



**Ata da 186ª Reunião Ordinária do Comitê de Investimentos da TABOÃO PREV –  
Quadrênio 2017/2021.**

Aos vinte e cinco dias do mês de Novembro de dois mil e vinte e um, às nove horas, na sede da Taboãoprev, se reuniram os membros do Comitê de Investimentos: **Edinaldo da Silva Leite** – representante do Poder Legislativo, **Maria Carmen Fernandez Ruiz** – representante eleita dos aposentados, **Ricardo Teodoro Silva de Souza** – Conselheiro Eleito Servidores Ativos, **Eliana Bendini Lantyer** – Superintendente Autárquica, **Thaysa Pinheiro Monteiro** – Diretora Administrativa e Financeira. Aberta a reunião, pela Superintendente Sra. Eliana Bendini Lantyer, com o quórum legal, a Superintendente convidou a mim Daniel César para participar da reunião e convidou a Conselheira Maria Carmen Fernandez Ruiz para secretariar a reunião. Apresentamos aos conselheiros a pauta do dia: 1º Aprovação da Ata da reunião anterior; 2º Avaliação da Carteira de Investimentos da Taboãoprev no mês de Outubro de 2021; 3º Aprovação das contas de Outubro de 2021 e Evolução dos Investimentos e Rentabilidade Acumulada até Outubro de 2021; 4º Aprovar e referendar os investimentos apresentados no Relatório Analítico dos Investimentos Base: Outubro/2021; 5º Acompanhamento da Evolução da execução do orçamento da Taboãoprev; 6º Certificação do Pró-Gestão RPPS; 7º Novos Investimentos; 9º Política de Investimentos para 2022; 10ª Outros Assuntos. De acordo com a pauta, ficou deliberado o que segue: **1º APROVAÇÃO DA ATA DA REUNIÃO ANTERIOR:** Foi feita a leitura da ata da reunião anterior, foi perguntado se alguém tinha algum adendo a fazer, não havendo nada a acrescentar, a referida ata foi aprovada por todos os presentes; **2º AVALIAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA TABOÃO PREV: SETEMBRO/2021:**

Sub-segmento	Valor	%	Característica
TÍTULOS PÚBLICOS	43.245.867,67	5,92%	TÍTULOS PÚBLICOS - R\$ 43.245.867,67
IMA-B	277.739.170,35	38,01%	
FIDC	0,01	0,00%	LONGO PRAZO - R\$ 284.269.953,36
CRÉDITO PRIVADO	6.530.783,00	0,89%	
IRF-M	22.193.574,92	3,04%	
IDKA IPCA 2A	46.044.130,69	6,30%	MÉDIO PRAZO - R\$ 162.137.696,41
IMA-B 5	93.899.990,80	12,85%	
CDI	68.255.223,84	9,34%	CURTO PRAZO - R\$ 68.255.223,84
AÇÕES - DIVIDENDOS	13.363.862,45	1,83%	
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	18.365.203,43	2,51%	AÇÕES - R\$ 96.425.347,17
AÇÕES - VALOR	11.417.681,11	1,56%	



**TABOÃOPREV**  
**Autarquia Previdenciária**  
Município de Taboão da Serra  
Estado de São Paulo



AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	37.423.925,73	5,12%	
AÇÕES - LIVRES	15.854.674,45	2,17%	
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.215.260,85	0,30%	MULTIMERCADO - R\$ 2.215.260,85
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.599.172,22	1,04%	FUNDO IMOBILIÁRIO - R\$ 7.599.172,22
FIP	1.767.862,80	0,24%	FIP - R\$ 1.767.862,80
MULTIMERCADO - EXTERIOR	47.839.604,86	6,55%	
			EXTERIOR - R\$ 64.760.827,22
AÇÕES - EXTERIOR	16.921.222,36	2,32%	

Os membros do Comitê de Investimentos acompanharam a Carteira de Investimentos da Taboãoprev e concluíram que os investimentos estão abrangendo os vértices de Longo, Médio e Curto Prazo, e observaram que as recomendações de investimentos têm sido seguidas com a devida cautela, respeitando os limites da política de investimento e as exigências das Resoluções nº 3.922/10 e 4.392/14. Os membros do Comitê de Investimentos também analisaram a rentabilidade mensal em percentual de todos os investimentos em Renda Fixa, Renda Variável e no Exterior da Taboãoprev até o mês de Outubro/2021, a Taboãoprev apresentou uma rentabilidade negativa, atingindo -1,74% de rentabilidade, sendo que a meta foi de 1,71%; no acumulado do ano a Taboãoprev apresenta uma rentabilidade acumulada de -2,59%, esse desempenho deve-se aos seguintes fatores: alta volatilidade no cenário econômico, o **Ibovespa** fechou em queda no último pregão de **outubro**, refletindo o imbróglio sobre o aumento dos combustíveis e incertezas fiscais. Desse modo, o índice geral registrou o pior patamar de **fechamento de 2021** e a maior baixa mensal, de 6,7%. Para o IPCA (Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo), a projeção subiu de 9,17% para 9,33% em 2021. Para 2022, a previsão para o IPCA subiu de 4,55% para 4,63%, contribuindo para entendimento de que a taxa Selic, deve ser ajustada para cima nos próximos períodos, tendo em vista, também, a crise hídrica, tema que segue tendo um papel importante para a elevação dos preços, instabilidade nos mercados financeiros ainda sob reflexo da pandemia e demora na recuperação econômica e produtiva do país. **3º Aprovação das contas de Outubro de 2021 e Evolução dos Investimentos e Rentabilidade Acumulada até Outubro de 2021:** o Sr. Daniel César tomou a palavra e explicou aos conselheiros que até a presente data a Prefeitura Municipal de Taboão da Serra está em dia com o repasse da contribuição dos Servidores e Patronal. Os acordos de parcelamento, em especial o ACORDO DE PARCELAMENTO nº 513/2021, estão sendo pagos em dia. Na sequência foi explicado aos conselheiros o Demonstrativo de Receita, Despesas e saldo, constatou-se saldo financeiro no valor de **R\$ 732.148.954,17** (Setecentos e Trinta e Dois Milhões, Cento e Quarenta e Oito Mil,



Novocentos e Cinquenta e Quatro Reais e Dezessete Centavos), referentes à prestação de contas/saldo financeiro do mês de Outubro de 2021, que foi apreciada pelos conselheiros, o Comitê também apreciou a Evolução dos Investimentos e a Rentabilidade Acumulada das Aplicações que totalizam **R\$ 730.677.211,54** (Setecentos e Trinta Milhões, Seiscentos e Setenta e Sete Mil, Duzentos e Onze Reais e Cinquenta e Quatro Centavos), distribuídos em Renda Fixa R\$ 557.908.741,28, Renda Variável R\$ 139.369.529,76 e Investimentos no Exterior R\$ 33.398.940,50, apresentando uma rentabilidade negativa de **(R\$ 12.919.902,62)** equivalendo a um retorno de -1,74% no mês, sendo que a meta atuarial acumulada no ano está em 13,45% a.a. e a rentabilidade acumulada da Taboãoprev está em -2,59% a.a., ou seja, **a Taboãoprev está 16,04% abaixo da meta atuarial.** De acordo com as Resoluções nº 3.922/10 e 4.392/14 que dispõe sobre as aplicações dos recursos dos Regimes Próprios de Previdência Social, foi constatado que as aplicações estão sendo feitas de acordo com a legislação, portanto, os membros do Comitê de Investimentos consideraram aprovadas as contas e os investimentos referentes ao mês de Outubro de 2021, e juntamente com o Conselho Fiscal e com o Conselho Municipal de Previdência, estarão acompanhando com atenção os investimentos. **4º Aprovar e referendar os investimentos apresentados no Relatório Analítico dos Investimentos Base: Outubro/2021:** Os conselheiros analisaram o relatório analítico dos investimentos que reflete o que é apresentado mensalmente ao conselho em relação aos investimentos da Taboãoprev, os membros do Comitê de Investimentos aprovaram os investimentos por estarem de acordo com a Política de Investimentos de 2021 e de acordo com a legislação vigente. **5º Acompanhamento da Evolução da execução do orçamento da Taboãoprev:** Como forma de acompanhar o correto andamento da Gestão Previdenciária, os conselheiros analisaram a “Evolução da Execução do Orçamento” de 2021 da Taboãoprev. Foram analisadas as RECEITAS ORÇAMENTÁRIAS, sendo as principais: Contribuições (*do ente, servidores, aposentados e pensionistas, Parcelamentos devidos pelo ente*, Rendimentos das aplicações financeiras e investimentos patrimoniais e Recursos da compensação financeira previdenciária COMPREV (*tem por finalidade ressarcir o regime instituidor do benefício (RPPS) dos valores recolhidos ao regime de origem do segurado (RGPS)*). Também foram analisadas as DESPESAS ORÇAMENTÁRIAS, sendo as principais: Pagamento de Aposentados e Pensionistas, Despesas da compensação financeira previdenciária COMPREV (*tem por finalidade ressarcir regime instituidor do benefício (RGPS) dos valores recolhidos ao regime de origem do*



**TABOÃOPREV**  
**Autarquia Previdenciária**  
Município de Taboão da Serra  
Estado de São Paulo



segurado (RPPS)) e Despesas relacionadas à Taxa de Administração da Autarquia (destinada exclusivamente ao custeio das despesas correntes e de capital necessárias à organização e ao funcionamento da Unidade Gestora do RPPS, inclusive para a conservação do seu patrimônio). A seguir apresentamos o quadro resumido da execução orçamentária:

