

---

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
**PORTO NACIONAL / TO**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**  
**DE**  
**INVESTIMENTOS**

**3º TRIMESTRE**  
**2021**

29 de outubro de 2021

## ÍNDICE

<b>1 – INTRODUÇÃO .....</b>	<b>3</b>
<b>2 – POLÍTICA DE INVESTIMENTOS e MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA .....</b>	<b>4</b>
<b>3 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO .....</b>	<b>5</b>
<b>4 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RENDA FIXA .....</b>	<b>12</b>
<b>5 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS .....</b>	<b>22</b>
5.1 - Melhor Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	24
5.2 - Pior Desempenho Trimestral dos Investimentos .....	25
<b>6 – ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO .....</b>	<b>26</b>
<b>7 – CONCLUSÃO .....</b>	<b>27</b>
7.1 - Rentabilidade da Carteira Trimestral .....	27
7.2 - Meta Atuarial .....	28
7.3 - Riscos .....	28
7.3.1 - Risco de Mercado .....	28
7.3.2 - Risco de Crédito .....	30
7.3.2.1 - Fundo de Investimento .....	30
7.3.2.2 - Instituição Financeira .....	30
7.3.3 - Risco de Liquidez .....	31
7.4 - Aderência ao PAI .....	32
7.4.1 - Perfil de Risco (Mercado) .....	32
7.4.2 - Risco de Crédito .....	33
7.4.3 - Risco de Liquidez .....	33
7.4.3.1 - Obrigações Previdenciárias - Curto Prazo .....	33
7.4.3.2 - Obrigações Previdenciárias - Médio e Longo Prazo .....	34



## 1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o Relatório Trimestral dos investimentos, referente ao 3º TRIMESTRE, sobre o desempenho das rentabilidades e os riscos das aplicações financeiras do PREVPORTO.

Este relatório vem atender o **Inciso V, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Trimestrais**, para acompanhamento dos riscos e desempenho das aplicações financeiras.

*Art. 3. V – Elaborar relatórios detalhados, no mínimo, trimestralmente, sobre a rentabilidade, os riscos das diversas modalidades de operações realizadas nas aplicações dos recursos dos RPPS e a aderência à política anual de investimentos e suas revisões e submetê-las as instâncias superiores de deliberação e controle.*

## 2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2021 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVPOR TO

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.695/2018	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.695/2018	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
<b>RENDA FIXA</b>								
1	Títulos Públicos	Art. 7º, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%	-	-	-
2	F.I. Refer. 100% em Títulos Públicos	Art. 7º, I, b (100%)	0,0%	77,7%	98,0%	60,5%	38.839.957,37	-
3	F.I. índice Mercado 100% em Títulos Público	Art. 7º, I, c (100%)	0,0%	0,0%	98,0%	-	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7º, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
5	F.I. refer. em Indicadores RF	Art. 7º, III, a (60%)	0,0%	0,0%	40,0%	-	-	-
6	F.I. em índices de RF	Art. 7º, III, b (60%)	0,0%	0,0%	40,0%	-	-	-
7	F.I. referenciado em Indicadores RF	Art. 7º, IV, a (40%)	0,0%	9,1%	40,0%	10,1%	6.460.516,13	-
8	F.I. em índices de RF	Art. 7º, IV, b (40%)	0,0%	0,0%	40,0%	-	-	-
9	LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	Art. 7º, V, b (20%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
10	CDB	Art. 7º, VI, a (15%)	0,0%	0,0%	13,0%	-	-	-
11	Poupança	Art. 7º, VI, b (15%)	0,0%	0,0%	2,0%	-	-	-
12	FIDC - Cota Sênior	Art. 7º, VII, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
13	F.I. em Crédito Privado	Art. 7º, VII, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
14	F.I. em Debêntures	Art. 7º, VII, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
15	<b>TOTAL - RENDA FIXA</b>					<b>70,5%</b>	<b>45.300.473,50</b>	
<b>RENDA VARIÁVEL</b>								
16	F.I. em índices de RV (mín. 50 ações)	Art. 8º, I, a (30%)	0,0%	3,8%	14,0%	3,5%	2.231.054,36	-
17	F.I. em índices de Mercado RV (m. 50 ações)	Art. 8º, I, b (30%)	0,0%	0,0%	10,0%	-	-	-
18	F.I. em ações	Art. 8º, II, a (20%)	0,0%	3,2%	13,0%	10,2%	6.580.437,12	-
19	F.I. em índices de Mercado RV	Art. 8º, II, b (20%)	0,0%	0,0%	10,0%	-	-	-
20	F.I. Multimercados	Art. 8º, III (10%)	0,0%	3,7%	10,0%	6,1%	3.911.261,37	-
21	F.I. em Participações	Art. 8º, IV, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
22	F.I. Imobiliário negociado em bolsa	Art. 8º, IV, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
23	F.I.C Ações - Mercado de Acesso	Art. 8º, IV, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	-	-	-
24	<b>TOTAL - RENDA VARIÁVEL</b>	Art. 8º, § 1 (30%)				<b>19,8%</b>	<b>12.722.752,85</b>	
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>								
25	F.I.C em Dívida Externa	Art. 9º A, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	-	-	-
26	F.I.C em Investimento no Exterior	Art. 9º A, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	1,5%	989.209,70	-
27	F.I. Ações - BDR Nível I	Art. 9º A, III (10%)	0,0%	2,5%	10,0%	7,9%	5.041.707,28	-
28	<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	Art. 9º A (10%)				<b>9,4%</b>	<b>6.030.916,98</b>	
29	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
30	CONTA CORRENTE	-				0,3%	166.944,81	-
31	<b>PATRIMÔNIO TOTAL</b>					<b>100,0%</b>	<b>64.221.088,14</b>	

