42	2.183.244,42	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	26/11/2021	86	4180,322252	4.013,168169	359.507,71	345.132,46	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	28/10/2021	1.414	4.111,28804809	4.111,288048	5.813.361,30	5.813.361,30	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	26/11/2021	231	4150,184278	4.077,951120	958.692,57	942.006,71	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	343.830.991,70	7.629.861,52	9.185.155,14	340.458.946,54	-1.816.751,54	-1.816.751,54	-0,53%	-0,53%	0,59%	0,59%	-88,85%	3,61%
Fevereiro	340.458.946,54	31.624.840,95	27.588.107,17	342.332.549,42	-2.163.130,90	-3.979.882,44	-0,63%	-1,15%	1,17%	1,77%	-65,00%	3,55%
Março	342.332.549,42	26.755.725,63	27.306.227,09	343.699.683,93	1.917.615,97	-2.062.266,47	0,56%	-0,60%	1,33%	3,13%	-19,17%	4,27%
Abril	343.699.683,93	43.913.864,44	33.727.631,55	358.133.117,28	4.247.220,46	2.184.953,99	1,20%	0,59%	0,65%	3,80%	15,62%	2,56%
Mai	358.133.117,28	48.272.024,76	43.565.632,65	366.954.284,28	4.114.774,89	6.299.728,88	1,13%	1,73%	1,19%	5,04%	34,40%	3,17%
Junho	366.954.284,28	31.709.089,64	36.399.598,87	363.642.948,37	1.379.173,32	7.678.902,20	0,38%	2,12%	0,89%	5,98%	35,40%	2,40%
Julho	363.642.948,37	34.254.025,97	29.649.837,24	365.434.611,68	-2.812.525,42	4.866.376,78	-0,76%	1,34%	1,34%	7,40%	18,06%	3,17%
Agosto	365.434.611,68	37.469.759,27	37.265.772,71	363.940.126,35	-1.698.471,89	3.167.904,89	-0,46%	0,87%	1,25%	8,75%	9,90%	2,75%
Setembro	363.940.126,35	60.579.377,22	52.227.404,58	368.685.881,90	-3.606.217,09	-438.312,20	-0,97%	-0,11%	1,53%	10,40%	-1,07%	3,34%
Outubro	368.685.881,90	57.935.106,58	51.218.824,53	371.838.917,62	-3.563.246,33	-4.001.558,53	-0,95%	-1,06%	1,60%	12,17%	-8,70%	4,31%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



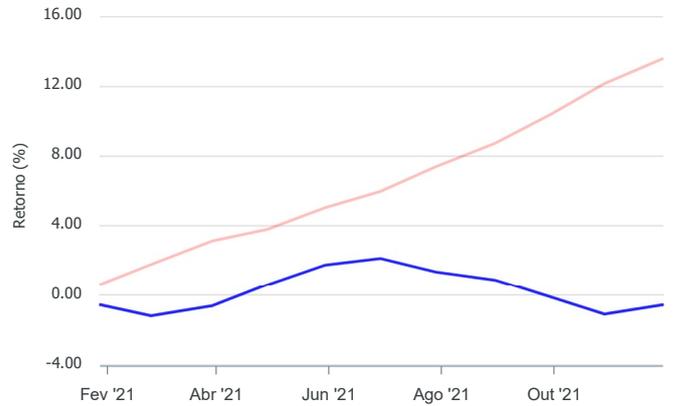
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	3.853.148,04	0,00	0,00	3.885.326,78	32.178,74	0,84%	0,84%	0,52%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.341,63	0,00	0,00	1.346,69	5,06	0,38%	0,38%	0,01%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	15.365.924,14	18.380.551,81	20.642.181,97	13.157.839,82	53.545,84	0,16%	0,31%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	38.575,85	10.944.158,82	10.914.384,08	71.836,53	3.485,94	0,03%	0,40%	0,01%
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	21.837.192,52	0,00	21.837.192,48	-0,04	0,00%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	2.163.458,55	0,00	0,00	2.152.722,63	-10.735,92	-0,50%	-0,50%	0,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	22.230.850,19	0,00	0,00	22.115.529,34	-115.320,85	-0,52%	-0,52%	0,74%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	4.858.849,71	0,00	0,00	4.832.272,09	-26.577,62	-0,55%	-0,55%	1,12%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.780.032,66	725.000,00	0,00	7.462.609,50	-42.423,16	-0,57%	-0,55%	0,73%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.808.512,15	4.285.690,92	0,00	19.978.452,54	-115.750,53	-0,58%	-0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	61.827.354,11	0,00	0,00	61.418.533,08	-408.821,03	-0,66%	-0,66%	0,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	28.506.798,07	0,00	0,00	28.270.725,82	-236.072,25	-0,83%	-0,83%	1,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.857.081,16	0,00	0,00	6.795.623,73	-61.457,43	-0,90%	-0,90%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.051.038,44	0,00	0,00	7.962.645,32	-88.393,12	-1,10%	-1,10%	1,72%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.693.603,89	0,00	0,00	2.661.266,09	-32.337,80	-1,20%	-1,20%	2,11%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	5.195.979,15	0,00	0,00	5.123.360,11	-72.619,04	-1,40%	-1,40%	2,31%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.247.804,39	0,00	10.000.000,00	50.272.366,50	-975.437,89	-1,59%	-1,63%	1,99%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.414.012,57	0,00	4.285.690,92	0,00	-128.321,65	-2,91%	-2,65%	3,50%
Total Renda Fixa	249.894.364,70	56.172.594,07	45.842.256,97	257.999.649,05	-2.225.052,75	-0,86%		1,25%