Receitas	R\$	Despesas	R\$
Valor Previsto	91.331.500	Fixado Final	93.987.500
Transferências Financeiras	2.656.000		
Valor Arrecadado	77.164.887	Realizado	51.957.552
Percentual Arrecadado sobre o Previsto	82,10%	Percentual Realizado sobre o Fixado	55,28%

**Superáviz Orçamentário de R\$ 25.207.335,00 (Valor Arrecado das Receitas - Valor Realizado das Despesas)**

Conforme o quadro resumo, até a presente data, cerca de 82,10% das Receitas Previstas já foram arrecadadas e cerca de 55,28% das Despesas Fixadas já foram realizadas pela autarquia. Em relação às receitas, as Contribuições Previdenciárias dos servidores e dos entes tem sido repassadas sem atrasos, os parcelamentos têm sido pagos em dia e sem atrasos, a autarquia tem recebido o COMPREV de acordo com o cronograma da Secretaria de Previdência e os rendimentos das aplicações financeiras ainda estão positivos. Em relação às Despesas, a autarquia tem percebido uma pequena elevação nos pagamentos de aposentados e pensionistas, devido ao aumento nos pedidos de aposentadoria, assim como aumento de falecimentos de beneficiários, os pagamentos do COMPREV estão em ordem, de acordo com o cronograma da Secretaria de Previdência, em relação as despesas relacionadas a Taxa de Administração, até a presente data, todas encontram-se equilibradas e sem aumentos. **6º Certificação do Pró-Gestão RPPS:** Conforme informado na última reunião, no dia 08/10/2021 a Fundação Vanzolini encaminhou um Draft da certificação para conferência da Taboãoprev, após as correções necessárias, em 20/10/2021 a Fundação Vanzolini encaminhou a certificação do Pró-Gestão RPPS no Nível II, portanto a Taboãoprev volta a ter o perfil de Investidor Qualificado. **7º Novos investimentos:** analisando os fundos de investimentos da carteira da Taboãoprev, podemos constatar que alguns fundos têm apresentados baixa rentabilidade, portanto o Comitê de Investimentos fez as seguintes análises:



**TABOÃOPREV**  
*Autarquia Previdenciária*  
Município de Taboão da Serra  
Estado de São Paulo



Com base na situação econômica do país a Consultoria Financeira – Crédito e Mercado sugere as seguintes exposições:

Característica	% Taboãoprev	Sugestão Crédito e Mercado
RENDA FIXA	76,35%	60%
TÍTULOS PÚBLICOS	5,92%	10%
LONGO PRAZO	38,90%	5%
MÉDIO PRAZO	22,19%	20%
CURTO PRAZO	9,34%	5%
GESTÃO DURATION	0%	20%
RENDA VARIÁVEL	21,32%	30%
AÇÕES	13,19%	20%
MULTIMERCADO	6,85%	5%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1,04%	2,5%
FIP	0,24%	2,5%
EXTERIOR	2,32%	10%
EXTERIOR COM HEDGE	2,32%	5%
EXTERIOR SEM HEDGE	0%	5%

Com base nas sugestões da Consultoria Financeira e de outros agentes financeiros que visitaram a Taboãoprev durante o mês de outubro/21 ou enviaram análises econômicas para a autarquia, devemos:

- REDUZIR nossos investimentos em RENDA FIXA;



- AUMENTAR nossos investimentos em RENDA VARIÁVEL; e
- AUMENTAR nossos investimentos no EXTERIO.<sup>R</sup>

Partindo dessas premissas, o Comitê de Investimentos recomenda as seguintes movimentações:

1 – ZERAR os investimentos em IRF-M, atualmente temos R\$ 22.193.574,92 investidos no Fundo CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP - CNPJ: 14.508.605/0001-00. A Diferença deverá ser retirada do CDI, ambos os fundos D+0. Esse valor poderá ser direcionado para:

VALOR	FUNDO	ARTIGO DA RESOLUÇÃO
R\$ 10.000.000,00	CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	9º, II, A
R\$ 10.000.000,00	AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES (TP)	8º, II, A
R\$ 10.000.000,00	SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	8º, III

2 – REDUZIR +/- em R\$ 40.000.000,00 os investimentos em IDKA-2, atualmente temos R\$ 46.716.384,73 investidos no Fundo BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC - CNPJ: 13.322.205/0001-35, D+1. A Diferença deverá ser retirada do fundo BB IMA-B que encontra-se com o PL desenquadrado. Esse valor poderá ser direcionado para:

VALOR	FUNDO	ARTIGO DA RESOLUÇÃO
R\$ 20.000.000,00	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO (TP)	8º, III
R\$ 10.000.000,00	BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9º, III, A
R\$ 10.000.000,00	SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	9º, II, A

3 – MIGRAR os investimentos no Fundo ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES D+5 para o Fundo: NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES, os dois fundos fazem parte da nossa carteira. **Valor da Migração R\$ 7.795.325,56**

4 – MIGRAR os investimentos no Fundo CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES D+23 para o Fundo: QUELUZ VALOR FI AÇÕES, os dois fundos fazem parte da nossa carteira. **Valor da Migração R\$ 478.403,23**



5 – MIGRAR os investimentos no Fundo BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES **D+3** para o Fundo: CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES, os dois fundos fazem parte da nossa carteira. **Valor da Migração R\$ 2.873.137,02.**

Os NOVOS FUNDOS já foram analisados e aprovados pela a Consultoria Financeira. Os novos recursos recebidos pela Taboãoprev, enquanto o Comitê analisa novas opções de investimentos, deverão continuar a ser direcionados para ativos com maior rentabilidade e indexados ao CDI, IRF-M, IMA-B, ou Renda Fixa. **9º Política de Investimentos para 2022:** Os conselheiros do Conselho Municipal de Previdência, juntamente com os membros do Comitê de Investimentos, que já haviam analisados previamente a proposta da Política de Investimentos para 2022, discutiram em conjunto e aprovaram a Política de Investimentos para 2022, de acordo com as alterações da Resolução 4.604 e conforme a Alocação Estratégica para 2022, sendo que a mesma foi devidamente assinada pelos conselheiros e ficará fazendo parte integrante da presente ata. Na aplicação dos recursos, os membros do Comitê de Investimentos e do Conselho Municipal de Previdência, responsáveis pela gestão do RPPS, observaram os limites estabelecidos pela Resolução CMN nº 3.922/2010 e fixaram os limites de alocação. A estratégia de alocação levou em consideração não somente o cenário macroeconômico como também as especificidades da estratégia definida pelo resultado da análise do fluxo de caixa atuarial e as projeções futuras de déficit e/ou superávit da Taboãoprev. Os Membros do Conselho Fiscal estão de acordo com a Política de Investimentos, conforme segue:

**Alocação Estratégica para o exercício de 2022**

Segmento	Tipo de Ativo	Limite da Resolução CMN %	Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2022		
			Limite Inferior (%)	Estratégia Alvo (%)	Limite Superior (%)
Renda Fixa	7º I a - Títulos do Tesouro Nacional SELIC	100,00%	13,45%	19,00%	60,00%
	7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	15,00%	19,00%	60,00%
	7º I c - FI Ref em Índice de RF, 100% TP	100,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	7º II - Oper. compromissadas em TP TN	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	7º III b - FI de Índices Referenciado RF	60,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	20,00%	30,00%	40,00%
	7º IV b - FI de Índices Renda Fixa	40,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	7º V b - Letras Imobiliárias Garantidas	20,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	7º VI a - Certificados de Dep. Bancários	15,00%	0,00%	0,00%	0,00%



**TABOÃO PREV**  
*Autarquia Previdenciária*  
Município de Taboão da Serra  
Estado de São Paulo



	7º VI b - Poupança	15,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	7º VII a - FI em Direitos Creditórios - sênior	5,00%	0,00%	1,00%	3,00%
	7º VII b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"	5,00%	0,50%	1,00%	5,00%
	7º VII c - FI de Debêntures Infraestrutura	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	<b>Limite de Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>48,95%</b>	<b>70,00%</b>	<b>168,00%</b>
<b>Renda Variável</b>	8º I a - FI Ref em Renda Variável	30,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	8º I b - FI de Índices Ref Renda Variável	30,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	8º II a - FI em Ações	20,00%	13,00%	14,00%	20,00%
	8º II b - FI em Índices de Ações	20,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	Art. 8º, III - FI Multimercado	10,00%	4,00%	4,60%	10,00%
	8º IV a - FI em Participações	5,00%	0,25%	0,50%	1,00%
	8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	0,00%	0,90%	1,00%
	8º IV c - Ações - Mercado de Acesso	5,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Limite de Renda Variável - Art. 8º, § 1º</b>	<b>30,00%</b>	<b>17,25%</b>	<b>20,00%</b>	<b>32,00%</b>	
<b>Exterior</b>	9º A I - Renda Fixa - Dívida Externa	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%
	9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,75%	5,00%	5,00%
	9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,75%	5,00%	5,00%
	<b>Limite de Investimentos no Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>7,50%</b>	<b>10,00%</b>	<b>10,00%</b>
<b>Total da Carteira de Investimentos</b>			<b>73,70%</b>	<b>100,00%</b>	<b>210,00%</b>

**Alocação Estratégica para os próximos 5 anos**

Segmento	Tipo de Ativo	Limite da Resolução CMN %	Estratégia de Alocação - Política de Investimento de 2022	
			Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
<b>Renda Fixa</b>	7º I a - Títulos do Tesouro Nacional SELIC	100,00%	13,45%	60,00%
	7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	15,00%	60,00%
	7º I c - FI Ref em Índice de RF, 100% TP	100,00%	0,00%	0,00%
	7º II - Oper. compromissadas em títulos TN	5,00%	0,00%	0,00%
	7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	0,00%	0,00%
	7º III b - FI de Índices Referenciado RF	60,00%	0,00%	0,00%
	7º IV a - FI de Renda Fixa	40,00%	20,00%	40,00%
	7º IV b - FI de Índices Renda Fixa	40,00%	0,00%	0,00%
	7º V b - Letras Imobiliárias Garantidas	20,00%	0,00%	0,00%





