

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

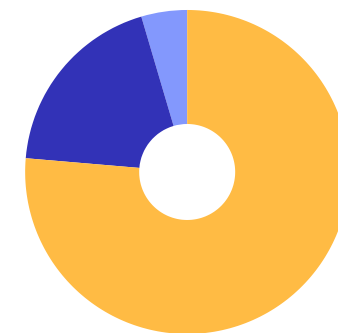
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			43.245.867,67	5,92%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	46.044.130,69	6,30%	1.026	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	146.317.667,87	20,02%	642	2,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	14.494.477,19	1,98%	117	2,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	104.348.684,24	14,28%	853	2,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	22.193.574,92	3,04%	347	1,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	12.578.341,05	1,72%	66	2,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	93.899.990,80	12,85%	171	7,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.985.154,20	1,78%	1.736	13,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	55.270.069,64	7,56%	471	3,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		100,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	6.530.783,00	0,89%	102	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.936.836,96	0,68%	11	0,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.078.128,70	1,11%	7.880	1,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	18.365.203,43	2,51%	5.839	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.571.299,68	0,49%	5.420	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.883.794,36	0,39%	701	3,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	1.976.384,37	0,27%	176	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	464.029,11	0,06%	134	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	29.721.671,52	4,07%	14.701	11,65%	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
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.566.846,76	0,49%	5.933	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.702.254,21	1,05%	51	0,87%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.205.246,07	0,58%	2.443	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	10.953.652,00	1,50%	85	10,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MAG FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.215.260,85	0,30%	34	1,89%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	31.361.886,72	4,29%	60.615	1,28%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	Não se ...	Não se aplica	481.079,71	0,07%	21	0,22%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	754.154,53	0,10%	15	0,82%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	532.628,55	0,07%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	1.560.271,52	0,21%		0,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	S/Info	Não se aplica	369.732,00	0,05%		0,13%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	S/Info	Não se aplica	748.000,00	0,10%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	S/Info	Não se aplica	4.120.000,00	0,56%		0,84%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - ...	S/Info	Não se aplica	13.113,80	0,00%		1,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	788.054,90	0,11%		1,75%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	16.477.718,14	2,26%	91	0,66%	Artigo 9º - A, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	16.921.222,36	2,32%	442	5,65%	Artigo 9º - A, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			730.677.211,54				

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%	43.245.867,67	5,92%	5,00%	6,00%	10,00%	29.821.853,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	439.876.866,76	60,20%	60,00%	68,00%	90,00%	217.732.623,63
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	146.135.442,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%	365.338.605,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	73.067.721,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	68.255.223,84	9,34%	3,00%	10,00%	40,00%	224.015.660,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	50,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	292.270.884,62
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	73.067.721,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	0,01	0,00%	3,50%	4,00%	4,00%	29.227.088,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	6.530.783,00	0,89%	0,50%	1,00%	5,00%	30.003.077,58
Total Renda Fixa	100,00%	557.908.741,28	76,36%	72,00%	129,00%	279,00%	



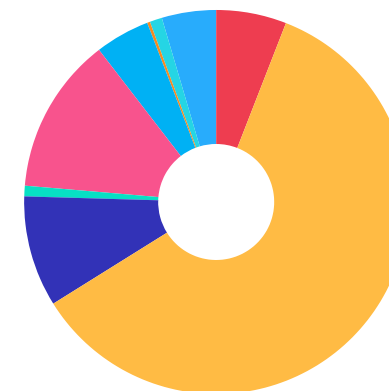
RENDA FIXA 557.908.741,28
RENDA VARIÁVEL 139.369.529,91 EXTERIOR 33.398.940,00

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!

