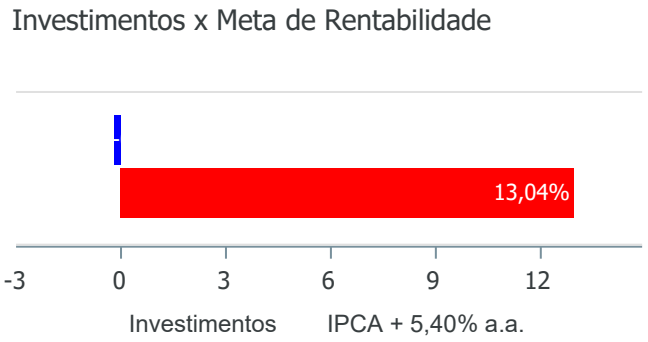
Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

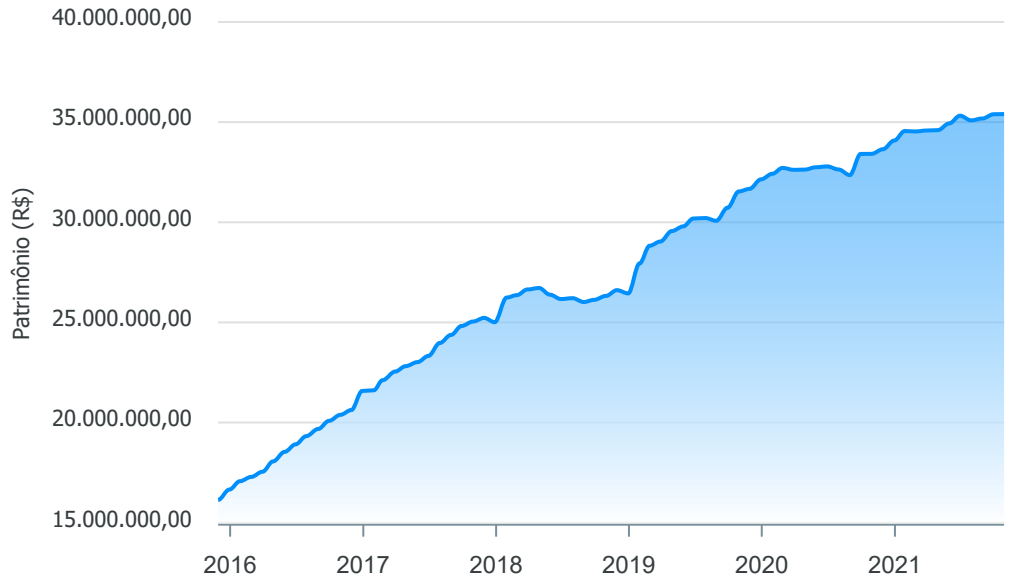
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	34.080.051,58	1.032.650,68	489.114,81	34.554.305,09	-69.282,36	-69.282,36	-0,20%	-0,20%	0,67%	0,67%	-29,90%	0,91%
Fevereiro	34.554.305,09	1.840.767,43	1.661.179,22	34.533.853,71	-200.039,59	-269.321,95	-0,58%	-0,77%	1,24%	1,92%	-40,42%	1,06%
Março	34.533.853,71	1.700.164,71	1.690.446,90	34.581.795,80	38.224,28	-231.097,67	0,11%	-0,67%	1,42%	3,36%	-19,79%	1,38%
Abril	34.581.795,80	986.115,84	1.176.926,53	34.599.650,37	208.665,26	-22.432,41	0,60%	-0,07%	0,73%	4,11%	-1,60%	1,02%
Maio	34.599.650,37	900.190,86	733.027,62	34.934.318,97	167.505,36	145.072,95	0,48%	0,42%	1,27%	5,44%	7,64%	1,02%
Junho	34.934.318,97	10.534.844,85	10.184.230,50	35.321.235,20	36.301,88	181.374,83	0,10%	0,52%	0,97%	6,46%	8,03%	1,15%
Julho	35.321.235,20	874.381,56	1.080.557,43	35.088.319,09	-26.740,24	154.634,59	-0,08%	0,44%	1,42%	7,98%	5,55%	1,13%
Agosto	35.088.319,09	838.001,84	687.159,31	35.182.260,32	-56.901,30	97.733,29	-0,16%	0,28%	1,33%	9,42%	2,98%	1,19%
Setembro	35.182.260,32	828.052,20	696.048,41	35.393.696,17	79.432,06	177.165,35	0,22%	0,51%	1,60%	11,18%	4,53%	0,97%
Outubro	35.393.696,17	894.314,68	643.761,00	35.401.428,60	-242.821,25	-65.655,90	-0,68%	-0,18%	1,67%	13,04%	-1,37%	1,50%



Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP
CEP: 04531-050 - Telefone: (11) 3168-0053