# TABOÃO PREV

## Autarquia Previdenciária

Município de Taboão da Serra  
Estado de São Paulo



	7º VI a - Certificados de Dep. Bancários	15,00%	0,00%	0,00%
	7º VI b - Poupança	15,00%	0,00%	0,00%
	7º VII a - FI em Direitos Creditórios - sênior	5,00%	0,00%	3,00%
	7º VII b - FI Renda Fixa "Crédito Privado"	5,00%	0,50%	5,00%
	7º VII c - FI de Debêntures Infraestrutura	5,00%	0,00%	0,00%
	<b>Limite de Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>48,95%</b>	<b>168,00%</b>

<b>Renda Variável</b>	8º I a - FI Referenciados em Renda Variável	30,00%	0,00%	0,00%
	8º I b - FI de Índices Ref em Renda Variável	30,00%	0,00%	0,00%
	8º II a - FI em Ações	20,00%	13,00%	20,00%
	8º II b - FI em Índices de Ações	20,00%	0,00%	0,00%
	FI Multimercado - Aberto - Art. 8º, III	10,00%	4,00%	10,00%
	8º IV a - FI em Participações	5,00%	0,25%	1,00%
	8º IV b - FI Imobiliário	5,00%	0,00%	1,00%
	8º IV c - Ações - Mercado de Acesso	5,00%	0,00%	0,00%
	<b>Limite de Renda Variável - Art. 8º, § 1º</b>	<b>30,00%</b>	<b>17,25%</b>	<b>32,00%</b>

<b>Exterior</b>	9º A I - Renda Fixa - Dívida Externa	10,00%	0,00%	0,00%
	9º A II - Constituídos no Brasil	10,00%	3,75%	5,00%
	9º A III - Ações - BDR Nível I	10,00%	3,75%	5,00%
	<b>Limite de Investimentos no Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>7,50%</b>	<b>10,00%</b>

Nada mais havendo a tratar, deu por encerrada a reunião às doze horas, na qual foi lavrada e assinada por mim Maria Carmen Fernandez Ruiz, e por todos os presentes.

**Edinaldo da Silva Leite**  
Conselheiro

**Maria Carmen Fernandez Ruiz**  
Conselheira

**Ricardo Teodoro Silva de Souza**  
Conselheiro



**TABOÃO PREV**  
**Autarquia Previdenciária**  
Município de Taboão da Serra  
Estado de São Paulo



---



---


**Eliana Bendini Lantyer**  
Superintendente Autárquica

---



---

**Thaysa Pinheiro Monteiro**  
Diretora Administrativa e Financeira



---

**Daniel César**  
Diretor de Previdência



# TABOÃO PREV

Autarquia Previdenciária



## Rentabilidade acumulada das aplicações – Base Outubro/2021

<b>RENDA FIXA</b>			
<b>Rentabilidade dos Ativos</b>	<b>No Ano</b>	<b>No Mês</b>	<b>SALDO</b>
TÍTULOS PÚBLICOS	14,72%	0,82%	43.245.867,67
<b>META ATUARIAL (IPCA+5,87% a.a.)</b>	<b>13,45%</b>	<b>1,71%</b>	
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIX...	3,51%	0,60%	55.270.069,64
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREV...	1,45%	-1,25%	46.044.130,69
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,08%	-1,25%	93.899.990,80
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIA...	0,00%	0,00%	0,01
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	-0,48%	-1,40%	6.530.783,00
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	-1,15%	-0,47%	12.985.154,20
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	-4,98%	-2,58%	146.317.667,87
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	-5,00%	-2,56%	104.348.684,24
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS...	-5,08%	-2,58%	14.494.477,19
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	-5,68%	-2,64%	22.193.574,92
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-7,99%	-3,25%	12.578.341,05

<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>			
<b>Rentabilidade dos Ativos</b>	<b>No Ano</b>	<b>No Mês</b>	<b>SALDO</b>
<b>META ATUARIAL (IPCA+5,87% a.a.)</b>	<b>13,45%</b>	<b>1,71%</b>	
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVES...	12,82%	7,56%	16.921.222,36
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTER...	9,85%	6,76%	16.477.718,14



# TABOÃOPREV

Autarquia Previdenciária



## Rentabilidade acumulada das aplicações – Base Outubro/2021

<b>RENDA VARIÁVEL</b>			
<b>Rentabilidade dos Ativos</b>	<b>No Ano</b>	<b>No Mês</b>	<b>SALDO</b>
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	144,31%	-0,31%	532.628,55
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIES...	64,86%	0,01%	481.079,71
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	26,10%	7,66%	31.361.886,72
<b>META ATUARIAL (IPCA+5,87% a.a.)</b>	<b>13,45%</b>	<b>1,71%</b>	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	7,41%	-0,17%	754.154,53
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	4,61%	-1,33%	788.054,90
MAG FI MULTIMERCADO	0,82%	0,32%	2.215.260,85
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,00%	0,00%	0,01
BTG PACTUAL FUNDO DE CRI FII - FEXC11	-5,39%	-1,37%	369.732,00
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-7,50%	-6,61%	18.365.203,43
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-9,55%	-10,13%	4.205.246,07
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-9,62%	-6,83%	4.936.836,96
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC ...	-11,26%	-4,31%	1.976.384,37
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-14,66%	-7,73%	8.078.128,70
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-15,80%	-6,80%	464.029,11
GERAÇÃO FI AÇÕES	-15,93%	-6,70%	29.721.671,52
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-15,95%	-8,49%	2.883.794,36
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-16,45%	-8,78%	7.702.254,21
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-17,20%	-6,96%	3.566.846,76
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR1...	-19,85%	-8,42%	1.560.271,52
BTG PACTUAL FUNDO DE FUNDOS FII - BCFF11	-22,06%	-6,68%	748.000,00
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-22,73%	-8,79%	10.953.652,00
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-26,38%	-13,06%	3.571.299,68
PARQUE DOM PEDRO SHOPPING CENTER FII - PQDP11	-29,12%	0,79%	4.120.000,00
RB CAPITAL DESENVOLVIMENTO RESIDENCIAL II FII...	-57,84%	-38,38%	13.113,80

Taboãoprev – Autarquia Previdenciária do Município de Taboão da Serra

Rua Mario Latorre, 130 – Parque Pinheiros – CEP 06767-230 – Taboão da Serra – SP

Tels: (11) 4787-6029 / 4135-4977 / 4701-6344

www.taboaoprev.com.br



# TABOÃO PREV

## Autarquia Previdenciária



### Resolução nº 3.922/2010, 4.392/2014 e a Política de Investimentos de 2021

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!

### Base Outubro/2021

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação Limite - 2021			GAP*
	%	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
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 IV, Alínea 'a'	50,00%	68.255.223,84	9,34%	3,00%	10,00%	40,00%	224.015.660,78
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%	
Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP*
	%	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
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 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
Total Renda Variável	40,00%	139.369.529,76	19,07%	18,50%	38,00%	60,00%	
Artigos - Exterior	Resolução	Carteira	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP*
	%	\$	%	Inferior	Alvo	Superior	Superior
				%	%	%	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0	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	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%	

\*O GAP indica o valor que a Taboãoprev ainda pode investir em cada artigo das Resoluções nº 3.922/10 e 4.392/14.

Artigo 7º, Inciso I, Alínea A - Até 100% (cem por cento) em títulos de emissão do Tesouro Nacional, registrados no Sistema Especial de Liquidação e Custódia SELIC.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B - Até 100% (cem por cento) cotas de fundos de investimento, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos prevejam que suas respectivas carteiras sejam representadas exclusivamente pelos títulos definidos na alínea 'a' deste inciso e cuja política de investimento assuma o compromisso de buscar o retorno de um dos subíndices do Índice de Mercado Anbima (IMA) ou do Índice de Duração Constante Anbima (IDkA), com exceção de qualquer subíndice atrelado à taxa de juros de um dia.
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea A - Até 30% (trinta por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa ou como referenciados em indicadores de desempenho de renda fixa, constituídos sob a forma de condomínio aberto.
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea A - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento em direitos creditórios, constituídos sob a forma de condomínio fechado.
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea B - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como renda fixa ou como referenciados em indicadores de desempenho de renda fixa que contenham em sua denominação a expressão 'crédito privado'.
Artigo 8º, Inciso II, Alínea A - Até 20% (vinte por cento) em cotas de fundos de investimento classificados como ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, conforme regulamentação estabelecida pela CVM (fundos de renda variável);
Artigo 8º, Inciso III - Até 15% (quinze por cento) em cotas de fundos de investimento em ações, constituídos sob a forma de condomínio aberto, cujos regulamentos dos fundos determinem que as cotas de fundos de índices referenciados em ações que compõem suas carteiras estejam no âmbito dos índices previstos no inciso II deste artigo.
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea A - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento em participações (FIP), constituídos sob a forma de condomínio fechado, vedada a subscrição em distribuições de cotas subsequentes, salvo se para manter a mesma proporção já investida nesses fundos;
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea B - Até 5% (cinco por cento) em cotas de fundos de investimento imobiliário (FII) com presença em 60% (sessenta por cento) nos pregões de negociação em mercados regulamentados de valores mobiliários no período de doze meses anteriormente à aplicação.
Artigo 9º - A, Inciso I - Até 10% (dez por cento) em cotas de fundos de investimento e cotas de fundos de investimento em cotas de fundos de investimento classificados como 'Renda Fixa Dívida Externa'.
Artigo 9º - A, Inciso II - Até 10% (dez por cento) em cotas de fundos de investimento constituídos no Brasil sob a forma de condomínio aberto com o sufixo 'Investimento no Exterior', nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários, que invistam, no mínimo, 67% (sessenta e sete por cento) do seu patrimônio líquido em cotas de fundos de investimento constituídos no exterior.
Artigo 9º - A, Inciso III - Até 10% (dez por cento) em cotas dos fundos da classe 'Ações BDR Nivel I', nos termos da regulamentação estabelecida pela Comissão de Valores Mobiliários.