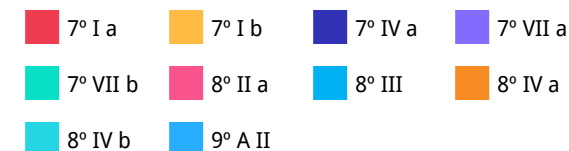


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 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%	5,00%	10,00%	73.067.721,15
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	73.067.721,15
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30,00%	96.425.347,17	13,20%	15,00%	17,00%	20,00%	49.710.095,14
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	36.533.860,58
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	33.577.147,57	4,60%	2,00%	3,00%	10,00%	39.490.573,58
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	1.767.862,80	0,24%	0,50%	1,00%	2,00%	12.845.681,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	10,00%	7.599.172,22	1,04%	1,00%	1,00%	2,00%	7.014.372,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	1,00%	7.306.772,12
Total Renda Variável	40,00%	139.369.529,76	19,07%	18,50%	38,00%	60,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 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%	2,00%	10,00%	73.067.721,15
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	33.398.940,50	4,57%	0,00%	2,00%	10,00%	39.668.780,65
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	73.067.721,15
Total Exterior	10,00%	33.398.940,50	4,57%	0,00%	6,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	208.839.516,70	28,58	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	149.170.060,44	20,42	0,04
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	133.073.042,16	18,21	0,02
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	43.245.867,67	5,92	-
AZ QUEST INVESTIMENTOS	39.428.486,33	5,40	0,14
WESTERN ASSET	31.361.886,72	4,29	0,06
GENIAL INVESTIMENTOS	29.721.671,52	4,07	0,37
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	16.921.222,36	2,32	0,23
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.494.477,19	1,98	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	12.578.341,05	1,72	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	11.741.706,90	1,61	1,26
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	9.887.252,09	1,35	0,00
ITAÚ DTVM	7.702.254,21	1,05	0,00
ARX INVESTIMENTOS	4.936.836,96	0,68	0,01
NAVI CAPITAL	4.205.246,07	0,58	0,28
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIR...	4.120.000,00	0,56	0,00
ICATU VANGUARDA	3.566.846,76	0,49	0,01
VINCI PARTNERS	2.440.413,48	0,33	0,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.215.260,85	0,30	0,03
PLURAL	532.628,56	0,07	0,01
BRZ INVESTIMENTOS	481.079,71	0,07	0,02
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	13.113,80	0,00	0,00
ÍNDIGO DTVM	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 ' a '	43.245.867,67	5,92	5,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	439.876.866,76	60,20	60,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	68.255.223,84	9,34	3,00	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	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,01	0,00	3,50	4,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	6.530.783,00	0,89	0,50	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	96.425.347,17	13,20	15,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso III	33.577.147,57	4,60	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.767.862,80	0,24	0,50	2,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	7.599.172,22	1,04	1,00	2,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	33.398.940,50	4,57	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	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
IMA-B 5 (Benchmark)	-1,24%	1,22%	-0,10%	0,49%	4,43%	10,39%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	-1,25%	1,05%	-0,15%	0,38%	4,21%	9,95%	1,98%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	-2,54%	-4,79%	-3,73%	-2,67%	1,83%	0,81%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,58%	-4,98%	-3,83%	-2,83%	1,60%	0,29%	3,59%	0,07%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-2,58%	-5,08%	-3,82%	-2,85%	1,46%	0,11%	3,57%	0,07%
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%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-3,25%	-8,00%	-5,38%	-4,35%	-0,84%	-1,70%	3,87%	0,08%

IRF-M (Benchmark)	-2,63%	-5,50%	-3,53%	-3,59%	-3,30%	0,99%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,64%	-5,68%	-3,61%	-3,73%	-3,52%	0,50%	3,02%	0,04%

CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	-0,47%	-1,15%	-0,96%	-0,63%	-0,54%	2,42%	1,13%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,60%	3,51%	1,59%	2,68%	3,96%	6,40%	0,07%	0,01%

Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	0,00%	-90,00%	-	-	-	-	-

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
---------------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,25%	1,45%	-0,05%	0,61%	4,38%	10,97%	1,89%	0,03%
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%

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,06%	17,53%	5,93%	11,19%	22,20%	40,21%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,31%	144,31%	-0,91%	148,54%	137,37%	-92,68%	0,00%	0,03%
S&P 500 (Benchmark)	6,91%	22,61%	4,78%	10,15%	40,84%	51,61%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7,66%	26,19%	6,14%	12,26%	44,14%	50,83%	5,81%	0,13%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,91%	15,77%	5,44%	10,17%	20,00%	35,22%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,87%	15,33%	5,32%	9,91%	19,45%	33,98%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-0,17%	7,41%	-0,54%	0,64%	6,98%	-	-	0,08%
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%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-6,62%	-8,04%	-15,06%	-13,66%	9,74%	2,78%	7,47%	0,20%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-8,79%	-22,73%	-21,45%	-21,51%	-9,49%	-23,21%	10,56%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	-6,74%	-13,04%	-15,02%	-12,95%	10,16%	-3,47%	-	-

