

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

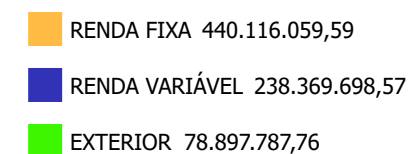
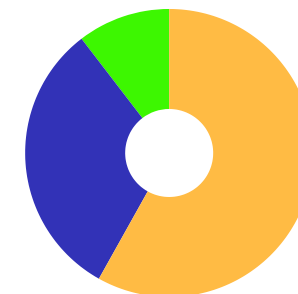
| Produto / Fundo                                      | Resgate    | Carência      | Saldo          | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922                   |
|--|------------|---------------|----------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...  | D+1        | Não há        | 32.308.028,83  | 4,27%              | 1.014    | 0,34%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP          | D+1        | Não há        | 21.353.270,19  | 2,82%              | 770      | 0,35%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...  | D+1        | Não há        | 106.694.165,64 | 14,09%             | 650      | 1,48%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...  | D+0        | Não há        | 4.025.498,57   | 0,53%              | 1.140    | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...  | D+0        | 15/08/2024    | 5.279.777,94   | 0,70%              | 92       | 1,24%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA       | D+0        | Não há        | 47.388.233,23  | 6,26%              | 964      | 0,33%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...  | D+0        | Não há        | 13.263.634,66  | 1,75%              | 300      | 1,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...  | D+0        | Não há        | 3.764.747,46   | 0,50%              | 1.264    | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA             | D+1        | Não há        | 280.644,41     | 0,04%              | 178      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA            | D+1        | Não há        | 27.841.751,59  | 3,68%              | 9.687    | 2,52%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA       | D+1        | Não há        | 15.543.110,42  | 2,05%              | 44       | 8,12%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA          | D+1        | Não há        | 106.069.193,28 | 14,00%             | 113      | 9,41%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  |
| WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA                | D+1        | Não há        | 24.659.383,07  | 3,26%              | 3.076    | 8,53%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA              | D+1        | Não há        | 21.417.364,03  | 2,83%              | 232      | 4,70%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR                    | Não se ... | Não se aplica | 149.723,68     | 0,02%              |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso VII, 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 ' |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...  | D+30 ou... | Não há        | 10.077.532,58  | 1,33%              | 74       | 1,59%            | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                         | D+4        | Não há        | 16.143.673,80  | 2,13%              | 113      | 1,43%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '   |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES      | D+4        | Não há        | 8.912.528,09   | 1,18%              | 40       | 1,74%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '   |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES                             | D+4        | Não há        | 19.410.275,89  | 2,56%              | 8.252    | 3,74%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |

**Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)**

| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência      | Saldo                 | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922                  |
|---|------------|---------------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|------------------------------------|
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES                       | D+4        | Não há        | 3.647.675,43          | 0,48%              | 16.687   | 1,85%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                     | D+4        | Não há        | 6.639.231,64          | 0,88%              | 5.723    | 1,71%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                           | D+3        | Não há        | 30.240.996,27         | 3,99%              | 27.215   | 2,28%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                          | D+3        | Não há        | 26.653.277,56         | 3,52%              | 56.614   | 1,56%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES                              | D+4        | Não há        | 21.821.203,64         | 2,88%              | 10.718   | 6,65%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                     | D+4        | Não há        | 15.755.108,15         | 2,08%              | 11.521   | 1,50%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES                 | D+4        | Não há        | 27.510.387,43         | 3,63%              | 6.223    | 2,44%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP     | D+1        | Não há        | 24.747.013,86         | 3,27%              | 19.023   | 0,78%            | Artigo 8º, Inciso III              |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO          | D+1        | Não há        | 35.675.508,68         | 4,71%              | 58.919   | 1,52%            | Artigo 8º, Inciso III              |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP               | Não se ... | Não se aplica | 213.704,78            | 0,03%              | 33       | 1,09%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP               | Não se ... | Não se aplica | 6.644,46              | 0,00%              |          | 0,00%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| ÁQUILLA FII - AQLL11                                | Não se ... | Não se aplica | 631.147,21            | 0,08%              |          | 1,67%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11       | S/Info     | Não se aplica | 361.321,68            | 0,05%              |          | 0,78%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO... | D+5        | Não há        | 19.560.962,69         | 2,58%              | 15.859   | 1,25%            | Artigo 9º - A, Inciso II           |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME... | D+8        | Não há        | 23.315.781,79         | 3,08%              | 13.296   | 1,15%            | Artigo 9º - A, Inciso II           |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM... | D+4 du     | Não há        | 7.660.652,17          | 1,01%              | 358      | 2,86%            | Artigo 9º - A, Inciso II           |
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I                  | D+5        | Não há        | 28.360.391,11         | 3,74%              | 145.494  | 0,73%            | Artigo 9º - A, Inciso III          |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>  |            |               | <b>757.383.545,92</b> |                    |          |                  |                                    |

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

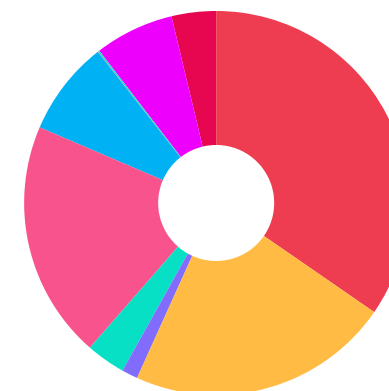
| Artigos - Renda Fixa                | Resolução<br>Pró Gestão - Nivel 1 | Carteira \$           | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2021 |               |                | GAP<br>Superior |
|-------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|-----------------|
|                                     |                                   |                       |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |                 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '   | 100,00%                           | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 100,00%        | 757.383.545,92  |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 100,00%                           | 262.199.752,52        | 34,62%        | 5,00%                         | 32,50%        | 100,00%        | 495.183.793,40  |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '   | 100,00%                           | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 100,00%        | 757.383.545,92  |
| Artigo 7º, Inciso II                | 5,00%                             | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 37.869.177,30   |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 65,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 60,00%         | 454.430.127,55  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 65,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 60,00%         | 454.430.127,55  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 45,00%                            | 167.689.050,80        | 22,14%        | 0,00%                         | 21,10%        | 45,00%         | 173.133.544,86  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '  | 45,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 40,00%         | 302.953.418,37  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '   | 20,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 20,00%         | 151.476.709,18  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '  | 15,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 113.607.531,89  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '  | 15,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 113.607.531,89  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00%                             | 149.723,69            | 0,02%         | 0,00%                         | 0,03%         | 5,00%          | 37.719.453,61   |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 10,00%                            | 10.077.532,58         | 1,33%         | 0,00%                         | 1,37%         | 5,00%          | 27.791.644,72   |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00%                             | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 37.869.177,30   |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b>                    | <b>440.116.059,59</b> | <b>58,11%</b> | <b>5,00%</b>                  | <b>55,00%</b> | <b>575,00%</b> |                 |