### 3-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI
<b>CNPJ</b>	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	03.543.447/0001-03
<b>SEGMENTO</b>	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Renda Fixa	Renda Fixa Índices	Previdência Renda Fixa	Renda Fixa Índices
<b>ÍNDICE</b>	CDI	IRF – M 1	IDKA 2	IMA - B 5
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>GESTOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
<b>CUSTODIANTE</b>	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001-91
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
<b>AUDITORIA</b>	KPMG Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	KPMG Auditores independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	17/12/1999
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,30% a.a.	0,20% a.a.	0,20%a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1.000,00	1.000,00	10.000,00	1.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>0,01</b>	<b>Qualquer valor</b>	<b>Qualquer valor</b>	<b>0,01</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,01	Qualquer valor	Qualquer valor	0,01
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	2 - Baixo	2 - Baixo	1 - Muito baixo	4 - Alto
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a (40% e 20% por fundo)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I
CNPJ	35.292.588/0001-89	07.111.384/0001-69	09.005.805/0001-00	22.632.237/0001-28
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Renda Fixa Índices	Ações IBOVESPA Ativo	Ações Livre
ÍNDICE	IPCA	IRF – M	IBOV	IBOV
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Investidores	Pessoas físicas e jurídicas
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CNPJ	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Banco do Brasil S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	30.822.936/0001-69	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	BANCO DO BRASIL S.A.
CNPJ	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001.91
AUDITORIA	KPMG Auditores Independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores independentes	Deloitte Touche Tohmatsu Auditores Independentes	KPMG Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	16/03/2020	08/12/2004	02/10/2007	29/12/2015
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,50% a.a.	0,20% a.a.	2,00% a.a.	1,90% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00	10.000,00	Qualquer valor	200,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	1.000,00	Qualquer valor	Qualquer valor	200,00
RESGATE MÍNIMO	1.000,00	Qualquer valor	Qualquer valor	200,00
SALDO MÍNIMO	1.000,00	Qualquer valor	Qualquer valor	200,00
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO*	3 - Médio	4 - Alto	5 - Muito Alto	5 - Muito Alto
ENQUADRAMENTO LEGAL	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º A, III (10%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	BB AÇÕES AGRO FIC FI	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO
<b>CNPJ</b>	05.100.213/0001-09	39.272.865/0001-42	40.054.357/0001-77	03.737.206/0001-97
<b>SEGMENTO</b>	Renda Variável	Investimento no Exterior	Renda Variável	Renda Fixa
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Ações Livre	Fundo de Ações	Fundo de Ações	Referenciado – DI
<b>ÍNDICE</b>	IBOV	BDRX	IBOV	CDI
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Pessoas físicas e jurídicas	Pessoas físicas e jurídicas e Regimes Próprios de	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	BB Gestão de Recursos DTVM s.a	VITER-Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001.91	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	00.360.305/0001-04
<b>CUSTODIANTE</b>	BANCO DO BRASIL S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	BANCO DO BRASIL S.A.	Banco do Brasil S.A.	Banco do Brasil S.A.	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.000.000/0001.91	00.000.000/0001-91	00.000.000/0001-91	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	KPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes	Ernst & Young Terco Auditores Independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	22/07/2002	30/11/2020	11/02/2021	05/07/2006
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	3,00% a.a.	0,85% a.a.	1,00% a.a.	0,20% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	20% IBOV	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	200,00	0,01	0,01	50.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>200,00</b>	<b>0,01</b>	<b>0,01</b>	<b>1.000,00</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	200,00	0,01	0,01	1.000,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	200,00	0,01	0,01	1.000,00
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+2 (Dois dias úteis após a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	5 - Muito Alto	4 - Alto	4 - Alto	2 - Baixo
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º A, III (10%)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a (40% e 20% por fundo)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF
<b>CNPJ</b>	10.740.670/0001-06	14.386.926/0001-71	11.060.913/0001-10	23.215.097/0001-55
<b>SEGMENTO</b>	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Renda Fixa Duração Livre Soberano
<b>ÍNDICE</b>	IRF – M 1	IDKA 2	IMA - B 5	IPCA
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprio de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>CUSTODIANTE</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	kPMG Auditores independentes	kPMG Auditores independentes	kPMG Auditores independentes	PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	28/05/2010	16/08/2012	09/07/2010	04/11/2016
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,40% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1.000,00	1.000,00	1.000,00	R\$ 1.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	2 - Baixo	3 - Médio	2 - Baixo	3 - Médio
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.



INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP
<b>CNPJ</b>	14.508.605/0001-00	10.577.503/0001-88	10.740.658/0001-93	30.036.235/0001-02
<b>SEGMENTO</b>	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Variável
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Renda Fixa Índices	Renda Fixa índices	Renda Fixa índices	Multimercados Dinâmico
<b>ÍNDICE</b>	IRF – M	IMA – B 5 +	IMA – B	S&P500
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Regimes Próprios de Previdência Social	Investidores Qualificados	Regimes Próprios de Previdência Social	Regimes Próprios de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>CUSTODIANTE</b>	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	Ernst & Young Terco Auditores Independentes S/S	Ernst & Young Terco Auditores Independentes	kPMG Auditores independentes	KPMG Auditores Independentes
<b>DATA DE INÍCIO</b>	16/08/2012	18/04/2012	08/03/2010	16/10/2018
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,20% a.a.	0,80% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1.000,00	1.000,00	1.000,00	10.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	Qualquer valor	Qualquer valor	0,00	1.000,00
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	Qualquer valor	Qualquer valor	0,00	1.000,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	Qualquer valor	Qualquer valor	0,00	5.000,00
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	3 - Médio	3 - Médio	3 - Médio	4 - Alto
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Refer. 100% Títulos TN - Art. 7º, I, b (100%) (exc. Tx. de 1 dia)	FI Multimercado - aberto - Art. 8º, III (10%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR
<b>CNPJ</b>	15.154.236/0001-50	30.068.169/0001-44	30.068.224/0001-04	39.528.038/0001-77
<b>SEGMENTO</b>	Renda Variável	Renda Variável	Renda Variável	Renda Variável
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Ações	Ações	AÇÕES LIVRE	Multimercado Investimento no Exterior
<b>ÍNDICE</b>	IBOV	IBOV	IBOV	Multimercado
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público em Geral	Regime Próprio de Previdência Social	Investidores em Geral	Regimes Próprio de Previdência Social
<b>ADMINISTRADOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>GESTOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>CUSTODIANTE</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>DISTRIBUIDOR</b>	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal	Caixa Econômica Federal
<b>CNPJ</b>	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04	00.360.305/0001-04
<b>AUDITORIA</b>	Ernst & Young Terco Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes	KPMG Auditores Independentes	0
<b>DATA DE INÍCIO</b>	27/11/2012	31/07/2019	25/06/2019	11/11/2020
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,50% a.a.	2,00% a.a.	1,50% a.a.	1,00% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	10.000,00	50.000,00	50.000,00	25.000,00
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	<b>1.000,00</b>	<b>25.000,00</b>	<b>1.000,00</b>	<b>0</b>
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	1.000,00	25.000,00	1.000,00	0,00
<b>SALDO MÍNIMO</b>	5.000,00	50.000,00	1.000,00	0
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não se aplica
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+4 (Quatro dias úteis após a solicitação)	D+13 (Treze dias úteis após a solicitação)	D+25 (Vinte e cinco dias úteis após a solicitação)	D+7 (Sete dias úteis após a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO*</b>	5 - Muito Alto	4 - Alto	4 - Alto	Não Disponibilizado pela Instituição
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	FI em índices de RV - Art. 8º, I, a (30%, 20% por fundo)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	FI em Ações - Art. 8º, II, a (20%)	FIC - Aberto - Investimento no Exterior, Art. 9º A, II (10%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

INFORMAÇÕES	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I			
CNPJ	17.502.937/0001-68			
SEGMENTO	Investimento no Exterior			
CLASSIFICAÇÃO	Ações Livre			
ÍNDICE	BDR			
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de			
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal			
CNPJ	00.360.305/0001-04			
GESTOR	Caixa Econômica Federal			
CNPJ	00.360.305/0001-04			
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal			
CNPJ	00.360.305/0001-04			
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal			
CNPJ	00.360.305/0001-04			
AUDITORIA	KPMG Auditores Independentes			
DATA DE INÍCIO	24/06/2013			
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,70% a.a.			
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui			
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00			
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00			
RESGATE MÍNIMO	100,00			
SALDO MÍNIMO	500,00			
CARÊNCIA	Não possui			
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)			
RISCO DE MERCADO*	4 - Alto			
ENQUADRAMENTO LEGAL	Fundo de Ações BDR Nível 1 - Art. 9º A, III			

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

#### 4.1 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	4.599.445,61	-	-	20.777,69	4.620.223,30	0,450%
AGOSTO	4.620.223,30	-	-	22.678,19	4.642.901,49	0,488%
SETEMBRO	4.642.901,49	-	-	24.595,70	4.667.497,19	0,527%

FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	4.203.042,22	-	-	32.599,66	4.170.442,56	-0,782%
AGOSTO	4.170.442,56	-	-	60.454,05	4.109.988,51	-1,471%
SETEMBRO	4.109.988,51	-	-	14.588,53	4.124.577,04	0,354%