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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-7,73%	-14,66%	-16,59%	-15,94%	0,29%	-12,33%	9,72%	0,19%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-13,06%	-26,38%	-26,15%	-26,03%	-15,80%	-14,66%	15,08%	0,22%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-6,80%	-15,80%	-16,70%	-15,60%	3,76%	-1,13%	13,01%	0,23%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-6,70%	-15,94%	-15,33%	-14,24%	3,85%	-9,80%	11,76%	0,22%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,96%	-17,20%	-15,67%	-16,13%	1,54%	-19,02%	12,32%	0,22%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-8,78%	-16,45%	-17,48%	-16,72%	2,99%	-6,40%	12,52%	0,23%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-10,13%	-9,55%	-14,70%	-10,43%	14,07%	2,11%	12,85%	0,25%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,83%	-9,62%	-12,52%	-11,89%	-	-	11,38%	-
CDI (Benchmark)	0,48%	3,00%	1,35%	2,29%	3,32%	6,65%	-	-
MAG FI MULTIMERCADO	0,32%	0,82%	1,03%	2,24%	2,81%	4,17%	0,25%	0,02%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,98%	16,65%	5,69%	10,68%	21,10%	37,70%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉGIA	0,01%	62,99%	-0,14%	63,69%	58,51%	28,04%	0,09%	0,63%
IFIX (Benchmark)	-1,47%	-6,78%	-5,26%	-6,48%	-3,29%	-4,17%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	-8,90%	-24,25%	-17,02%	-21,34%	-22,29%	-27,31%	6,28%	0,13%
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	-1,37%	-12,14%	-6,88%	-10,61%	-10,57%	-21,10%	9,23%	0,11%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	-0,51%	-32,01%	-8,85%	-28,72%	-33,55%	-40,89%	8,37%	0,18%

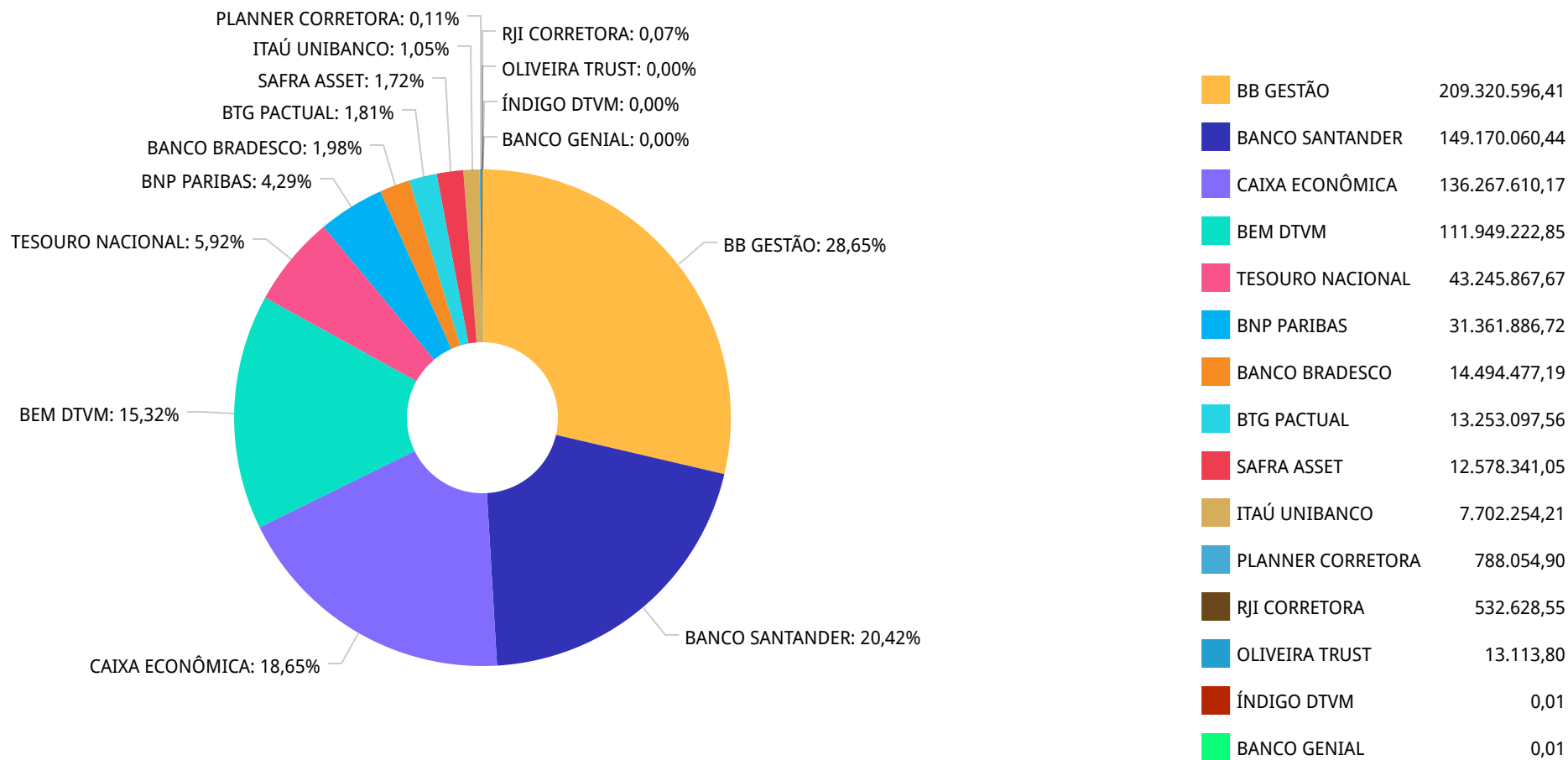
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-8,49%	-15,95%	-15,00%	-15,99%	0,74%	-9,31%	11,29%	0,22%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	-7,36%	-26,82%	-14,56%	-20,88%	-22,06%	-13,83%	5,74%	0,15%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RBDS11	-38,38%	-62,03%	-53,71%	-56,66%	-65,42%	-86,00%	74,16%	0,51%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-11,96%	-3,76%	133,92%	-13,64%	-36,93%	-	-