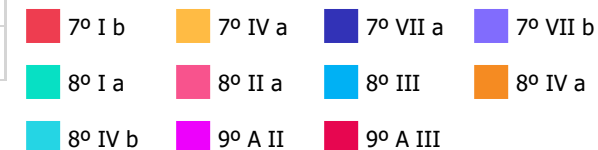
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

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

| Artigos - Renda Variável           | Resolução<br>Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$           | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2021 |               |                | GAP<br>Superior |
|------------------------------------|-----------------------------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|-----------------|
|                                    |                                   |                       |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |                 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '  | 35,00%                            | 25.056.201,89         | 3,31%         | 0,00%                         | 4,70%         | 35,00%         | 240.028.039,18  |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '  | 35,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 35,00%         | 265.084.241,07  |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 25,00%                            | 151.678.156,01        | 20,03%        | 2,00%                         | 25,00%        | 25,00%         | 37.667.730,47   |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 25,00%                            | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 20,00%         | 151.476.709,18  |
| Artigo 8º, Inciso III              | 10,00%                            | 60.422.522,54         | 7,98%         | 0,00%                         | 5,00%         | 10,00%         | 15.315.832,05   |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00%                             | 220.349,24            | 0,03%         | 0,00%                         | 0,01%         | 5,00%          | 37.648.828,06   |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00%                             | 992.468,89            | 0,13%         | 0,00%                         | 0,29%         | 5,00%          | 36.876.708,41   |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c ' | 5,00%                             | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 37.869.177,30   |
| <b>Total Renda Variável</b>        | <b>35,00%</b>                     | <b>238.369.698,57</b> | <b>31,47%</b> | <b>2,00%</b>                  | <b>35,00%</b> | <b>140,00%</b> |                 |



| Artigos - Exterior        | Resolução<br>Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$          | Carteira      | Estratégia de Alocação - Limite - 2021 |               |               | GAP<br>Superior |
|---------------------------|-----------------------------------|----------------------|---------------|--|---------------|---------------|-----------------|
|                           |                                   |                      |               | Inferior                               | Alvo          | Superior      |                 |
| Artigo 9º - A, Inciso I   | 10,00%                            | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                                  | 0,00%         | 10,00%        | 75.738.354,59   |
| Artigo 9º - A, Inciso II  | 10,00%                            | 50.537.396,65        | 6,67%         | 0,00%                                  | 6,50%         | 10,00%        | 25.200.957,94   |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00%                            | 28.360.391,11        | 3,74%         | 0,00%                                  | 3,50%         | 10,00%        | 47.377.963,48   |
| <b>Total Exterior</b>     | <b>10,00%</b>                     | <b>78.897.787,76</b> | <b>10,42%</b> | <b>0,00%</b>                           | <b>10,00%</b> | <b>30,00%</b> |                 |



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

| Gestão                            | Valor          | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|----------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 246.919.454,65 | 32,60         | 0,01           |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 142.883.614,80 | 18,87         | 0,02           |
| WESTERN ASSET                     | 137.954.398,48 | 18,21         | 0,27           |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT          | 121.612.303,70 | 16,06         | 0,01           |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 32.508.954,29  | 4,29          | 0,01           |
| ICATU VANGUARDA                   | 27.510.387,43  | 3,63          | 0,06           |
| XP ASSET MANAGEMENT               | 19.560.962,69  | 2,58          | 0,41           |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS            | 19.410.275,89  | 2,56          | 0,07           |
| SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT... | 7.660.652,17   | 1,01          | 0,13           |
| QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS         | 992.468,89     | 0,13          | 0,11           |
| PLURAL                            | 213.704,79     | 0,03          | 0,00           |
| VILA RICA CAPITAL                 | 149.723,68     | 0,02          | 0,15           |
| PÁTRIA INVESTIMENTOS              | 6.644,46       | 0,00          | 0,00           |

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2021 |            | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|---------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
|         | Carteira \$                   | Carteira % |                     |                     |

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

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

|                                       | Mês     | Ano     | 3M      | 6M      | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------|---------|---------|---------|---------|--------|---------|---------|------------------|
| <b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b> | 0,73%   | 5,17%   | 2,13%   | 3,80%   | 6,58%  | 14,23%  | -       | -                |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR     | -18,19% | -27,71% | -17,85% | -25,92% | -1,69% | 518,10% | -       | -                |

|   |        |        |        |        |       |       |       |       |
|---|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|
| <b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>                             | -1,26% | -6,63% | -4,19% | -1,61% | 3,20% | 1,48% | -     | -     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,27% | -6,87% | -4,33% | -1,81% | 2,97% | 0,80% | 3,71% | 0,10% |

|   |       |       |       |       |       |       |       |       |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                | 0,40% | 1,78% | 0,96% | 1,65% | 2,49% | 7,15% | -     | -     |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,37% | 1,53% | 0,87% | 1,48% | 2,16% | 6,42% | 0,30% | 0,00% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 0,38% | 1,59% | 0,89% | 1,54% | 2,25% | 6,68% | 0,29% | 0,00% |