# TABOÃOPREV



Autarquia Previdenciária

## Resultado das Aplicações Financeiras nos últimos 12 meses Base Outubro/2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Meta (%)
Novembro/2020	698.368.297,18	5.081.440,30	8.439.320,61	715.972.363,82	20.961.946,95	3,00%	1,35%
Dezembro/2020	715.972.363,82	4.240.000,00	7.306.100,01	734.411.528,43	21.505.264,62	3,00%	1,86%
Janeiro/2021	734.411.528,43	1.350.000,00	4.023.566,02	729.736.088,66	-2.001.873,75	-0,27%	0,70%
Fevereiro/2021	729.736.088,66	9.600.000,00	4.837.718,15	729.130.181,14	-5.368.189,37	-0,73%	1,27%
Março/2021	729.130.181,14	6.100.000,00	4.995.577,55	732.234.124,97	1.999.521,38	0,27%	1,46%
Abril/2021	732.234.124,97	53.790.000,00	65.911.107,61	729.829.849,94	9.716.832,58	1,33%	0,59%
Mai/2021	729.829.849,94	20.779.000,00	5.088.622,18	757.393.518,54	11.873.290,78	1,59%	1,31%
Junho/2021	757.393.518,54	7.050.000,00	6.223.122,37	758.708.375,88	487.979,71	0,06%	1,01%
Julho/2021	758.708.375,88	108.230.000,00	106.321.230,09	756.771.175,29	-3.845.970,50	-0,51%	1,46%
Agosto/2021	756.771.175,29	27.081.000,00	25.001.431,79	746.367.700,53	-12.483.042,97	-1,64%	1,37%
Setembro/2021	746.367.700,53	7.422.000,00	5.392.604,27	741.382.834,01	-7.014.262,25	-0,94%	1,64%
Outubro/2021	741.382.834,01	37.800.000,00	35.585.719,85	730.677.211,54	-12.919.902,62	-1,74%	1,71%
<b>Rentabilidade Acumulada no ano de 2021</b>					<b>-19.532.237,29</b>	<b>-2,59%</b>	<b>13,45%</b>

Taboãoprev – Autarquia Previdenciária do Município de Taboão da Serra

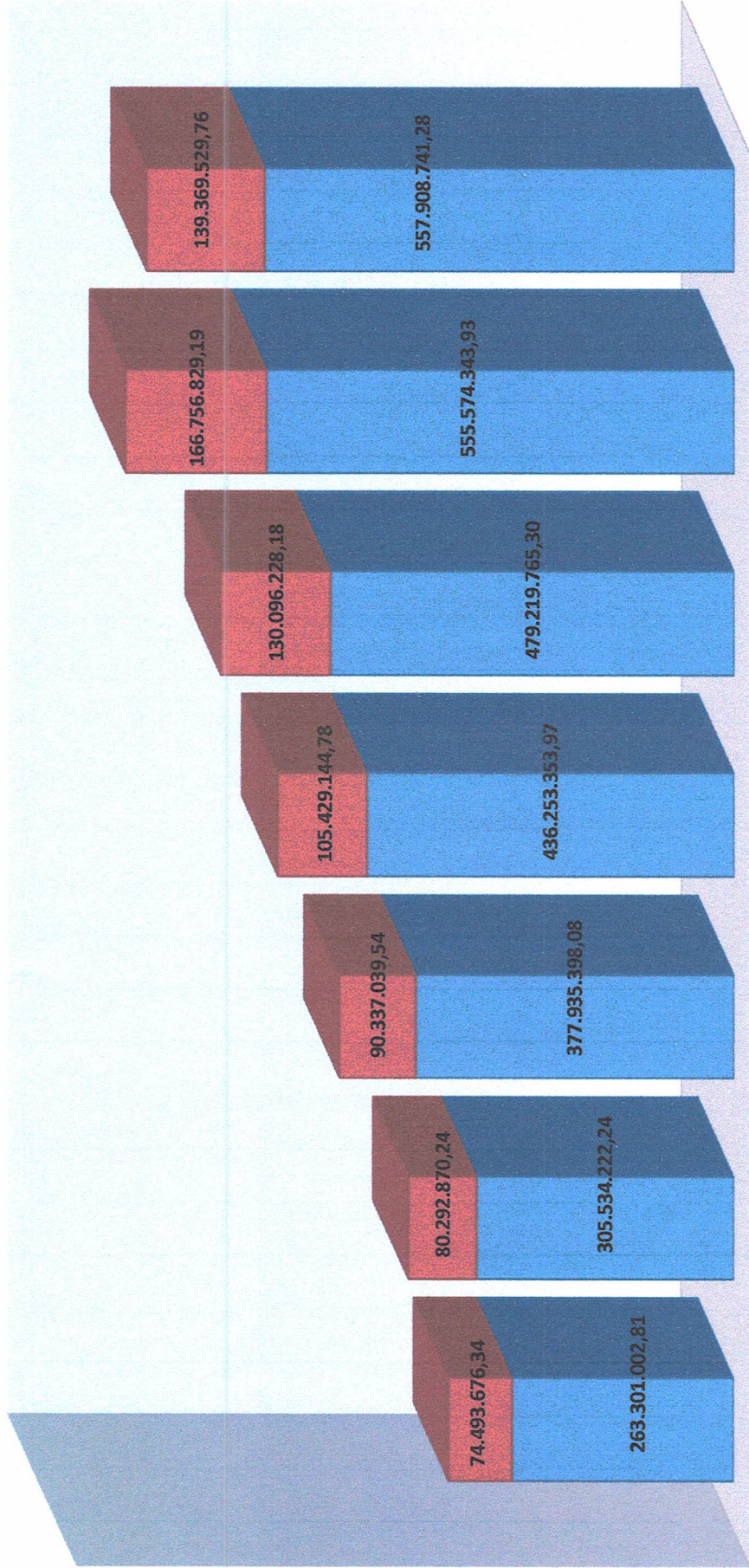
Rua Mario Latorre, 130 – Parque Pinheiros – CEP 06767-230 – Taboão da Serra – SP