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	8.417.982,58	-	-	5.466,45	8.412.516,13	-0,065%
AGOSTO	8.412.516,13	-	-	16.347,49	8.428.863,62	0,194%
SETEMBRO	8.428.863,62	-	-	90.889,63	8.519.753,25	1,067%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP							
4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JULHO	4.932.338,44	-	-	19.662,32	4.912.676,12	-0,400%	
AGOSTO	4.912.676,12	-	-	55.863,19	4.856.812,93	-1,150%	
SETEMBRO	4.856.812,93	-	-	7.565,75	4.849.247,18	-0,156%	

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP							
5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JULHO	7.833.597,44	-	-	1.088,90	7.834.686,34	0,014%	
AGOSTO	7.834.686,34	-	-	10.486,00	7.845.172,34	0,134%	
SETEMBRO	7.845.172,34	-	-	76.966,26	7.922.138,60	0,972%	

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP							
6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JULHO	2.089.111,67	-	-	15.979,24	2.073.132,43	-0,771%	
AGOSTO	2.073.132,43	-	-	48.855,93	2.024.276,50	-2,414%	
SETEMBRO	2.024.276,50	-	-	25.610,61	1.998.665,89	-1,281%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP							
7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JULHO	1.040.196,67	-	-	4.877,40	1.035.319,27	-0,471%	
AGOSTO	1.035.319,27	-	-	6.556,67	1.028.762,60	-0,637%	
SETEMBRO	1.028.762,60	-	-	3.797,43	1.024.965,17	-0,370%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF							
8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JULHO	833.497,62	-	150.000,00	1.374,28	684.871,90	0,201%	
AGOSTO	684.871,90	-	215.000,00	2.182,89	472.054,79	0,462%	
SETEMBRO	472.054,79	-	250.000,00	1.646,52	223.701,31	0,736%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF							
9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JULHO	202.618,62	-	52.000,00	332,71	150.951,33	0,220%	
AGOSTO	150.951,33	-	36.000,00	490,22	115.441,55	0,425%	
SETEMBRO	115.441,55	-	60.000,00	395,42	55.836,97	0,708%	

FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF							
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno	
JULHO	26,59	-	-	0,04	26,63	0,150%	
AGOSTO	26,63	-	-	0,09	26,72	0,337%	
SETEMBRO	26,72	-	-	0,10	26,82	0,373%	

## 4.2 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - BANCO DO BRASIL

BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI						
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	3.916.758,58	-	-	884,53	3.917.643,11	0,023%
AGOSTO	3.917.643,11	-	-	4.058,48	3.921.701,59	0,103%
SETEMBRO	3.921.701,59	-	-	38.337,97	3.960.039,56	0,968%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	954.653,19	-	-	4.761,17	949.892,02	-0,501%
AGOSTO	949.892,02	-	-	6.131,48	943.760,54	-0,650%
SETEMBRO	943.760,54	-	-	3.546,93	940.213,61	-0,377%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI						
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	1.668.246,11	474.000,00	54.000,00	2.809,65	2.091.055,76	0,134%
AGOSTO	2.091.055,76	-	8.000,00	6.969,10	2.090.024,86	0,333%
SETEMBRO	2.090.024,86	-	3.600,00	7.642,66	2.094.067,52	0,365%



**BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI**

14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	2.219.924,56	-	-	1.852,74	2.221.777,30	0,083%
AGOSTO	2.221.777,30	-	-	3.965,15	2.225.742,45	0,178%
SETEMBRO	2.225.742,45	-	-	23.001,86	2.248.744,31	1,023%

**BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI**

15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	882.028,06	-	-	980,57	881.047,49	-0,111%
AGOSTO	881.047,49	-	-	4.007,66	877.039,83	-0,457%
SETEMBRO	877.039,83	-	-	940,31	877.980,14	0,107%

**BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI**

16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	-	-	-	-	-	-
AGOSTO	-	1.000.000,00	-	996,35	1.000.996,35	0,100%
SETEMBRO	1.000.996,35	785.931,32	-	6.091,27	1.793.018,94	0,340%

### 4.3 - MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA - RF - RENDA VARIÁVEL

#### BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI

16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	1.494.482,10	200.000,00	-	42.879,32	1.651.602,78	-2,869%
AGOSTO	1.651.602,78	-	-	11.055,41	1.640.547,37	-0,669%
SETEMBRO	1.640.547,37	-	-	24.039,18	1.616.508,19	-1,465%

#### BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I

17	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	2.869.504,78	-	-	150.439,13	3.019.943,91	5,243%
AGOSTO	3.019.943,91	-	-	90.609,43	3.110.553,34	3,000%
SETEMBRO	3.110.553,34	-	-	19.301,79	3.129.855,13	0,621%

#### FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA

18	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	2.544.847,72	-	-	101.456,89	2.443.390,83	-3,987%
AGOSTO	2.443.390,83	-	-	57.878,64	2.385.512,19	-2,369%
SETEMBRO	2.385.512,19	-	-	154.457,83	2.231.054,36	-6,475%

**FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO**

<b>19</b>	<b>SALDO INICIAL (R\$)</b>	<b>Aportes (R\$)</b>	<b>Resgates (R\$)</b>	<b>Rentabilidade (R\$)</b>	<b>SALDO FINAL (R\$)</b>	<b>Taxa de Retorno</b>
<b>JULHO</b>	<b>2.311.203,89</b>	-	-	107.642,21	<b>2.203.561,68</b>	<b>-4,657%</b>
<b>AGOSTO</b>	<b>2.203.561,68</b>	-	-	65.093,78	<b>2.138.467,90</b>	<b>-2,954%</b>
<b>SETEMBRO</b>	<b>2.138.467,90</b>	-	-	80.100,93	<b>2.058.366,97</b>	<b>-3,746%</b>

**FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP**

<b>20</b>	<b>SALDO INICIAL (R\$)</b>	<b>Aportes (R\$)</b>	<b>Resgates (R\$)</b>	<b>Rentabilidade (R\$)</b>	<b>SALDO FINAL (R\$)</b>	<b>Taxa de Retorno</b>
<b>JULHO</b>	<b>3.522.801,21</b>	-	-	92.588,96	<b>3.615.390,17</b>	<b>2,628%</b>
<b>AGOSTO</b>	<b>3.615.390,17</b>	310.000,00	-	124.186,63	<b>4.049.576,80</b>	<b>3,435%</b>
<b>SETEMBRO</b>	<b>4.049.576,80</b>	52.019,87	-	190.335,30	<b>3.911.261,37</b>	<b>-4,700%</b>

**FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR**

<b>21</b>	<b>SALDO INICIAL (R\$)</b>	<b>Aportes (R\$)</b>	<b>Resgates (R\$)</b>	<b>Rentabilidade (R\$)</b>	<b>SALDO FINAL (R\$)</b>	<b>Taxa de Retorno</b>
<b>JULHO</b>	<b>657.411,97</b>	-	-	31.621,94	<b>625.790,03</b>	<b>-4,810%</b>
<b>AGOSTO</b>	<b>625.790,03</b>	-	-	17.409,86	<b>608.380,17</b>	<b>-2,782%</b>
<b>SETEMBRO</b>	<b>608.380,17</b>	-	-	33.607,51	<b>574.772,66</b>	<b>-5,524%</b>

### BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I

22	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	967.771,55	-	-	78.783,23	888.988,32	-8,141%
AGOSTO	888.988,32	-	-	27.680,94	916.669,26	3,114%
SETEMBRO	916.669,26	-	-	39.530,15	877.139,11	-4,312%

### FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR

23	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	950.097,33	-	-	38.462,59	988.559,92	4,048%
AGOSTO	988.559,92	-	-	7.980,53	996.540,45	0,807%
SETEMBRO	996.540,45	-	-	7.330,75	989.209,70	-0,736%

### BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI

24	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	1.243.624,11	-	-	55.350,42	1.188.273,69	-4,451%
AGOSTO	1.188.273,69	-	-	34.114,14	1.154.159,55	-2,871%
SETEMBRO	1.154.159,55	622.431,32	-	110.150,62	1.666.440,25	-9,544%

### FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

25	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	960.578,41	-	-	52.066,95	1.012.645,36	5,420%
AGOSTO	1.012.645,36	-	-	24.661,95	1.037.307,31	2,435%
SETEMBRO	1.037.307,31	-	-	2.594,27	1.034.713,04	-0,250%