|   |       |        |        |       |       |        |       |       |
|---|-------|--------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                  | 1,00% | 2,48%  | 1,18%  | 2,64% | 5,95% | 13,62% | -     | -     |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 0,98% | 2,29%  | 1,11%  | 2,49% | 5,70% | 13,04% | 0,82% | 0,02% |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA    | 0,99% | 2,33%  | 1,12%  | 2,52% | 5,72% | 13,16% | 0,81% | 0,02% |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA   | 0,67% | -1,44% | -0,23% | 1,10% | 2,93% | 11,68% | 1,06% | 0,04% |

|  |        |        |        |        |       |       |       |       |
|--|--------|--------|--------|--------|-------|-------|-------|-------|
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>                               | -0,13% | -2,30% | -1,59% | 0,52%  | 4,71% | 6,92% | -     | -     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,15% | -2,47% | -1,66% | 0,40%  | 4,49% | 6,40% | 2,18% | 0,06% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA             | -0,20% | -3,14% | -1,80% | 0,31%  | 3,79% | 5,90% | 2,08% | 0,06% |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA                | -0,51% | -6,20% | -3,00% | -1,09% | 1,75% | 4,97% | 2,33% | 0,08% |

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

|                                       | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M   | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|---------|------------------|
| <b>CDI (Benchmark)</b>                | 0,44%  | 2,51%  | 1,22%  | 2,01%  | 2,99%  | 6,65% | -       | -                |
| WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA | -0,22% | -5,53% | -1,61% | -1,09% | -2,52% | 4,92% | 0,78%   | 0,05%            |

|  |       |        |        |        |        |        |       |       |
|--|-------|--------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                  | 1,16% | 6,90%  | 3,02%  | 4,75%  | 10,25% | 13,70% | -     | -     |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 0,92% | 1,72%  | 1,05%  | 2,51%  | 5,47%  | 12,48% | 0,92% | 0,03% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 1,14% | 2,92%  | 1,66%  | 3,28%  | 6,40%  | 13,48% | 0,64% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA           | 0,36% | -1,16% | -1,87% | -0,98% | 0,86%  | 7,32%  | 0,48% | 0,03% |

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

|   |        |        |        |        |       |        |       |       |
|---|--------|--------|--------|--------|-------|--------|-------|-------|
| <b>Não definido (Benchmark)</b>                         | -      | -      | -      | -      | -     | -      | -     | -     |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,03%  | 2,74%  | 1,30%  | 2,74%  | 6,05% | 13,77% | 0,73% | 0,02% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA          | -1,27% | -6,75% | -4,34% | -1,89% | 2,92% | 0,38%  | 3,73% | 0,09% |

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

|   | Mês    | Ano     | 3M      | 6M      | 12M     | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| <b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>         | 2,01%  | 15,17%  | 5,71%   | 10,15%  | 21,77%  | 38,78%  | -       | -                |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP           | -0,31% | 145,06% | -0,92%  | 148,12% | 137,05% | -       | 0,00%   | 0,03%            |
| <b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>                  | -4,76% | 14,68%  | 0,23%   | 8,42%   | 28,09%  | 44,71%  | -       | -                |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO      | -4,60% | 17,21%  | 1,13%   | 9,92%   | 30,75%  | 43,09%  | 6,16%   | 0,13%            |
| <b>IBX-50 (Benchmark)</b>                       | -7,47% | -6,33%  | -14,15% | -5,58%  | 18,46%  | 6,59%   | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                    | -7,25% | -6,05%  | -14,34% | -5,34%  | 17,51%  | 5,44%   | 12,81%  | 0,23%            |
| <b>Ibovespa (Benchmark)</b>                     | -6,57% | -6,75%  | -12,48% | -4,85%  | 17,31%  | 5,95%   | -       | -                |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                       | -3,98% | -3,26%  | -8,58%  | -1,61%  | 23,96%  | 25,09%  | 11,83%  | 0,24%            |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                      | -7,71% | -3,23%  | -14,35% | -5,38%  | 16,49%  | 8,55%   | 12,73%  | 0,21%            |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | -6,41% | -8,03%  | -12,49% | -5,18%  | 10,14%  | -2,98%  | 12,45%  | 0,21%            |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES                        | -4,58% | -7,51%  | -14,14% | -4,51%  | 8,01%   | -2,82%  | 10,03%  | 0,18%            |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES             | -6,61% | -11,00% | -13,82% | -8,35%  | 6,94%   | -11,33% | 10,86%  | 0,21%            |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>                | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -       | -                |
| PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP           | -0,71% | -24,92% | -1,80%  | -13,95% | -29,78% | -99,81% | -       | -                |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                 | -3,96% | 0,09%   | -8,42%  | 3,65%   | 23,99%  | 17,42%  | 10,28%  | 0,21%            |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES                          | -6,06% | -12,35% | -14,65% | -8,05%  | -3,11%  | -4,25%  | 12,64%  | 0,17%            |