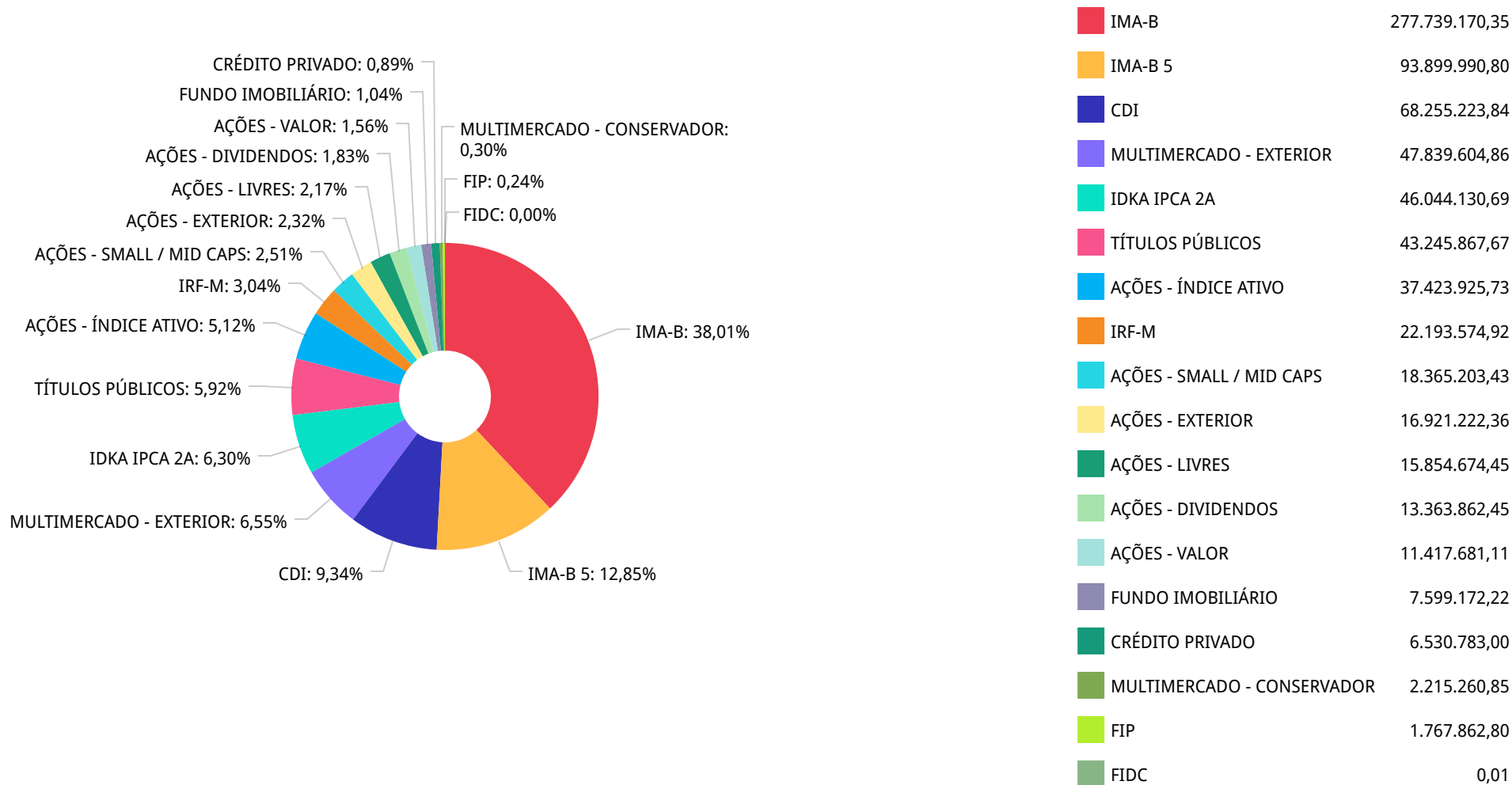
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	6,76%	28,29%	10,09%	9,85%	40,86%	107,47%	11,60%	0,14%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	7,56%	29,42%	11,33%	12,03%	36,11%	-	10,60%	0,12%