Tels: (11) 4787-6029 / 4135-4977 / 4701-6344

www.taboaprev.com.br



### Evolução dos Investimentos da TaboãoPrev de Jan/2014 à Out/2021

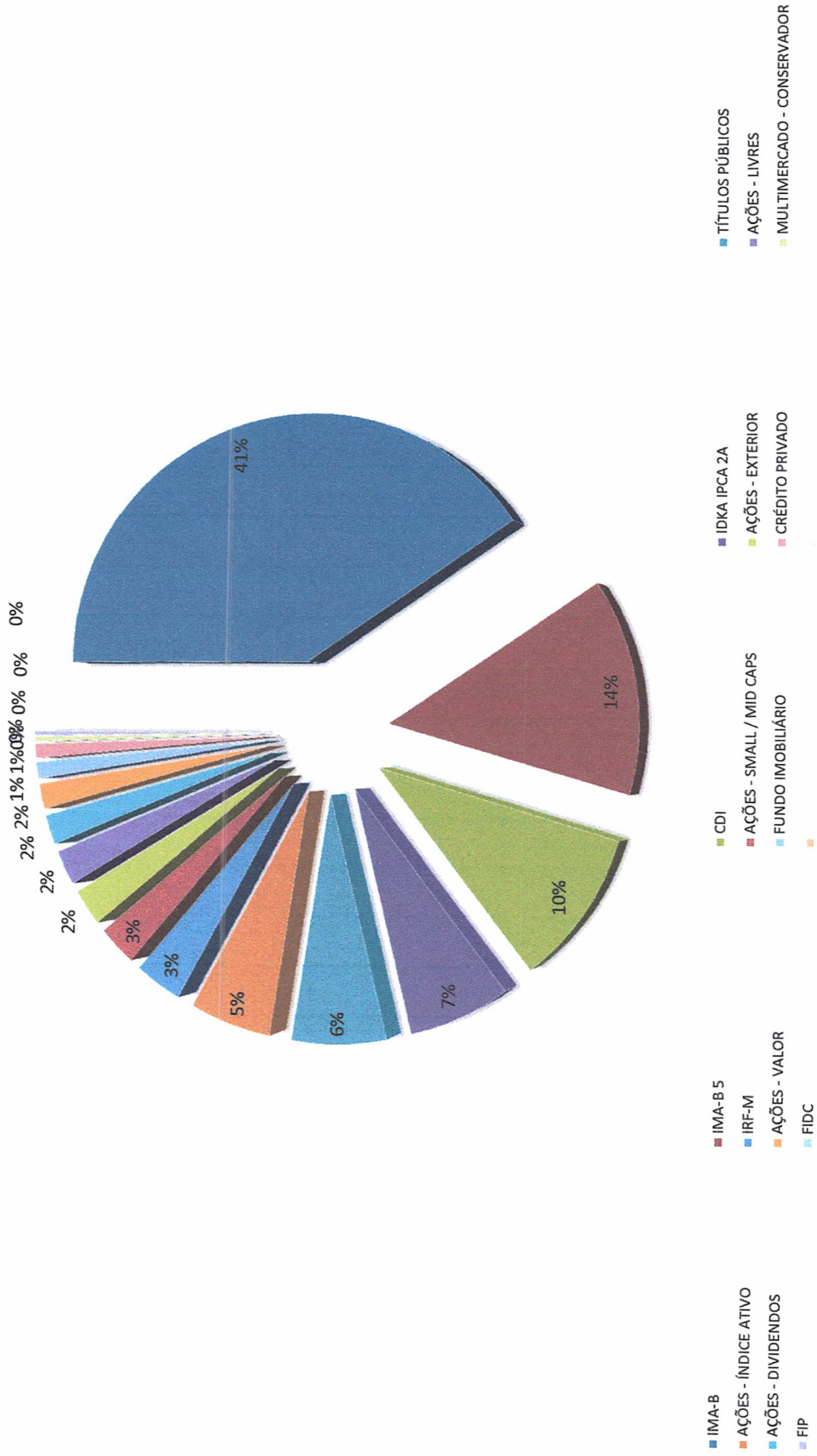


*[Handwritten signatures]*

■ Fixa ■ Variável



**Distribuição dos Investimentos por Segmento Outubro/2021**

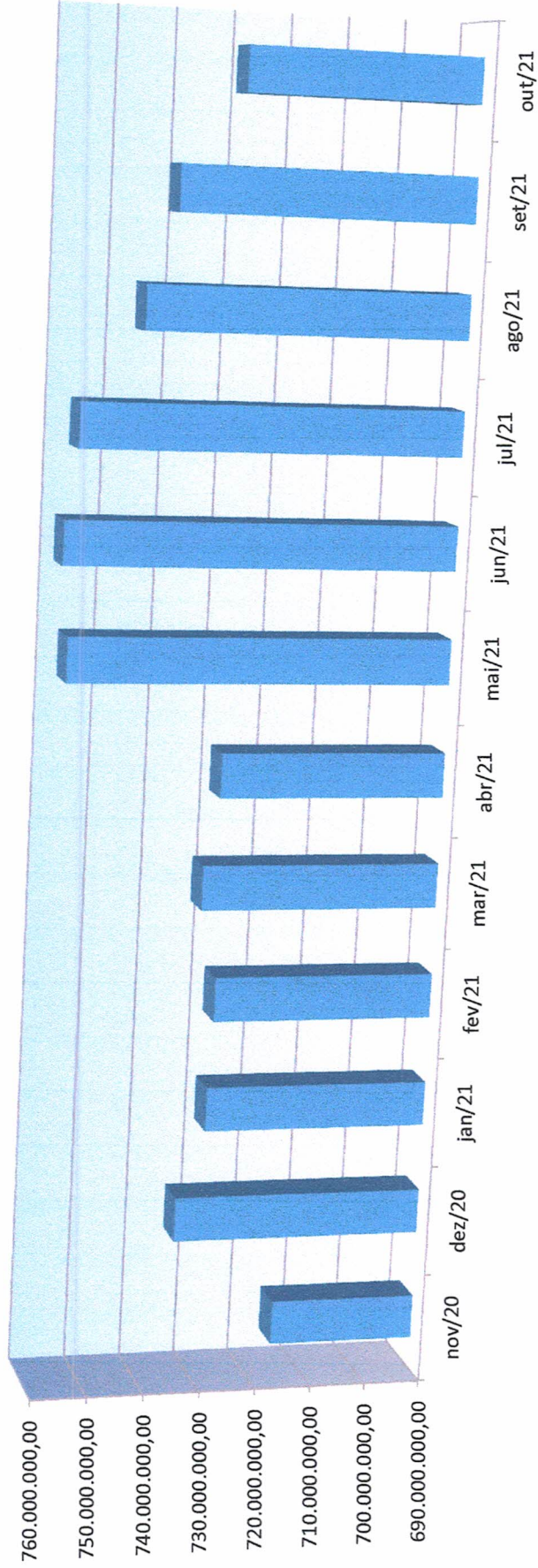


*[Handwritten signatures]*





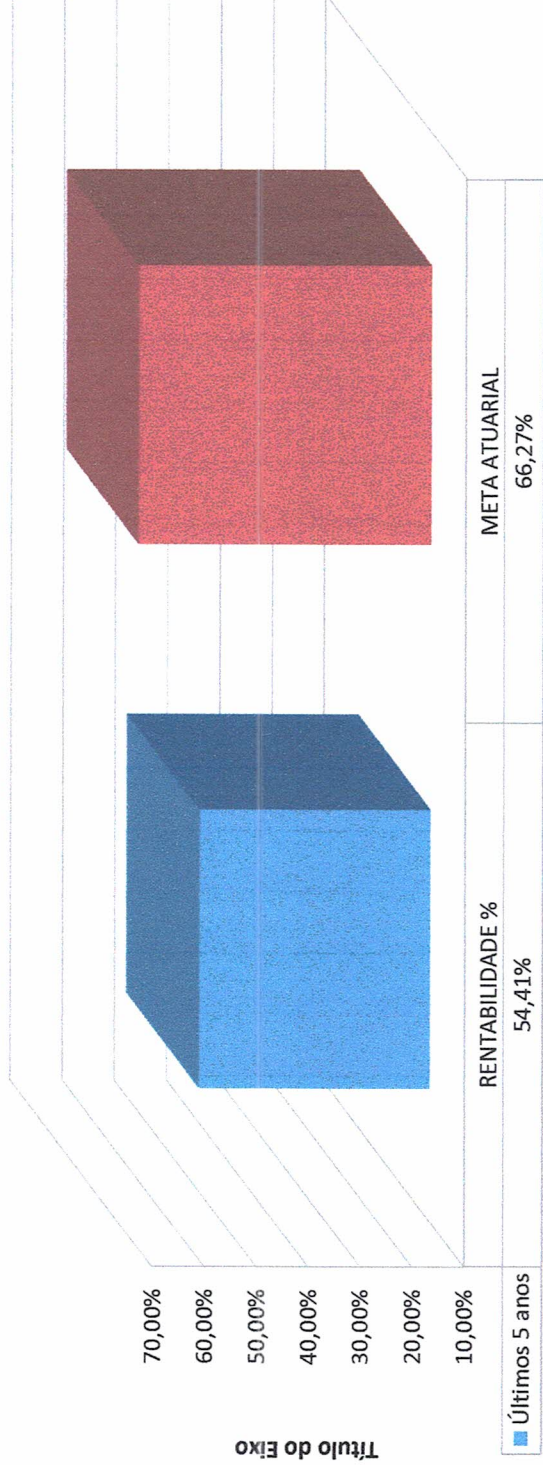
### Evolução dos Investimentos últimos 12 meses



*(Handwritten signatures and initials)*



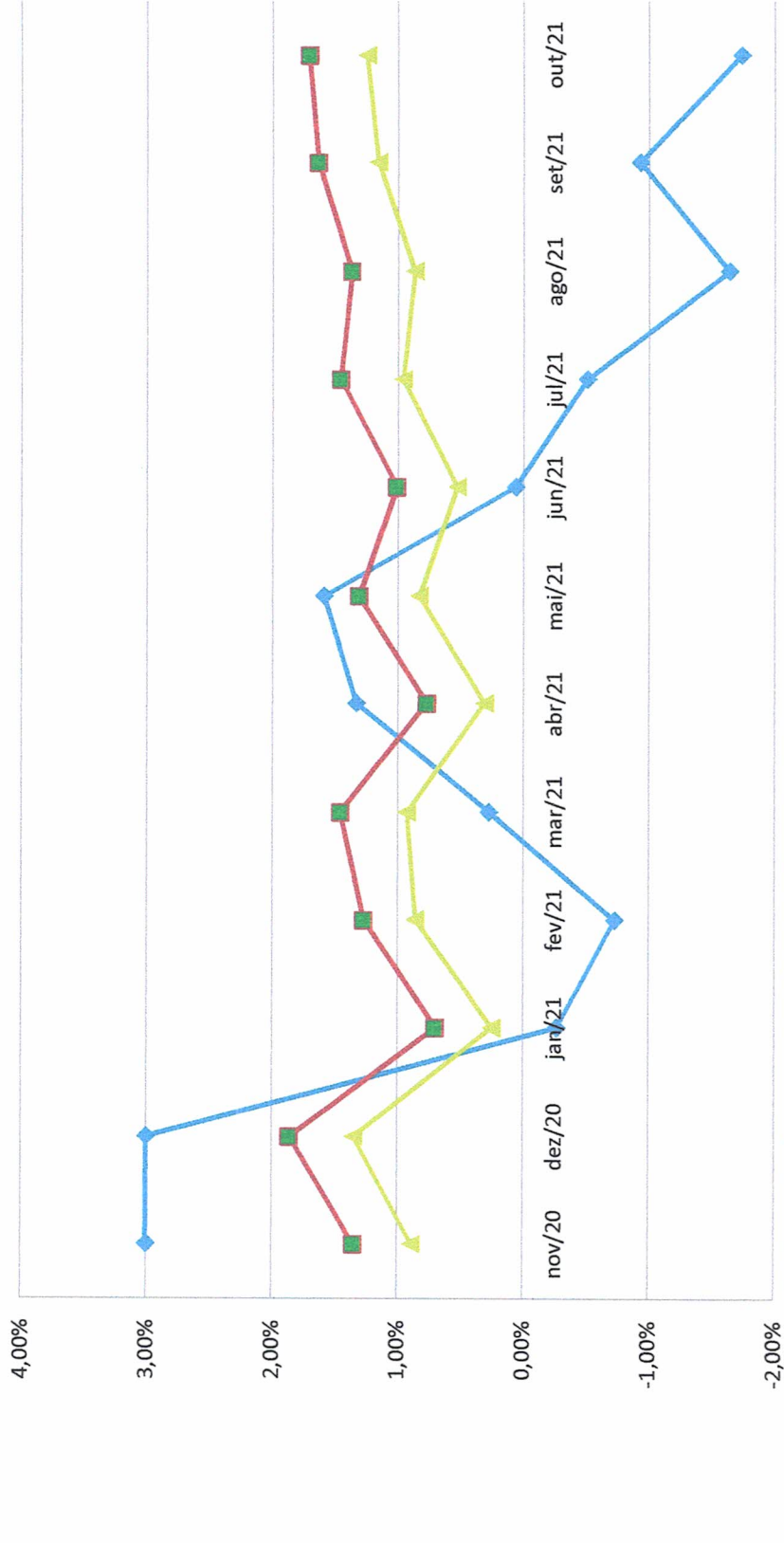
### Rentabilidade Acumulada nos últimos 5 anos