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

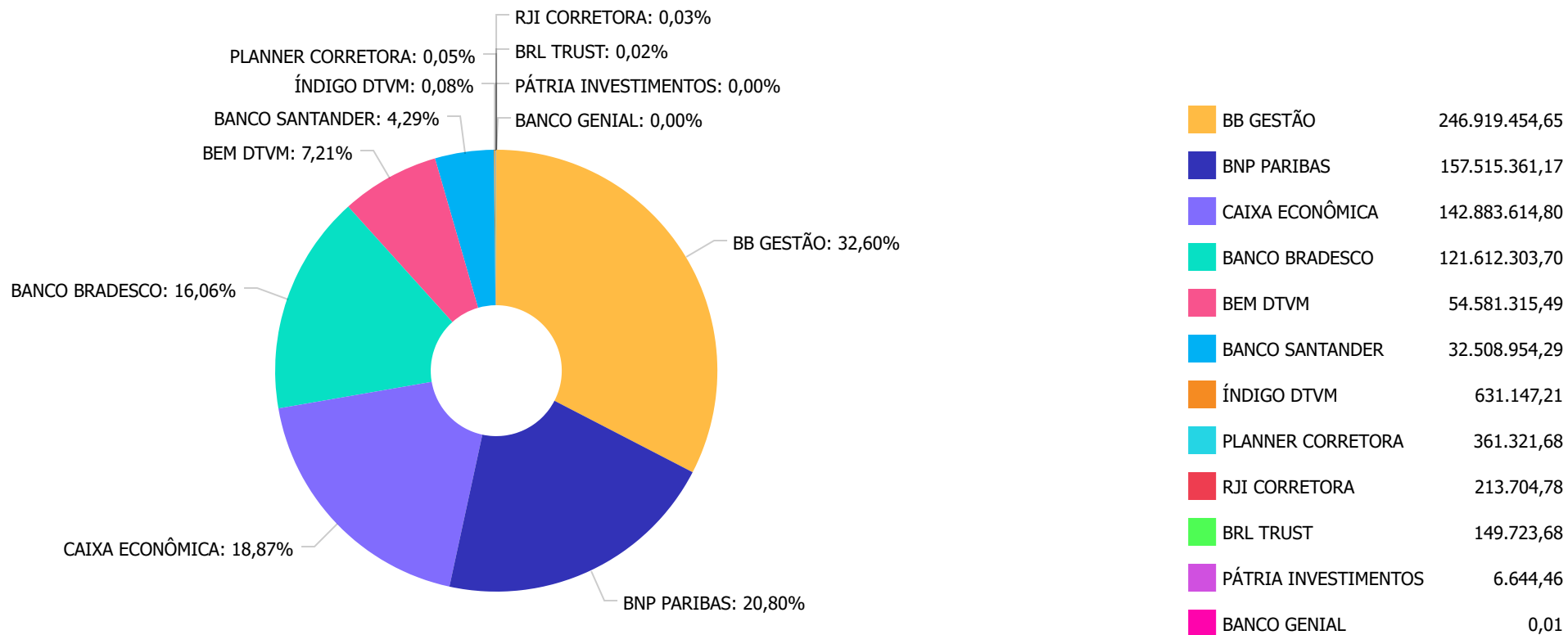
|   | Mês    | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | -4,64% | 17,47% | 1,14%  | 9,99%  | 30,72% | 42,05%  | 6,15%   | 0,13%            |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11   | 0,00%  | -9,37% | -3,12% | -1,21% | -6,17% | 65,99%  | -       | -                |
| ÁQUILLA FII - AQLL11                            | 0,00%  | -1,27% | 0,00%  | -0,77% | -3,74% | -18,08% | 0,00%   | 0,30%            |

|                                 |         |         |         |         |         |         |        |       |
|---------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|-------|
| <b>Não definido (Benchmark)</b> | -       | -       | -       | -       | -       | -       | -      | -     |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES   | -10,45% | -29,00% | -23,07% | -22,29% | -16,01% | -33,42% | 15,27% | 0,30% |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | -6,53%  | -6,24%  | -15,87% | -5,36%  | 13,95%  | 9,19%   | 13,30% | 0,23% |

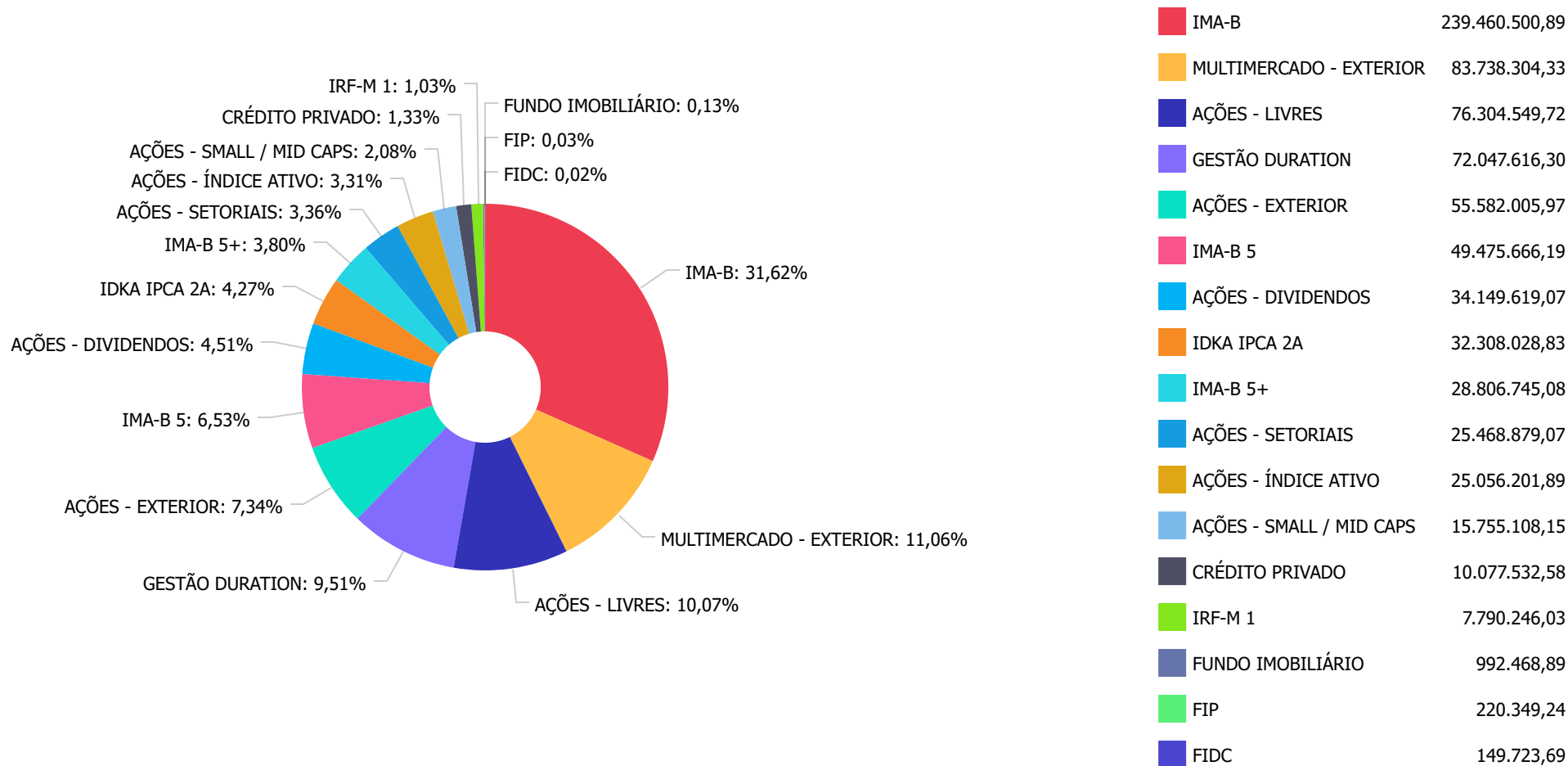
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