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



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



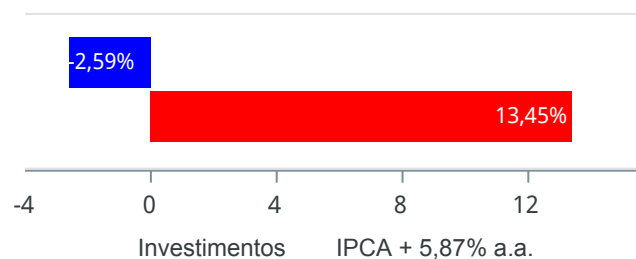
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	02/07/2004	3.100	2.696,277829	9.401,275583	8.358.461,27	29.143.954,31	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/01/2031	07/12/2004	1.500	2.874,269396	9.401,275583	4.311.404,09	14.101.913,37	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

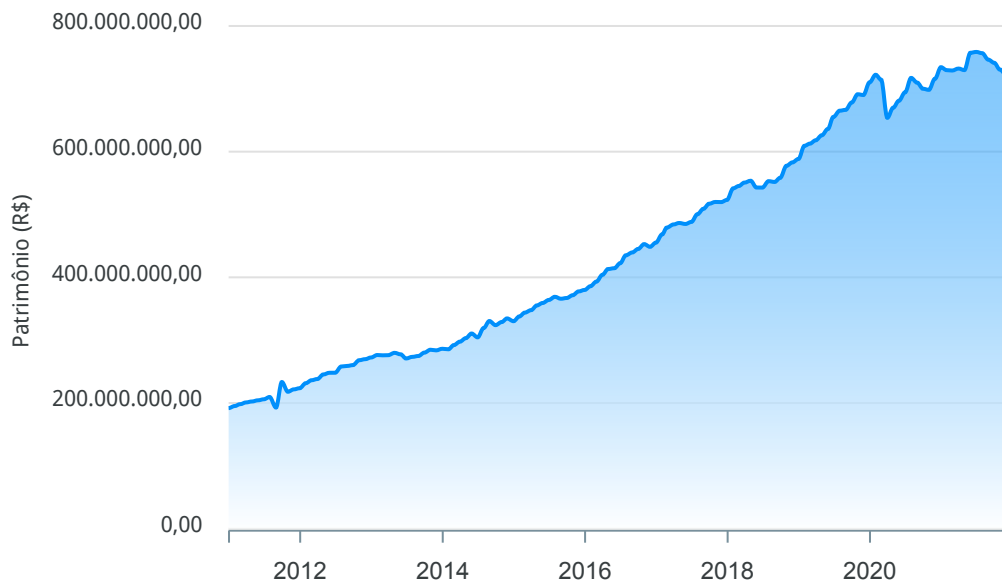
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	734.411.528,43	1.350.000,00	4.023.566,02	729.736.088,66	-2.001.873,75	-2.001.873,75	-0,27%	-0,27%	0,70%	0,70%	-38,67%	3,45%
Fevereiro	729.736.088,66	9.600.000,00	4.837.718,15	729.130.181,14	-5.368.189,37	-7.370.063,12	-0,73%	-1,00%	1,27%	1,99%	-50,44%	3,29%
Março	729.130.181,14	6.100.000,00	4.995.577,55	732.234.124,97	1.999.521,38	-5.370.541,74	0,27%	-0,73%	1,46%	3,47%	-21,04%	3,88%
Abril	732.234.124,97	53.790.000,00	65.911.107,61	729.829.849,94	9.716.832,58	4.346.290,84	1,33%	0,59%	0,77%	4,26%	13,77%	2,65%
Mai	729.829.849,94	20.779.000,00	5.088.622,18	757.393.518,54	11.873.290,78	16.219.581,62	1,59%	2,19%	1,31%	5,63%	38,88%	3,02%
Junho	757.393.518,54	7.050.000,00	6.223.122,37	758.708.375,88	487.979,71	16.707.561,33	0,06%	2,25%	1,01%	6,70%	33,68%	2,66%
Julho	758.708.375,88	108.230.000,00	106.321.230,09	756.771.175,29	-3.845.970,50	12.861.590,83	-0,51%	1,74%	1,46%	8,26%	21,04%	3,25%
Agosto	756.771.175,29	27.081.000,00	25.001.431,79	746.367.700,53	-12.483.042,97	378.547,86	-1,64%	0,06%	1,37%	9,74%	0,66%	3,69%
Setembro	746.367.700,53	7.422.000,00	5.415.983,99	741.382.834,01	-6.990.882,53	-6.612.334,67	-0,93%	-0,87%	1,64%	11,55%	-7,54%	3,46%