ANO	RENTABILIDADE EM R\$	RENTABILIDADE %	META ATUARIAL
2016	60.072.334,12	15,45%	12,64%
2017	52.185.685,35	11,24%	9,04%
2018	49.574.529,27	9,26%	9,92%
2019	100.490.559,08	16,71%	10,59%
2020	30.800.872,25	4,34%	10,63%
2021-Outubro	-19.532.237,29	-2,59%	13,45%
<b>Últimos 5 anos</b>	<b>273.591.742,78</b>	<b>54,41%</b>	<b>66,27%</b>



### Comparativo da Meta Atuarial e Retorno da Carteira de Investimentos

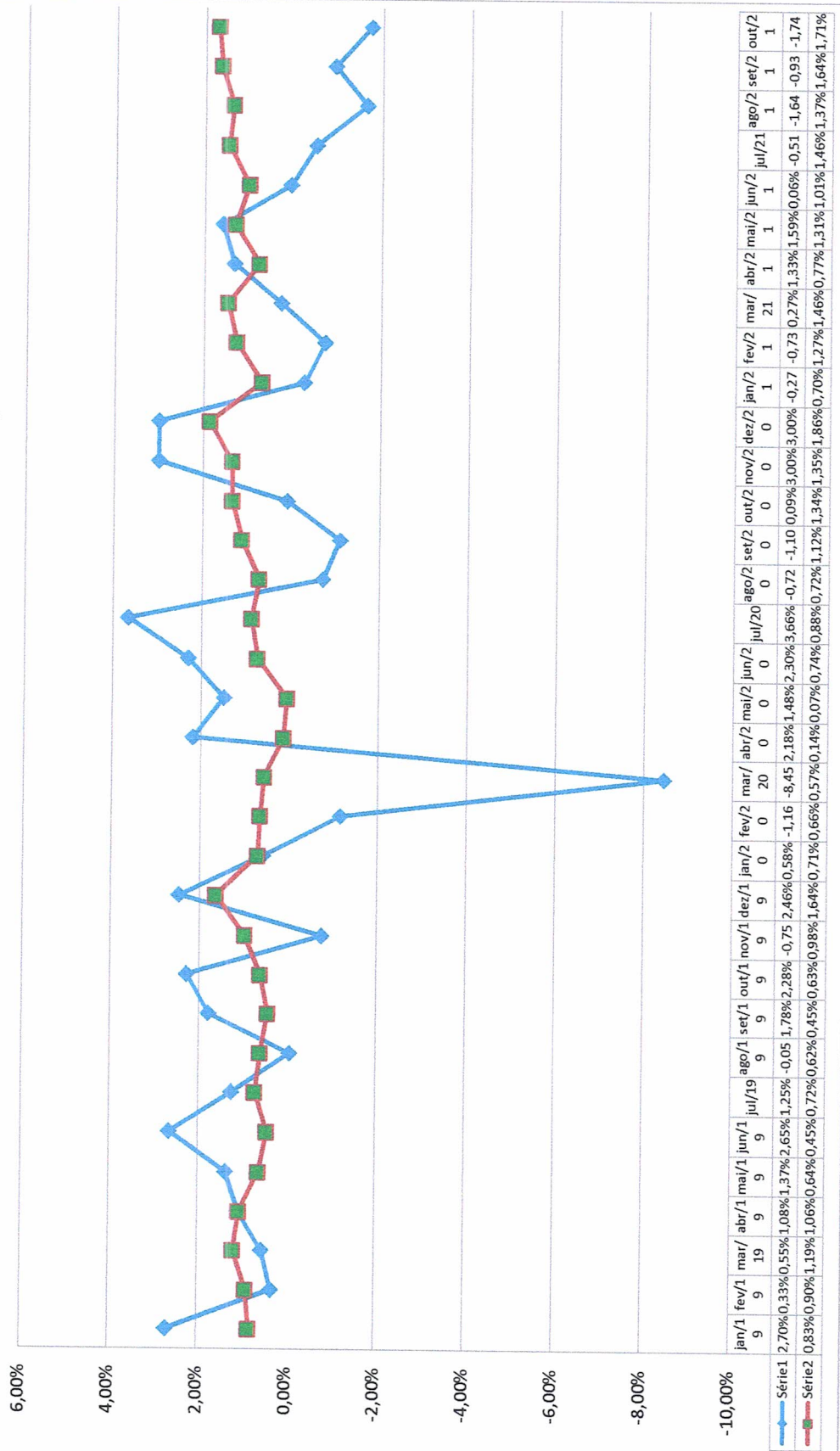


	nov/20	dez/20	jan/21	fev/21	mar/21	abr/21	mai/21	jun/21	jul/21	ago/21	set/21	out/21
<b>Retorno</b>	3,00%	3,00%	-0,27%	-0,73%	0,27%	1,33%	1,59%	0,06%	-0,51%	-1,64%	-0,93%	-1,74%
<b>Meta Atuarial (%)</b>	1,35%	1,86%	0,70%	1,27%	1,46%	0,77%	1,31%	1,01%	1,46%	1,37%	1,64%	1,71%
<b>IPCA%</b>	0,89%	1,35%	0,25%	0,86%	0,93%	0,31%	0,83%	0,53%	0,96%	0,87%	1,16%	1,25%

*(Handwritten signatures and initials)*



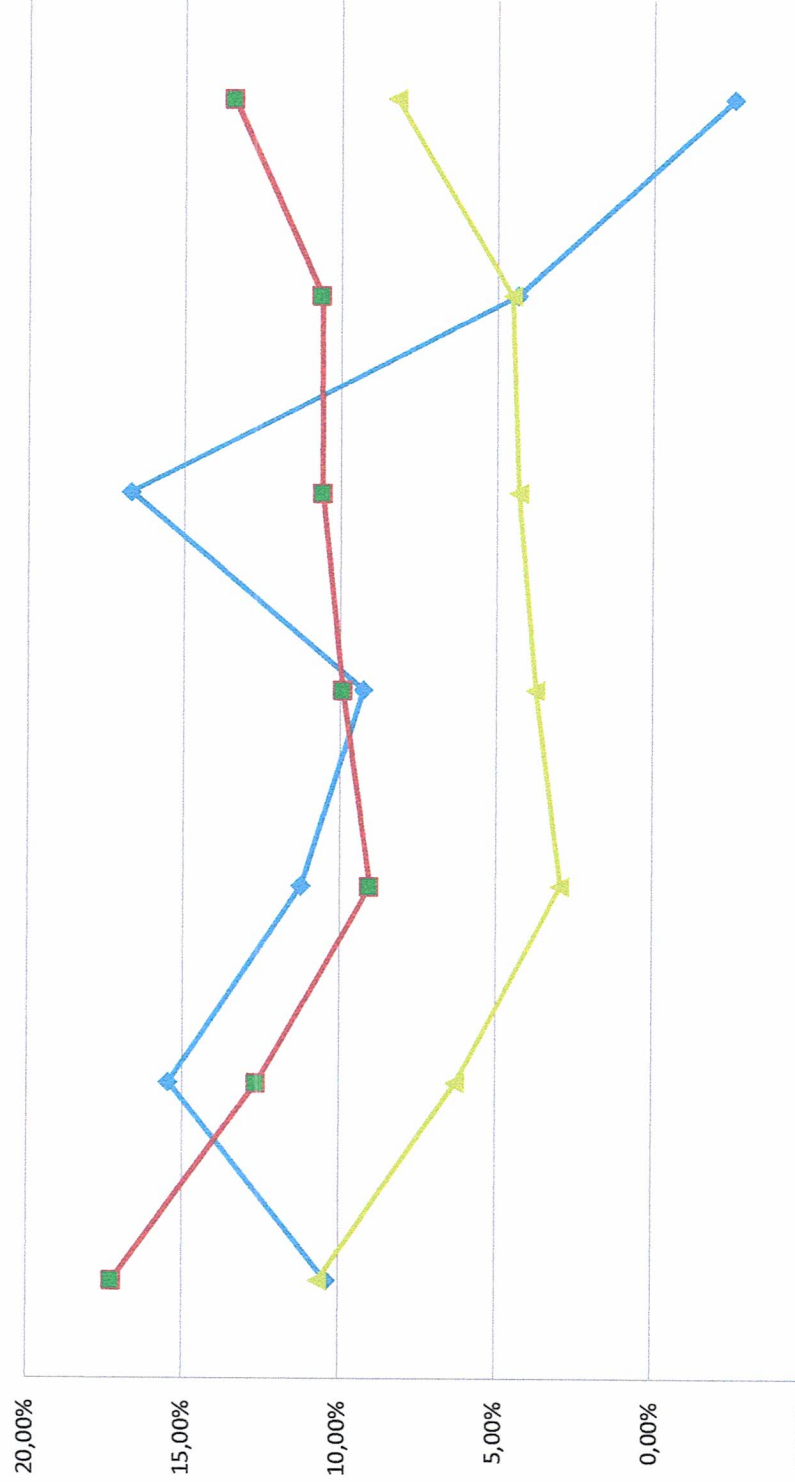
### Comparativo Retorno x Meta (2019-2021)