|  | Mês   | Ano    | 3M     | 6M     | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| <b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>  | 1,22% | 16,99% | 8,36%  | 2,09%  | 22,47% | 80,14%  | -       | -                |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 1,33% | 15,97% | 7,99%  | 2,32%  | 20,85% | 95,63%  | 6,11%   | 0,10%            |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>                                     | -     | -      | -      | -      | -      | -       | -       | -                |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ... | 0,61% | 5,53%  | 3,25%  | -0,98% | 8,39%  | -       | 7,76%   | 0,10%            |
| <b>Não definido (Benchmark)</b>                                      | -     | -      | -      | -      | -      | -       | -       | -                |
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I                                   | 0,50% | 17,34% | 9,62%  | 7,13%  | 17,85% | 105,44% | 6,82%   | 0,10%            |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ... | 1,46% | 20,32% | 10,07% | 5,44%  | 29,65% | -       | 5,72%   | 0,11%            |

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



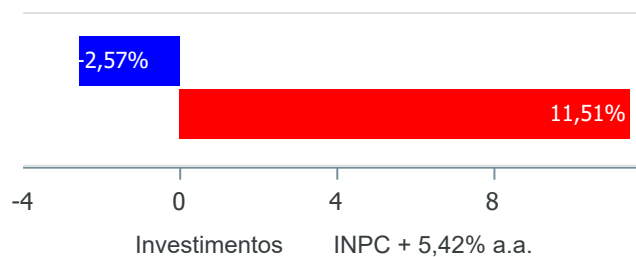
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2021)**



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021**

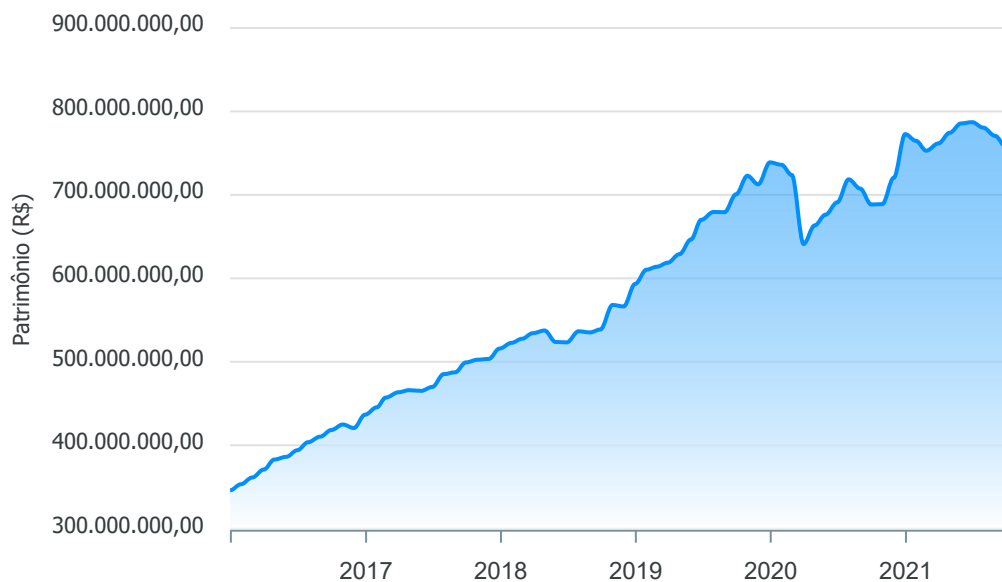
| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo no Mês   | Retorno        | Retorno Acum   | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR   |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro   | 772.758.420,48 | 8.926.995,34  | 8.588.634,39  | 764.781.240,64 | -8.315.540,79  | -8.315.540,79  | -1,08%      | -1,08%       | 0,69%    | 0,69%     | -155,68% | 5,55% |
| Fevereiro | 764.781.240,64 | 23.080.818,18 | 22.847.241,26 | 752.958.261,07 | -12.056.556,49 | -20.372.097,28 | -1,58%      | -2,63%       | 1,20%    | 1,90%     | -138,66% | 4,97% |
| Março     | 752.958.261,07 | 9.371.202,28  | 8.731.781,55  | 761.715.952,72 | 8.118.270,92   | -12.253.826,36 | 1,08%       | -1,59%       | 1,35%    | 3,27%     | -48,45%  | 6,09% |
| Abril     | 761.715.952,72 | 9.067.020,12  | 8.348.613,52  | 774.328.204,36 | 11.893.845,04  | -359.981,32    | 1,56%       | -0,05%       | 0,80%    | 4,10%     | -1,23%   | 3,93% |
| Mai       | 774.328.204,36 | 9.274.476,26  | 8.687.525,57  | 785.585.670,67 | 10.670.515,62  | 10.310.534,30  | 1,38%       | 1,33%        | 1,41%    | 5,56%     | 23,83%   | 4,26% |
| Junho     | 785.585.670,67 | 9.152.662,15  | 8.591.796,04  | 787.142.365,96 | 995.829,18     | 11.306.363,48  | 0,13%       | 1,45%        | 1,04%    | 6,66%     | 21,82%   | 3,53% |
| Julho     | 787.142.365,96 | 9.211.073,01  | 8.684.267,26  | 780.623.216,77 | -7.045.954,94  | 4.260.408,54   | -0,89%      | 0,55%        | 1,49%    | 8,25%     | 6,63%    | 4,45% |
| Agosto    | 780.623.216,77 | 43.708.535,02 | 42.955.176,75 | 770.751.825,98 | -10.624.749,06 | -6.364.340,52  | -1,36%      | -0,82%       | 1,35%    | 9,71%     | -8,45%   | 4,71% |
| Setembro  | 770.751.825,98 | 35.154.149,78 | 34.928.535,92 | 757.383.545,92 | -13.593.893,92 | -19.958.234,44 | -1,76%      | -2,57%       | 1,65%    | 11,51%    | -22,32%  | 4,97% |