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	18.795.186,63	0,00	5.000.000,00	15.139.189,36	1.344.002,73	7,15%	7,63%	5,83%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	0,00	1.762.512,51	0,00	1.823.020,60	60.508,09	3,43%	7,70%	5,85%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.522.176,25	0,00	0,00	3.535.638,71	13.462,46	0,38%	0,38%	0,24%
MAUÁ INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	375.538,63	0,00	376.567,56	0,00	1.028,93	0,27%	0,42%	0,09%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	1.535.398,35	0,00	0,00	1.535.455,77	57,42	0,00%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.185.939,48	0,00	0,00	1.175.393,83	-10.545,65	-0,89%	-0,89%	1,70%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	12.339.105,00	0,00	0,00	11.807.831,39	-531.273,61	-4,31%	-4,31%	11,59%
OCCAM FIC AÇÕES	856.130,91	0,00	0,00	814.196,84	-41.934,07	-4,90%	-4,90%	9,85%
4UM SMALL CAPS FI AÇÕES	13.440.562,68	0,00	0,00	12.718.672,34	-721.890,34	-5,37%	-5,37%	15,28%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.165.419,89	0,00	0,00	2.948.619,61	-216.800,28	-6,85%	-6,85%	11,47%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.606.175,50	0,00	0,00	1.494.997,65	-111.177,85	-6,92%	-6,92%	12,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7.155.340,33	0,00	0,00	6.616.079,58	-539.260,75	-7,54%	-7,54%	9,84%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.481.631,86	0,00	0,00	9.420.016,34	-1.061.615,52	-10,13%	-10,13%	12,85%
INDIE FIC AÇÕES	12.876.828,52	0,00	0,00	11.026.014,58	-1.850.813,94	-14,37%	-14,37%	15,36%
Total Renda Variável	87.335.434,03	1.762.512,51	5.376.567,56	80.055.126,60	-3.666.252,38	-4,11%		10,81%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.360.512,24	0,00	0,00	2.618.488,92	257.976,68	10,93%	10,93%	7,94%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	1.763.999,56	0,00	0,00	1.909.698,75	145.699,19	8,26%	8,26%	8,80%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	865.771,96	0,00	0,00	932.604,87	66.832,91	7,72%	7,72%	10,98%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	1.866.503,46	0,00	0,00	2.007.587,25	141.083,79	7,56%	7,43%	9,36%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	20.588.553,51	0,00	0,00	22.107.716,73	1.519.163,22	7,38%	7,38%	11,61%
J CHINA EQUITY DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTE...	727.194,76	0,00	0,00	776.435,69	49.240,93	6,77%	6,77%	8,95%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	1.525.484,93	0,00	0,00	1.609.820,36	84.335,43	5,53%	5,53%	7,84%
J ESG EMERGING MARKETS DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO...	995.547,16	0,00	0,00	1.039.239,03	43.691,87	4,39%	4,39%	10,06%
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX JAPÃO BDR ETF NÍVEL I...	762.515,59	0,00	0,00	782.550,37	20.034,78	2,63%	2,63%	7,91%
Total Exterior	31.456.083,17	0,00	0,00	33.784.141,97	2.328.058,80	7,40%		10,64%

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.