### BB AÇÕES AGRO FIC FI

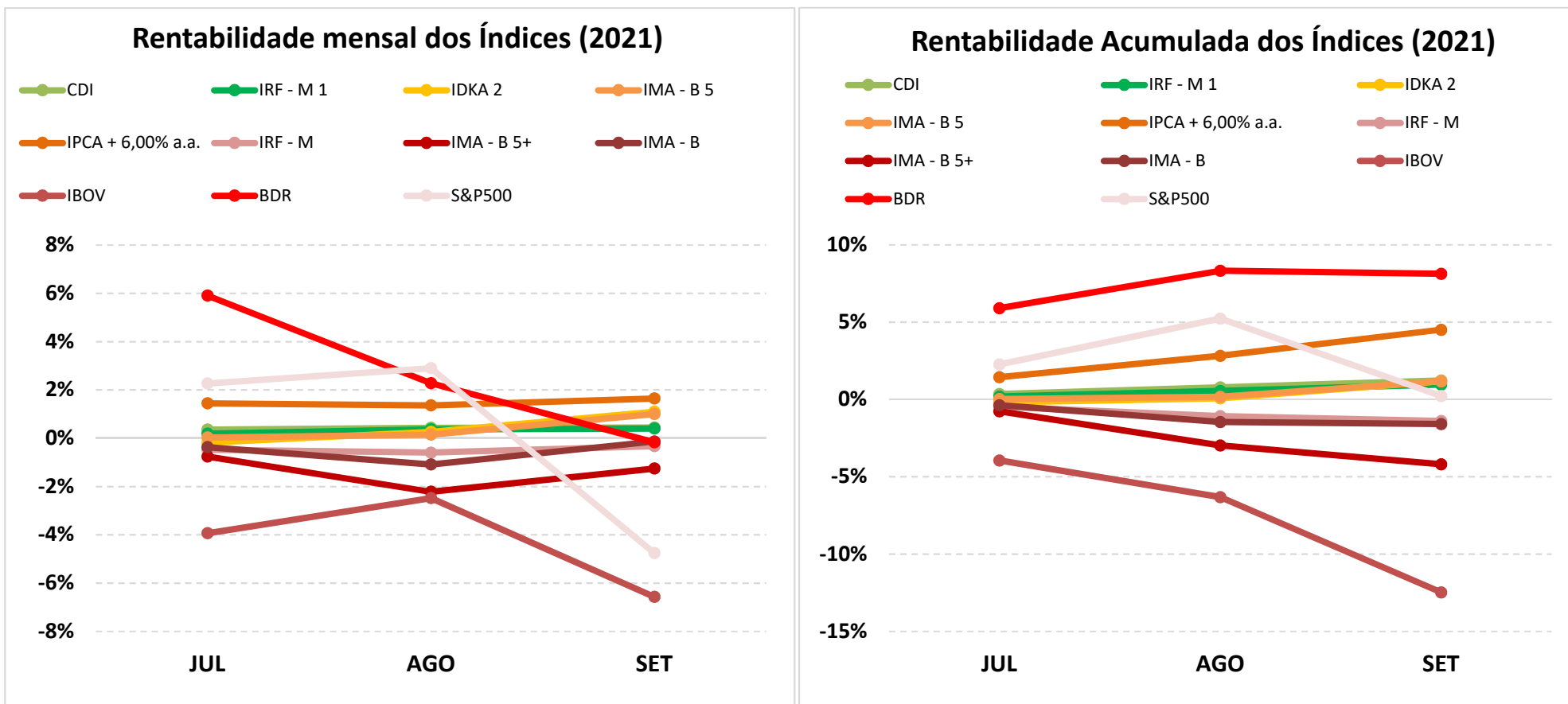
26	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JULHO	-	674.000,00	-	7.385,92	666.614,08	-1,096%
AGOSTO	666.614,08	-	-	22.918,36	643.695,72	-3,438%
SETEMBRO	643.695,72	-	-	20.653,33	664.349,05	3,209%

## 5-TABELA DE RENTABILIDADE

INVESTIMENTOS	JUL	AGO	SET	ACUMULADO
BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,39%	0,45%	0,46%	<b>1,30%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	0,16%	0,33%	0,37%	<b>0,87%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	0,08%	0,18%	1,03%	<b>1,30%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	0,02%	0,10%	0,98%	<b>1,10%</b>
BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	-0,11%	-0,45%	0,11%	<b>-0,46%</b>
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	-0,50%	-0,65%	-0,38%	<b>-1,51%</b>
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	-4,45%	-2,87%	-7,71%	<b>-14,35%</b>
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5,24%	3,00%	0,62%	<b>9,07%</b>
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	-2,57%	-0,67%	-1,47%	<b>-4,64%</b>
BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	-8,14%	3,11%	-4,31%	<b>-9,36%</b>
BB AÇÕES AGRO FIC FI	-2,74%	-3,44%	3,29%	<b>-3,00%</b>
FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	0,45%	0,49%	0,53%	<b>1,48%</b>
FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	0,17%	0,34%	0,37%	<b>0,88%</b>
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	-0,06%	0,19%	1,07%	<b>1,20%</b>
FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	0,01%	0,13%	0,98%	<b>1,13%</b>
FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	-0,78%	-1,45%	0,35%	<b>-1,87%</b>
FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	-0,47%	-0,63%	-0,37%	<b>-1,46%</b>
FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	-0,76%	-2,36%	-1,27%	<b>-4,33%</b>
FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	-0,40%	-1,14%	-0,15%	<b>-1,68%</b>
FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2,63%	3,34%	-4,63%	<b>1,14%</b>
FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	-3,99%	-2,37%	-6,47%	<b>-12,33%</b>
FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	-4,66%	-2,95%	-3,75%	<b>-10,94%</b>
FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	-4,81%	-2,78%	-5,52%	<b>-12,57%</b>
FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR	4,05%	0,81%	-0,74%	<b>4,12%</b>
FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	5,42%	2,44%	-0,25%	<b>7,72%</b>
<b>CDI</b>	<b>0,36%</b>	<b>0,43%</b>	<b>0,44%</b>	<b>1,24%</b>
<b>IRF - M 1</b>	<b>0,19%</b>	<b>0,37%</b>	<b>0,40%</b>	<b>0,96%</b>
<b>IDKA 2</b>	<b>-0,18%</b>	<b>0,26%</b>	<b>1,10%</b>	<b>1,18%</b>
<b>IMA - B 5</b>	<b>0,03%</b>	<b>0,15%</b>	<b>1,00%</b>	<b>1,18%</b>
<b>IPCA + 6,00% a.a.</b>	<b>1,45%</b>	<b>1,36%</b>	<b>1,65%</b>	<b>4,52%</b>
<b>IRF - M</b>	<b>-0,47%</b>	<b>-0,60%</b>	<b>-0,33%</b>	<b>-1,39%</b>
<b>IMA - B 5+</b>	<b>-0,76%</b>	<b>-2,22%</b>	<b>-1,26%</b>	<b>-4,19%</b>
<b>IMA - B</b>	<b>-0,37%</b>	<b>-1,09%</b>	<b>-0,13%</b>	<b>-1,59%</b>
<b>IBOV</b>	<b>-3,94%</b>	<b>-2,48%</b>	<b>-6,57%</b>	<b>-12,48%</b>
<b>BDR</b>	<b>5,91%</b>	<b>2,28%</b>	<b>-0,17%</b>	<b>8,14%</b>
<b>S&amp;P500</b>	<b>2,27%</b>	<b>2,90%</b>	<b>-4,76%</b>	<b>0,23%</b>