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**



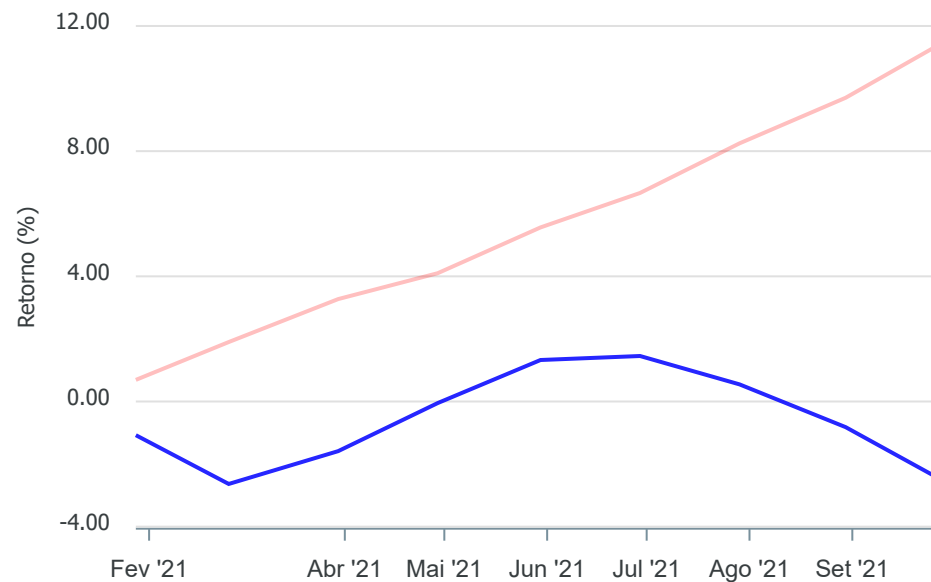
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO  36M



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

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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

| Ativos Renda Fixa                                      | Saldo Anterior        | Aplicações           | Resgates             | Saldo Atual           | Retorno (R\$)      | Retorno (%)   | (%) Instit | Var - Mês    |
|--|-----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|--------------------|---------------|------------|--------------|
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR                      | 183.021,72            | 0,00                 | 44.833,18            | 149.723,68            | 11.535,14          | 6,30%         | -          | -            |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 5.220.048,58          | 0,00                 | 0,00                 | 5.279.777,94          | 59.729,36          | 1,14%         | 1,14%      | 0,64%        |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...  | 9.985.288,17          | 0,00                 | 0,00                 | 10.077.532,58         | 92.244,41          | 0,92%         | 0,92%      | 0,92%        |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...  | 25.038.024,94         | 7.000.000,00         | 0,00                 | 32.308.028,83         | 270.003,89         | 0,84%         | 1,03%      | 0,73%        |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP            | 14.107.238,42         | 7.096.606,09         | 0,00                 | 21.353.270,19         | 149.425,68         | 0,70%         | 0,98%      | 0,82%        |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA              | 27.655.392,03         | 0,00                 | 0,00                 | 27.841.751,59         | 186.359,56         | 0,67%         | 0,67%      | 1,06%        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA         | 47.220.621,87         | 0,00                 | 0,00                 | 47.388.233,23         | 167.611,36         | 0,35%         | 0,35%      | 0,48%        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...  | 3.724.658,92          | 628.402,59           | 342.725,74           | 4.025.498,57          | 15.162,80          | 0,35%         | 0,37%      | 0,30%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...  | 4.014.636,51          | 8.702.119,69         | 8.984.370,67         | 3.764.747,46          | 32.361,93          | 0,25%         | 0,38%      | 0,29%        |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA               | 0,00                  | 280.547,60           | 0,00                 | 280.644,41            | 96,81              | 0,03%         | 0,99%      | 0,81%        |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN... | 0,01                  | 0,00                 | 0,00                 | 0,01                  | 0,00               | 0,00%         | -          | -            |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...  | 106.858.250,52        | 0,00                 | 0,00                 | 106.694.165,64        | -164.084,88        | -0,15%        | -0,15%     | 2,18%        |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA            | 106.284.965,97        | 0,00                 | 0,00                 | 106.069.193,28        | -215.772,69        | -0,20%        | -0,20%     | 2,08%        |
| WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA                  | 24.712.702,52         | 0,00                 | 0,00                 | 24.659.383,07         | -53.319,45         | -0,22%        | -0,22%     | 0,78%        |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA                | 21.526.527,60         | 0,00                 | 0,00                 | 21.417.364,03         | -109.163,57        | -0,51%        | -0,51%     | 2,33%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...  | 27.497.224,25         | 0,00                 | 14.000.000,00        | 13.263.634,66         | -233.589,59        | -0,85%        | -1,27%     | 3,71%        |
| ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP            | 11.573.728,05         | 0,00                 | 11.446.473,81        | 0,00                  | -127.254,24        | -1,10%        | -1,77%     | 3,49%        |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA         | 15.742.484,36         | 0,00                 | 0,00                 | 15.543.110,42         | -199.373,94        | -1,27%        | -1,27%     | 3,73%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                                | <b>451.344.814,44</b> | <b>23.707.675,97</b> | <b>34.818.403,40</b> | <b>440.116.059,59</b> | <b>-118.027,42</b> | <b>-0,03%</b> |            | <b>1,68%</b> |