Outubro	741.382.834,01	37.800.000,00	35.585.719,85	730.677.211,54	-12.919.902,62	-19.532.237,29	-1,74%	-2,59%	1,71%	13,45%	-19,27%	4,41%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



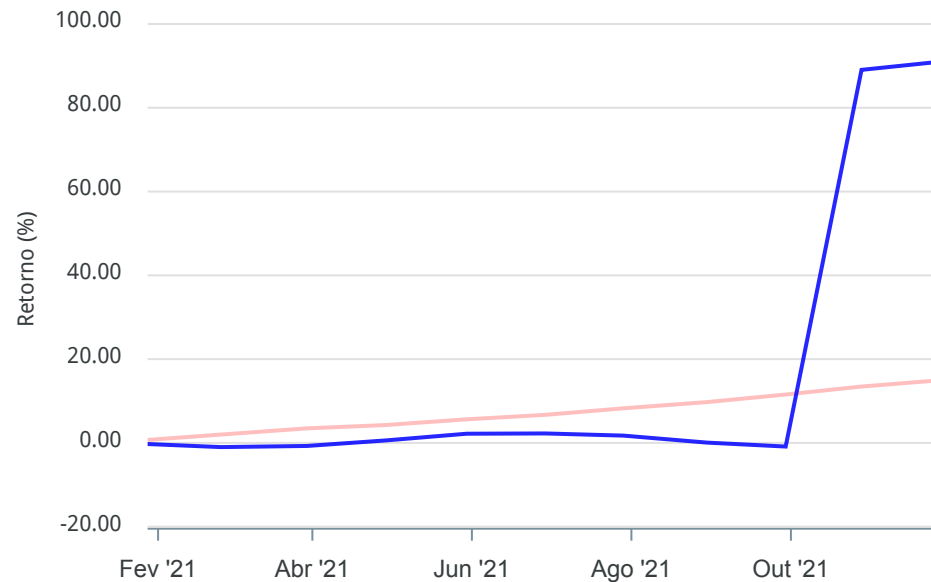
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	42.893.037,34	0,00	0,00	43.245.867,67	352.830,33	0,82%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	30.366.218,05	0,00	30.539.555,57	0,00	173.337,52	0,57%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	22.045.957,55	37.800.000,00	4.750.000,00	55.270.069,64	174.112,09	0,29%	0,60%	0,07%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	13.045.864,83	0,00	0,00	12.985.154,20	-60.710,63	-0,47%	-0,47%	1,13%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	95.088.589,38	0,00	0,00	93.899.990,80	-1.188.598,58	-1,25%	-1,25%	1,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	46.628.270,62	0,00	0,00	46.044.130,69	-584.139,93	-1,25%	-1,25%	1,89%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	6.623.351,00	0,00	0,00	6.530.783,00	-92.568,00	-1,40%	-1,40%	2,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	107.091.993,97	0,00	0,00	104.348.684,24	-2.743.309,73	-2,56%	-2,56%	3,57%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	14.878.494,87	0,00	0,00	14.494.477,19	-384.017,68	-2,58%	-2,58%	3,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	150.196.039,23	0,00	0,00	146.317.667,87	-3.878.371,36	-2,58%	-2,58%	3,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	22.795.547,76	0,00	0,00	22.193.574,92	-601.972,84	-2,64%	-2,64%	3,02%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	13.001.245,25	0,00	0,00	12.578.341,05	-422.904,20	-3,25%	-3,25%	3,87%
Total Renda Fixa	564.654.609,86	37.800.000,00	35.289.555,57	557.908.741,28	-9.256.313,01	-1,63%		2,67%