*(Handwritten signatures and initials)*



### Comparativo da Meta x Retorno Anual

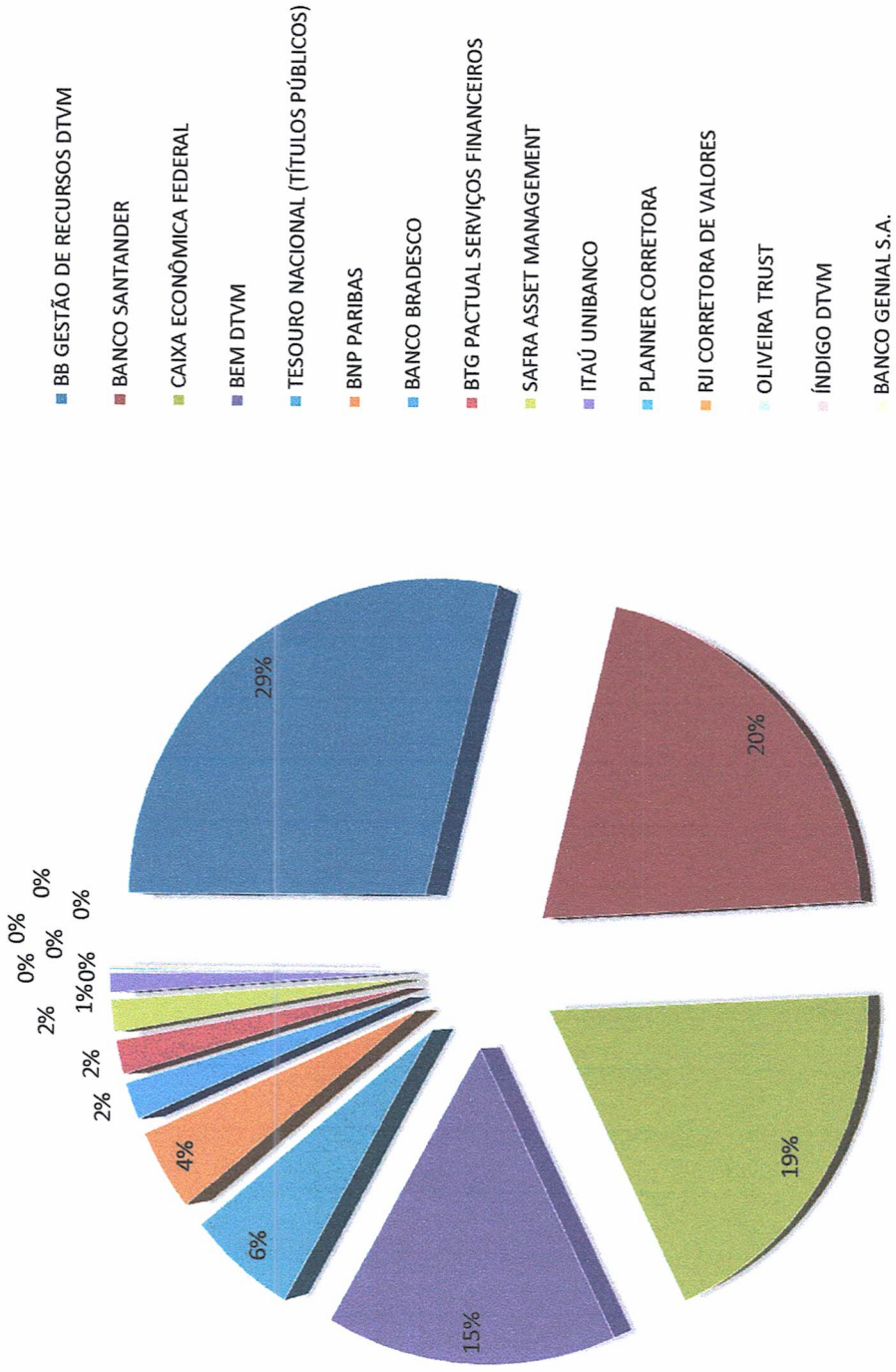


	2015	2016	2017	2018	2019	2020	2021
Retorno	10,40%	15,45%	11,24%	9,26%	16,71%	4,34%	-2,59%
Meta Atuarial (%)	17,26%	12,64%	9,04%	9,92%	10,59%	10,63%	13,45%
IPCA%	10,67%	6,28%	2,94%	3,75%	4,31%	4,52%	8,24%

*(Handwritten signatures and initials)*



## Distribuição dos Investimentos por Administrador Outubro/2021



*[Handwritten signatures and initials]*

# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

## 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.

CRÉDITO E MERCADO  
Consultoria em Investimentos

TABOAPREV - UNIDADE GESTORA ÚNICA DO RPPS DE TABOAO DA SERRA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 29/10/2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2021)

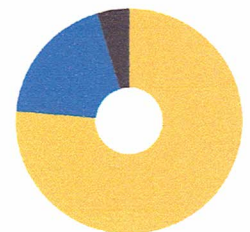
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			43.245.867,67	5,92%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	46.044.130,69	6,30%	1.026	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea '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'
BRADESCO 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 MULTISSECTORIAL 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 MULTIESTRAT...	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 - BROR11	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
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>730.677.211,54</b>				

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%	29.821.653,48
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
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>557.908.741,28</b>	<b>76,36%</b>	<b>72,00%</b>	<b>129,00%</b>	<b>279,00%</b>	

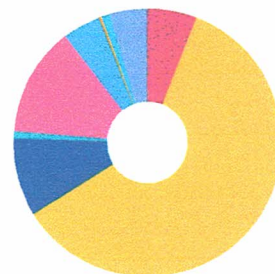


**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º e 10º e Artigo 8º e 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

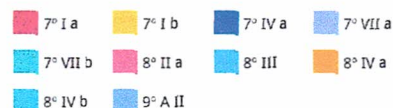


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2021)

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%	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
<b>Total Renda Variável</b>	<b>40,00%</b>	<b>139.369.529,76</b>	<b>19,07%</b>	<b>18,50%</b>	<b>38,00%</b>	<b>60,00%</b>	



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%	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
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>33.398.940,50</b>	<b>4,57%</b>	<b>0,00%</b>	<b>6,00%</b>	<b>30,00%</b>	



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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão	Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
					Carteira \$	Carteira %		
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	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	43.245.867,67	5,92	5,00	10,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	43.245.867,67	5,92	-	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	439.876.866,76	60,20	60,00	90,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	39.428.486,33	5,40	0,14	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	20,00
WESTERN ASSET	31.361.886,72	4,29	0,06	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	50,00
GENIAL INVESTIMENTOS	29.721.671,52	4,07	0,37	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	10,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	16.921.222,36	2,32	0,23	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	68.255.223,84	9,34	3,00	40,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	14.494.477,19	1,98	0,00	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	40,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	12.578.341,05	1,72	0,01	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	10,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	11.741.706,90	1,61	1,26	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	0,01	0,00	3,50	4,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	9.887.252,09	1,35	0,00	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	6.530.783,00	0,89	0,50	5,00
ITAÚ DTVM	7.702.254,21	1,05	0,00	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	10,00
ARX INVESTIMENTOS	4.936.836,96	0,68	0,01	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	10,00
NAVI CAPITAL	4.205.246,07	0,58	0,28	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	96.425.347,17	13,20	15,00	20,00
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIR...	4.120.000,00	0,56	0,00	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
ICATU VANGUARDA	3.566.846,76	0,49	0,01	Artigo 8º, Inciso III	33.577.147,57	4,60	2,00	10,00
VINCI PARTNERS	2.440.413,48	0,33	0,00	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	1.767.862,80	0,24	0,50	2,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	2.215.260,85	0,30	0,03	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	7.599.172,22	1,04	1,00	2,00
PLURAL	532.628,56	0,07	0,01	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	1,00
BRZ INVESTIMENTOS	481.079,71	0,07	0,02	Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
RB CAPITAL ASSET MANAGEMENT	13.113,80	0,00	0,00	Artigo 9º - A, Inciso II	33.398.940,50	4,57	0,00	10,00
ÍNDIGO DTVM	0,01	0,00	-	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
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-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%
BRADESCO 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%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	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%
<b>Não Possui (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
TRENBANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	0,00%	-90,00%	-	-	-	-	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

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
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	2,06%	17,53%	5,93%	11,19%	22,20%	40,21%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-0,31%	144,31%	-0,91%	148,54%	137,37%	-92,68%	0,00%	0,03%
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	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%
<b>IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,91%	15,77%	5,44%	10,17%	20,00%	35,22%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	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%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-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%
<b>IBX (Benchmark)</b>	-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%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-6,74%	-13,04%	-15,02%	-12,95%	10,16%	-3,47%	-	-

Página 8 de 21

 Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.  
 Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP  
 CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