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

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

| Ativos Renda Variável                           | Saldo Anterior        | Aplicações           | Resgates          | Saldo Atual           | Retorno (R\$)         | Retorno (%)   | (%) Instit | Var - Mês     |
|---|-----------------------|----------------------|-------------------|-----------------------|-----------------------|---------------|------------|---------------|
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11   | 466.366,97            | 0,00                 | 110.132,52        | 361.321,68            | 5.087,23              | 1,09%         | 0,00%      | -             |
| ÁQUILLA FII - AQLL11                            | 629.036,43            | 0,00                 | 0,00              | 631.147,21            | 2.110,78              | 0,34%         | 0,00%      | 0,00%         |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP           | 214.358,16            | 0,00                 | 0,00              | 213.704,78            | -653,38               | -0,30%        | -0,30%     | 0,00%         |
| PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP           | 6.691,82              | 0,00                 | 0,00              | 6.644,46              | -47,36                | -0,71%        | -          | -             |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 14.296.515,74         | 11.446.473,81        | 0,00              | 24.747.013,86         | -995.975,69           | -3,87%        | -4,64%     | 6,15%         |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                 | 6.912.858,33          | 0,00                 | 0,00              | 6.639.231,64          | -273.626,69           | -3,96%        | -3,96%     | 10,28%        |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                       | 31.495.138,46         | 0,00                 | 0,00              | 30.240.996,27         | -1.254.142,19         | -3,98%        | -3,98%     | 11,83%        |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES                        | 20.342.070,90         | 0,00                 | 0,00              | 19.410.275,89         | -931.795,01           | -4,58%        | -4,58%     | 10,03%        |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO      | 37.396.427,75         | 0,00                 | 0,00              | 35.675.508,68         | -1.720.919,07         | -4,60%        | -4,60%     | 6,16%         |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES                          | 23.229.701,19         | 0,00                 | 0,00              | 21.821.203,64         | -1.408.497,55         | -6,06%        | -6,06%     | 12,64%        |
| SANTANDER IBOVSPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES  | 9.522.917,97          | 0,00                 | 0,00              | 8.912.528,09          | -610.389,88           | -6,41%        | -6,41%     | 12,45%        |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                 | 16.854.849,10         | 0,00                 | 0,00              | 15.755.108,15         | -1.099.740,95         | -6,52%        | -6,52%     | 13,30%        |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES             | 29.456.299,80         | 0,00                 | 0,00              | 27.510.387,43         | -1.945.912,37         | -6,61%        | -6,61%     | 10,86%        |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                    | 17.406.259,76         | 0,00                 | 0,00              | 16.143.673,80         | -1.262.585,96         | -7,25%        | -7,25%     | 12,81%        |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                      | 28.881.006,55         | 0,00                 | 0,00              | 26.653.277,56         | -2.227.728,99         | -7,71%        | -7,71%     | 12,73%        |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES                   | 4.073.509,52          | 0,00                 | 0,00              | 3.647.675,43          | -425.834,09           | -10,45%       | -10,45%    | 15,27%        |
| <b>Total Renda Variável</b>                     | <b>241.184.008,45</b> | <b>11.446.473,81</b> | <b>110.132,52</b> | <b>238.369.698,57</b> | <b>-14.150.651,17</b> | <b>-5,60%</b> |            | <b>10,46%</b> |

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

| <b>Ativos Exterior</b>                                | <b>Saldo Anterior</b> | <b>Aplicações</b> | <b>Resgates</b> | <b>Saldo Atual</b>   | <b>Retorno (R\$)</b> | <b>Retorno (%)</b> | <b>(%) Instit</b> | <b>Var - Mês</b> |
|---|-----------------------|-------------------|-----------------|----------------------|----------------------|--------------------|-------------------|------------------|
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN... | 7.550.724,63          | 0,00              | 0,00            | 7.660.652,17         | 109.927,54           | 1,46%              | 1,46%             | 5,72%            |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT... | 23.009.679,99         | 0,00              | 0,00            | 23.315.781,79        | 306.101,80           | 1,33%              | 1,33%             | 6,11%            |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E... | 19.442.650,39         | 0,00              | 0,00            | 19.560.962,69        | 118.312,30           | 0,61%              | 0,61%             | 7,76%            |
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I                    | 28.219.948,08         | 0,00              | 0,00            | 28.360.391,11        | 140.443,03           | 0,50%              | 0,50%             | 6,82%            |
| <b>Total Exterior</b>                                 | <b>78.223.003,09</b>  | <b>0,00</b>       | <b>0,00</b>     | <b>78.897.787,76</b> | <b>674.784,67</b>    | <b>0,86%</b>       |                   | <b>6,74%</b>     |