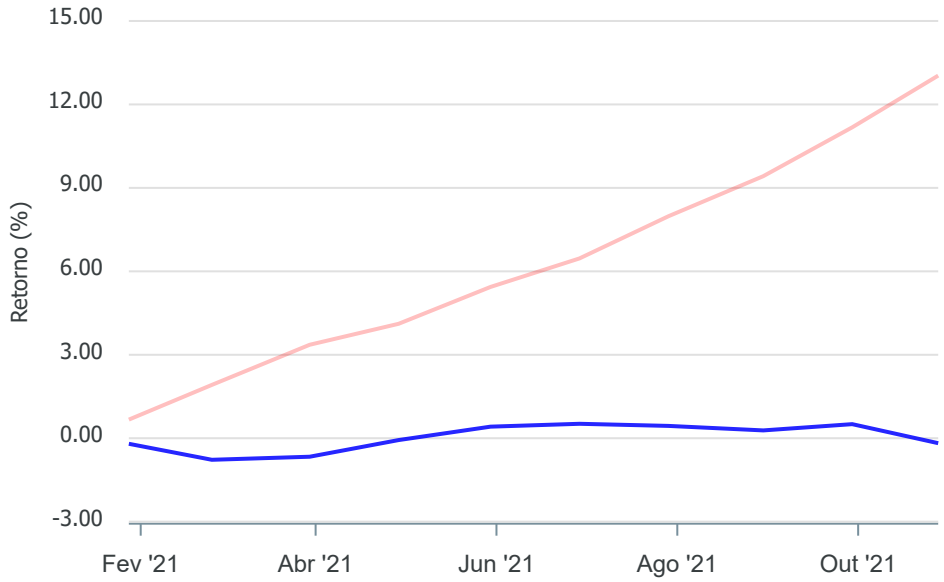
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP
CEP: 04531-050 - Telefone: (11) 3168-0053

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Outubro/2021 **FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.472.406,49	0,00	0,00	1.480.068,22	7.661,73	0,52%	0,52%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.377.971,31	0,00	0,00	4.399.985,22	22.013,91	0,50%	0,50%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.543.340,55	894.314,68	642.636,00	1.802.451,27	7.432,04	0,30%	0,40%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	416.521,40	0,00	0,00	414.454,73	-2.066,67	-0,50%	-0,50%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	41.112,45	0,00	0,00	40.908,43	-204,02	-0,50%	-0,50%	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	722.687,35	0,00	0,00	718.816,15	-3.871,20	-0,54%	-0,54%	0,73%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.153.367,42	0,00	0,00	1.147.077,64	-6.289,78	-0,55%	-0,55%	0,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.898.107,00	0,00	0,00	3.872.331,54	-25.775,46	-0,66%	-0,66%	0,96%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.149.893,43	0,00	0,00	4.112.699,50	-37.193,93	-0,90%	-0,90%	1,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.274.356,56	0,00	0,00	1.258.391,94	-15.964,62	-1,25%	-1,25%	1,89%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.270.828,02	0,00	0,00	1.254.628,00	-16.200,02	-1,27%	-1,27%	2,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.697.228,60	0,00	0,00	4.636.528,66	-60.699,94	-1,29%	-1,29%	1,97%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	3.458.670,61	0,00	0,00	3.409.015,57	-49.655,04	-1,44%	-1,44%	1,98%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.964.732,67	0,00	0,00	1.932.779,58	-31.953,09	-1,63%	-1,63%	1,99%
Total Renda Fixa	**30.441.223,86**	**894.314,68**	**642.636,00**	**30.480.136,45**	**-212.766,09**	**-0,69%**		**1,19%**

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP
CEP: 04531-050 - Telefone: (11) 3168-0053

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
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	333.197,25	0,00	0,00	357.157,14	23.959,89	7,19%	7,19%	5,72%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.429.582,36	0,00	0,00	2.438.868,71	9.286,35	0,38%	0,38%	0,24%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.007.804,21	0,00	0,00	1.007.085,01	-719,20	-0,07%	-0,07%	1,74%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	221.298,82	0,00	1.125,00	217.591,35	-2.582,47	-1,17%	-1,44%	10,29%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	296.682,62	0,00	0,00	281.781,98	-14.900,64	-5,02%	-5,02%	10,48%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	350.678,82	0,00	0,00	331.246,04	-19.432,78	-5,54%	-5,54%	11,11%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	51.184,58	0,00	0,00	47.785,25	-3.399,33	-6,64%	-6,64%	11,61%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	262.043,65	0,00	0,00	239.776,67	-22.266,98	-8,50%	-8,50%	12,19%
Total Renda Variável	**4.952.472,31**	**0,00**	**1.125,00**	**4.921.292,15**	**-30.055,16**	**-0,61%**		**3,40%**

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP
CEP: 04531-050 - Telefone: (11) 3168-0053

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.

Crédito & Mercado Engenharia Financeira.
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP
CEP: 04531-050 - Telefone: (11) 3168-0053