## 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%	-
<b>CDI (Benchmark)</b>	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%
<b>IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,98%	16,65%	5,69%	10,68%	21,10%	37,70%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉGIA	0,01%	62,99%	-0,14%	63,69%	58,51%	28,04%	0,09%	0,63%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	-1,47%	-6,78%	-5,26%	-6,48%	-3,29%	-4,17%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	-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%

Página 9 de 21

 Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.  
 Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP  
 CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

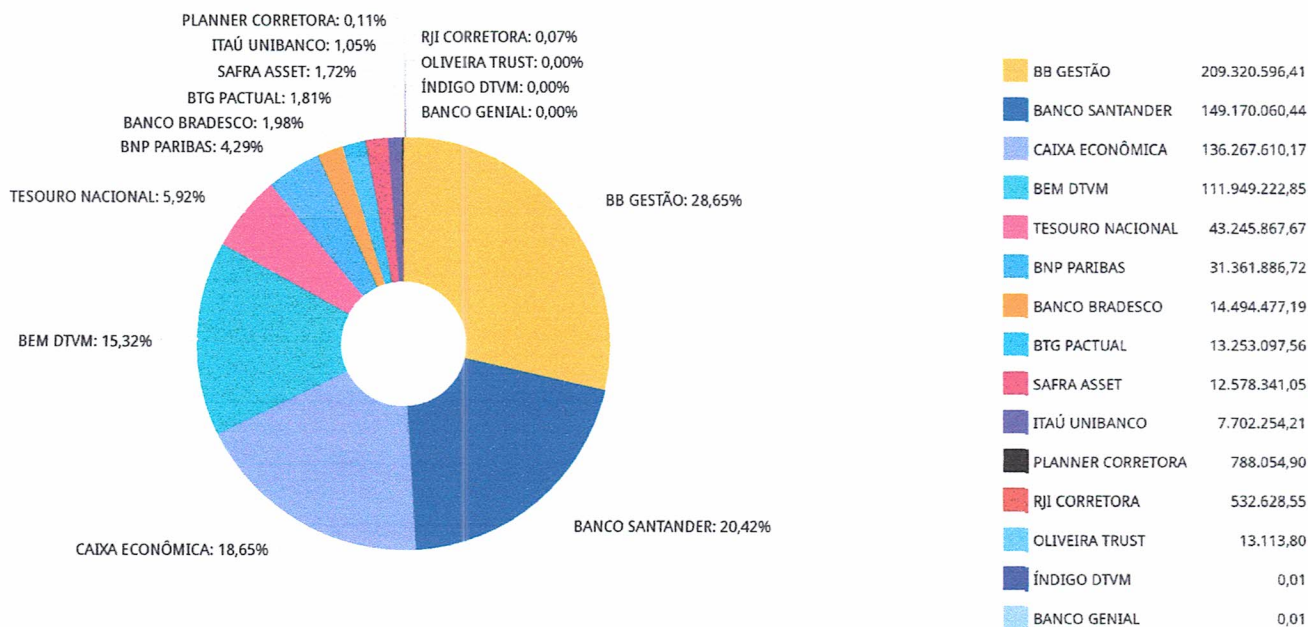
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
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 - BCF11	-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%	-	-

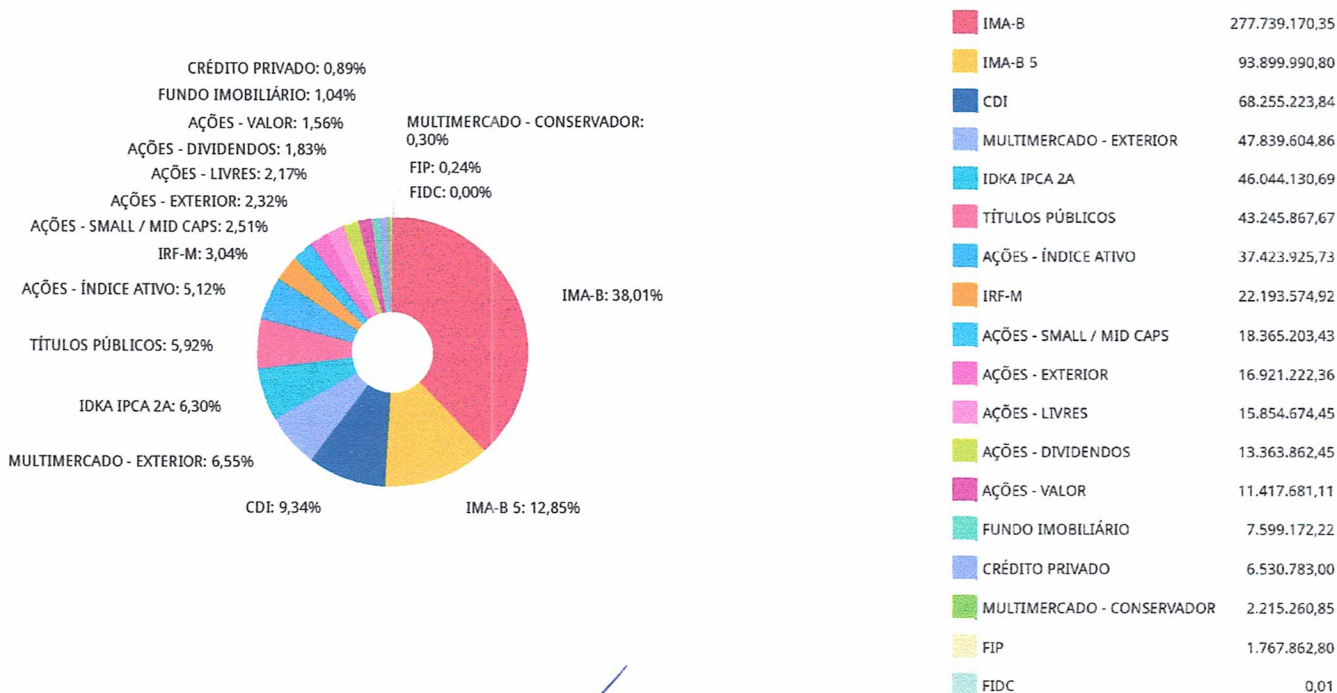
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	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%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
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)



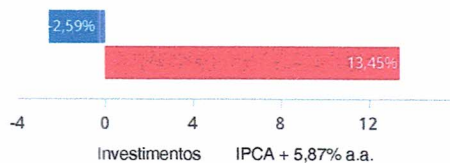
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2021)

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

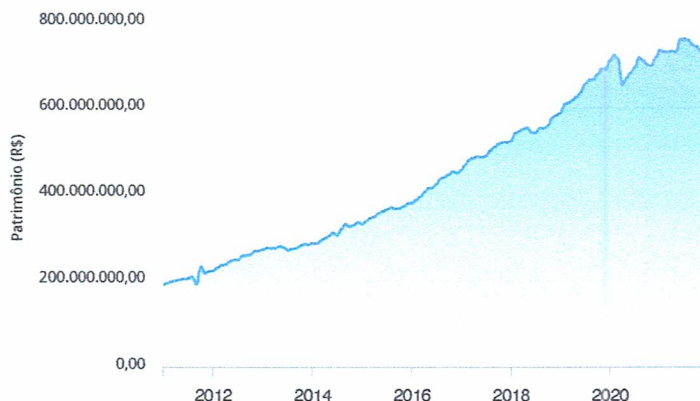
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	734.411.528,43	1.350.000,00	4.023.566,02	729.736.088,66	-2.001.873,75	-2.001.873,75	-0,27%	-0,27%	0,70%	0,70%	-38,67%	3,45%
Fevereiro	729.736.088,66	9.600.000,00	4.837.718,15	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

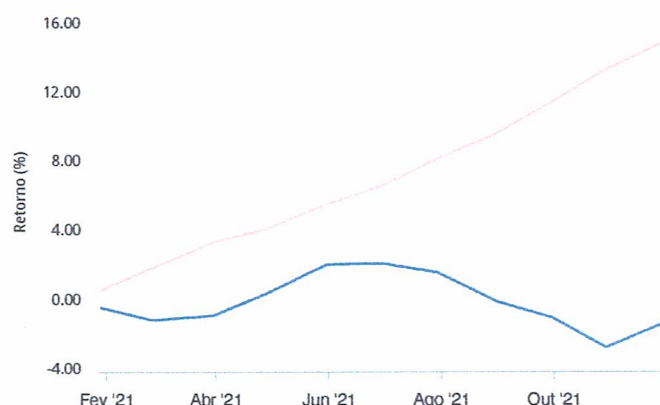


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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%
BRADESCO 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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>564.654.609,86</b>	<b>37.800.000,00</b>	<b>35.289.555,57</b>	<b>557.908.741,28</b>	<b>-9.256.313,01</b>	<b>-1,63%</b>		<b>2,67%</b>

## 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 MULTISTRATÉ...	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 MULTISTRATÉGIA	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 - BRRC11	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%

Página 18 de 21

 Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.  
 Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP  
 CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410

## 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%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>145.562.318,99</b>	<b>0,00</b>	<b>296.164,28</b>	<b>139.369.529,76</b>	<b>-5.896.624,95</b>	<b>-4,05%</b>		<b>9,31%</b>

Página 19 de 21

 Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.  
 Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP  
 CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410



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%
<b>Total Exterior</b>	<b>31.165.905,16</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>33.398.940,50</b>	<b>2.233.035,34</b>	<b>7,16%</b>		<b>11,09%</b>

Página 20 de 21

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.  
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP  
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410Disclaimer

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.

Página 21 de 21

Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários Ltda.  
Rua Barão de Paranapiacaba, 233 - 15º Andar CJ 1501 - Santos - SP  
CEP: 11050-250 - Telefone: (13) 3878-8410