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2021**
**FUNDOS DE RENDA FIXA**

| Ativos Renda Fixa                                      | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual             | Retorno (R\$)        | Retorno (%)   | (%) Instit |
|--|----------------|---------------|---------------|-------------------------|----------------------|---------------|------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...  | 16.670.079,46  | 15.292.549,22 | 0,00          | 32.308.028,83           | 345.400,15           | 1,08%         | 1,30%      |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP            | 0,00           | 21.096.606,09 | 0,00          | 21.353.270,19           | 256.664,10           | 1,22%         | 1,11%      |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...  | 9.972.505,37   | 0,00          | 0,00          | 10.077.532,58           | 105.027,21           | 1,05%         | 1,05%      |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 5.331.808,28   | 0,00          | 138.096,09    | 5.279.777,94            | 86.065,75            | 1,61%         | 1,66%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...  | 4.335.745,03   | 17.043.875,17 | 17.677.493,09 | 3.764.747,46            | 62.620,35            | 0,29%         | 0,89%      |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...  | 3.101.367,14   | 1.683.335,06  | 792.635,47    | 4.025.498,57            | 33.431,84            | 0,70%         | 0,87%      |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR                      | 182.259,94     | 0,00          | 44.833,18     | 149.723,68              | 12.296,92            | 6,75%         | -17,85%    |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA               | 0,00           | 280.547,60    | 0,00          | 280.644,41              | 96,81                | 0,03%         | 1,12%      |
| TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN... | 0,01           | 0,00          | 0,00          | 0,01                    | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%      |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA              | 27.904.947,41  | 0,00          | 0,00          | 27.841.751,59           | -63.195,82           | -0,23%        | -0,23%     |
| WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA                  | 25.063.800,68  | 0,00          | 0,00          | 24.659.383,07           | -404.417,61          | -1,61%        | -1,61%     |
| WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA                | 22.078.686,17  | 0,00          | 0,00          | 21.417.364,03           | -661.322,14          | -3,00%        | -3,00%     |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA         | 55.728.635,91  | 0,00          | 7.283.095,45  | 47.388.233,23           | -1.057.307,23        | -1,90%        | -1,87%     |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA         | 23.607.614,76  | 0,00          | 7.000.000,00  | 15.543.110,42           | -1.064.504,34        | -4,51%        | -4,34%     |
| ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP            | 26.630.601,10  | 0,00          | 25.446.473,81 | 0,00                    | -1.184.127,29        | -4,45%        | -5,50%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...  | 42.994.998,40  | 0,00          | 28.000.000,00 | 13.263.634,66           | -1.731.363,74        | -4,03%        | -4,33%     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...  | 108.495.638,59 | 0,00          | 0,00          | 106.694.165,64          | -1.801.472,95        | -1,66%        | -1,66%     |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA            | 108.012.005,68 | 0,00          | 0,00          | 106.069.193,28          | -1.942.812,40        | -1,80%        | -1,80%     |
|  |                |               |               | <b>Total Renda Fixa</b> | <b>-9.008.920,39</b> | <b>-1,68%</b> |            |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável                           | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates   | Saldo Atual                 | Retorno (R\$)         | Retorno (%)    | (%) Instit |
|---|----------------|---------------|------------|-----------------------------|-----------------------|----------------|------------|
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO      | 35.276.757,01  | 0,00          | 0,00       | 35.675.508,68               | 398.751,67            | 1,13%          | 1,13%      |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11   | 543.701,46     | 0,00          | 185.352,84 | 361.321,68                  | 2.973,06              | 0,55%          | -3,12%     |
| PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP           | 6.766,50       | 0,00          | 0,00       | 6.644,46                    | -122,04               | -1,80%         | -1,80%     |
| GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP           | 215.687,92     | 0,00          | 0,00       | 213.704,78                  | -1.983,14             | -0,92%         | -0,92%     |
| BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES                 | 0,00           | 7.000.000,00  | 0,00       | 6.639.231,64                | -360.768,36           | -5,15%         | -8,42%     |
| ÁQUILLA FII - AQLL11                            | 1.066.168,94   | 0,00          | 0,00       | 631.147,21                  | -435.021,73           | -40,80%        | 0,00%      |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 0,00           | 25.446.473,81 | 0,00       | 24.747.013,86               | -699.459,95           | -2,75%         | 1,14%      |
| BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES                   | 4.741.786,60   | 0,00          | 0,00       | 3.647.675,43                | -1.094.111,17         | -23,07%        | -23,07%    |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 10.184.884,20  | 0,00          | 0,00       | 8.912.528,09                | -1.272.356,11         | -12,49%        | -12,49%    |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                    | 18.846.515,05  | 0,00          | 0,00       | 16.143.673,80               | -2.702.841,25         | -14,34%        | -14,34%    |
| BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES                       | 33.077.339,62  | 0,00          | 0,00       | 30.240.996,27               | -2.836.343,35         | -8,57%         | -8,57%     |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                 | 18.490.983,28  | 230.370,86    | 0,00       | 15.755.108,15               | -2.966.245,99         | -15,84%        | -15,87%    |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES                        | 22.605.966,14  | 0,00          | 0,00       | 19.410.275,89               | -3.195.690,25         | -14,14%        | -14,14%    |
| CAIXA CONSUMO FI AÇÕES                          | 25.567.819,80  | 0,00          | 0,00       | 21.821.203,64               | -3.746.616,16         | -14,65%        | -14,65%    |
| ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES             | 31.920.203,12  | 0,00          | 0,00       | 27.510.387,43               | -4.409.815,69         | -13,82%        | -13,82%    |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                      | 31.119.714,86  | 0,00          | 0,00       | 26.653.277,56               | -4.466.437,30         | -14,35%        | -14,35%    |
|   |                |               |            | <b>Total Renda Variável</b> | <b>-27.786.087,76</b> | <b>-10,44%</b> |            |

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2021****FUNDOS EXTERIOR**

| Ativos Exterior                                       | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual           | Retorno (R\$)       | Retorno (%)  | (%) Instit |
|---|----------------|------------|----------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|
| WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I                    | 25.872.503,91  | 0,00       | 0,00     | 28.360.391,11         | 2.487.887,20        | 9,62%        | 9,62%      |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT... | 21.589.912,73  | 0,00       | 0,00     | 23.315.781,79         | 1.725.869,06        | 7,99%        | 7,99%      |
| SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN... | 6.959.969,36   | 0,00       | 0,00     | 7.660.652,17          | 700.682,81          | 10,07%       | 10,07%     |
| MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E... | 18.944.991,53  | 0,00       | 0,00     | 19.560.962,69         | 615.971,16          | 3,25%        | 3,25%      |
|   |                |            |          | <b>Total Exterior</b> | <b>5.530.410,23</b> | <b>7,54%</b> |            |

## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.