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	29.130.892,67	0,00	0,00	31.361.886,72	2.230.994,05	7,66%	7,66%	5,81%
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	4.141.000,00	0,00	53.676,43	4.120.000,00	32.676,43	0,79%	-0,51%	8,37%
MAG FI MULTIMERCADO	2.208.234,07	0,00	0,00	2.215.260,85	7.026,78	0,32%	0,32%	0,25%
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	481.013,31	0,00	0,00	481.079,71	66,40	0,01%	0,01%	0,09%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	755.458,42	0,00	0,00	754.154,53	-1.303,89	-0,17%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	534.261,95	0,00	0,00	532.628,55	-1.633,40	-0,31%	-0,31%	0,00%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.027.973,59	0,00	226.294,69	788.054,90	-13.624,00	-1,33%	0,00%	-
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	374.880,00	0,00	0,00	369.732,00	-5.148,00	-1,37%	-1,37%	9,23%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.065.308,48	0,00	0,00	1.976.384,37	-88.924,11	-4,31%	-4,31%	11,59%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	19.666.082,18	0,00	0,00	18.365.203,43	-1.300.878,75	-6,61%	-6,61%	7,47%
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	807.400,00	0,00	5.500,00	748.000,00	-53.900,00	-6,68%	-7,36%	5,74%
GERAÇÃO FI AÇÕES	31.855.804,58	0,00	0,00	29.721.671,52	-2.134.133,06	-6,70%	-6,70%	11,76%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	497.901,52	0,00	0,00	464.029,11	-33.872,41	-6,80%	-6,80%	13,01%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.298.580,20	0,00	0,00	4.936.836,96	-361.743,24	-6,83%	-6,83%	11,38%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.833.814,30	0,00	0,00	3.566.846,76	-266.967,54	-6,96%	-6,96%	12,32%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.755.046,55	0,00	0,00	8.078.128,70	-676.917,85	-7,73%	-7,73%	9,72%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	1.715.322,34	0,00	10.693,16	1.560.271,52	-144.357,66	-8,42%	-8,90%	6,28%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3.151.475,99	0,00	0,00	2.883.794,36	-267.681,63	-8,49%	-8,49%	11,29%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8.443.971,67	0,00	0,00	7.702.254,21	-741.717,46	-8,78%	-8,78%	12,52%

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
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	12.009.693,07	0,00	0,00	10.953.652,00	-1.056.041,07	-8,79%	-8,79%	10,56%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.679.168,23	0,00	0,00	4.205.246,07	-473.922,16	-10,13%	-10,13%	12,85%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.107.755,86	0,00	0,00	3.571.299,68	-536.456,18	-13,06%	-13,06%	15,08%
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII - RB...	21.280,00	0,00	0,00	13.113,80	-8.166,20	-38,38%	-38,38%	74,16%
Total Renda Variável	145.562.318,99	0,00	296.164,28	139.369.529,76	-5.896.624,95	-4,05%		9,31%

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
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	15.731.704,23	0,00	0,00	16.921.222,36	1.189.518,13	7,56%	7,56%	10,60%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	15.434.200,93	0,00	0,00	16.477.718,14	1.043.517,21	6,76%	6,76%	11,60%
Total Exterior	31.165.905,16	0,00	0,00	33.398.940,50	2.233.035,34	7,16%		11,09%

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.