## GRÁFICO COMPARATIVO DE RENTABILIDADE DOS ÍNDICES



## 5.1-MELHOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

### COMPORTAMENTO MENSAL

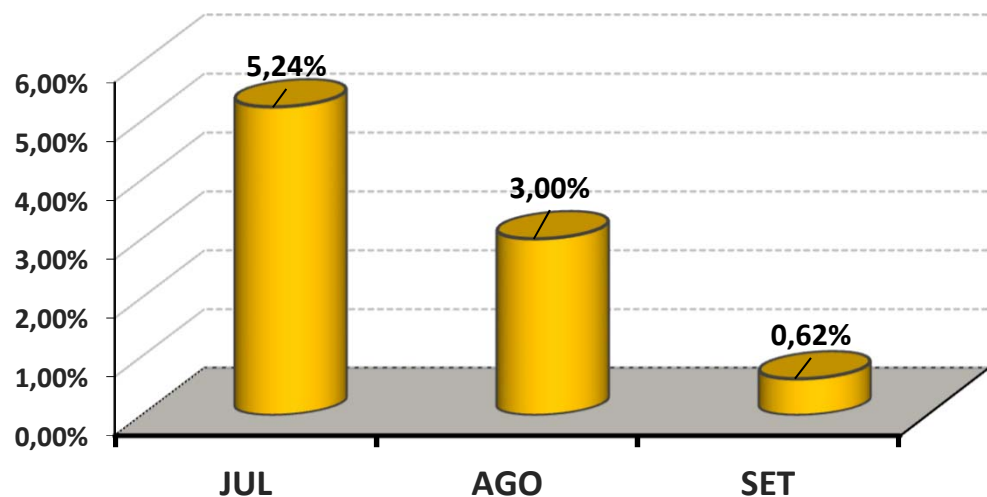
FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5,24%	3,00%	0,62%

### COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5,24%	8,40%	9,07%

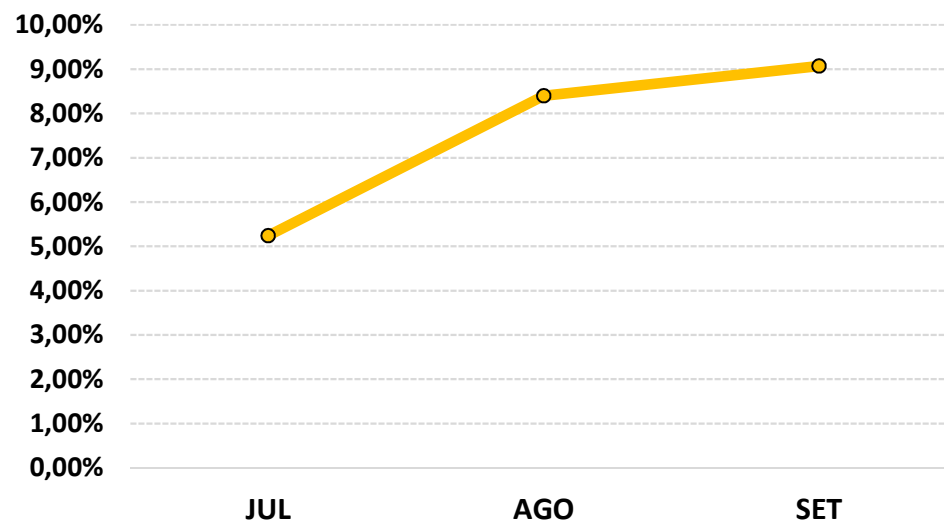
#### Comportamento MENSAL no Trimestre

■ BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I



#### Comportamento ACUMULADO no Trimestre

● BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I





## 5.2-PIOR DESEMPENHO TRIMESTRAL DOS INVESTIMENTOS

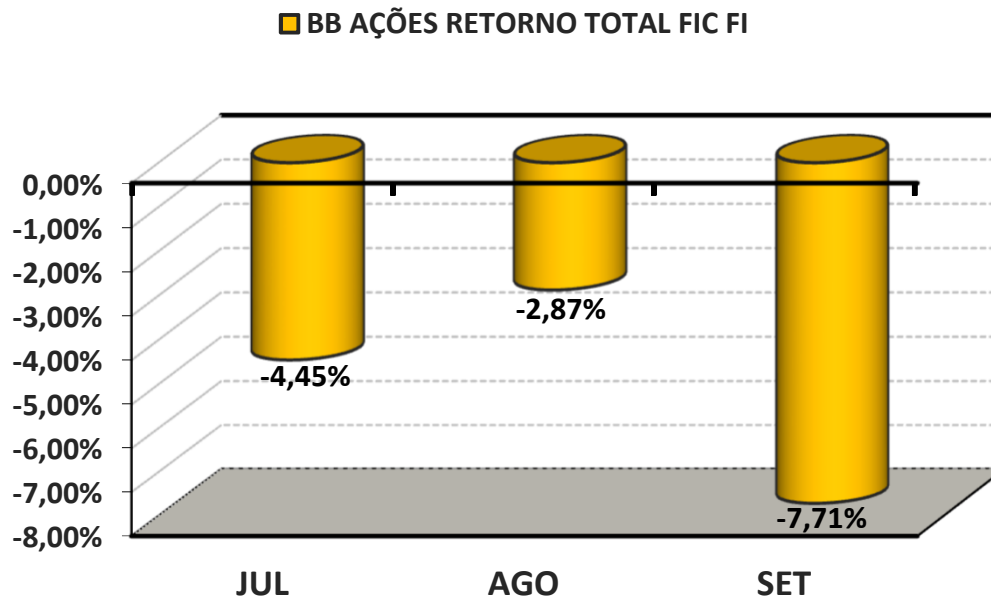
### COMPORTAMENTO MENSAL

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	-4,45%	-2,87%	-7,71%

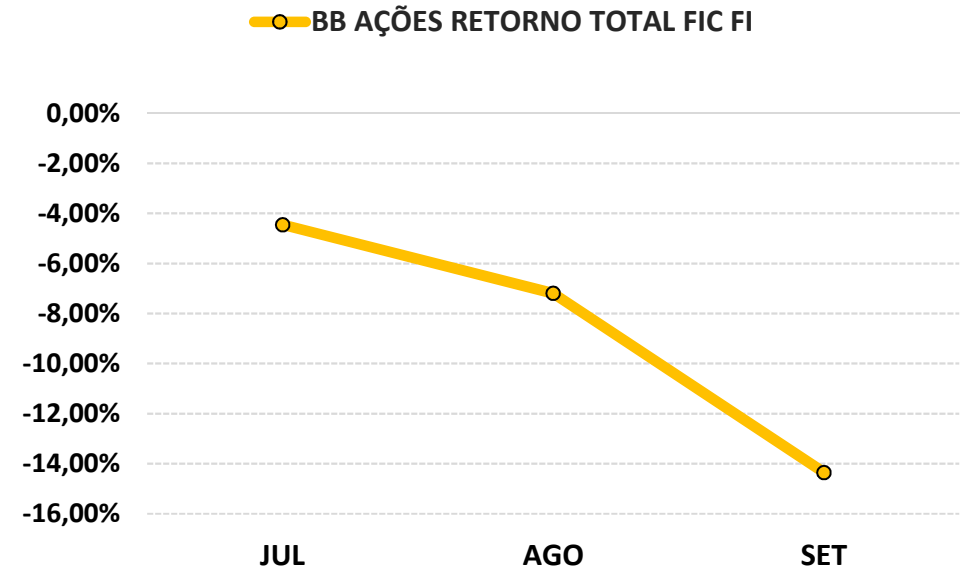
### COMPORTAMENTO ACUMULADO

FUNDO DE INVESTIMENTO	JUL	AGO	SET
BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	-4,45%	-7,19%	-14,35%

#### Comportamento MENSAL no Trimestre



#### Comportamento ACUMULADO no Trimestre



**6-ANÁLISE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - 3º TRIMESTRE - 2021**

	JUL	AGO	SET
<b>MENSAL</b>	-0,24%	-0,08%	-0,57%
<b>CDI</b>	0,36%	0,43%	0,44%
<b>IBOVESPA</b>	-3,94%	-2,48%	-6,57%
<b>META ATUARIAL</b>	1,40%	1,31%	1,60%

	JUL	AGO	SET
<b>ACUMULADO DO TRIMESTRE</b>	-0,24%	-0,31%	-0,88%
<b>CDI</b>	0,36%	0,79%	1,24%
<b>IBOVESPA</b>	-3,94%	-6,32%	-12,48%
<b>META ATUARIAL</b>	1,40%	2,73%	4,38%

**RENTABILIDADE ACUMULADA DO TRIMESTRE DO PREVPOR TO: R\$ (551.430,21)****META ATUARIAL ACUMULADA DO TRIMESTRE: R\$ 2.690.779,47****DEFASAGEM PARA O CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL R\$ (3.242.209,68)**

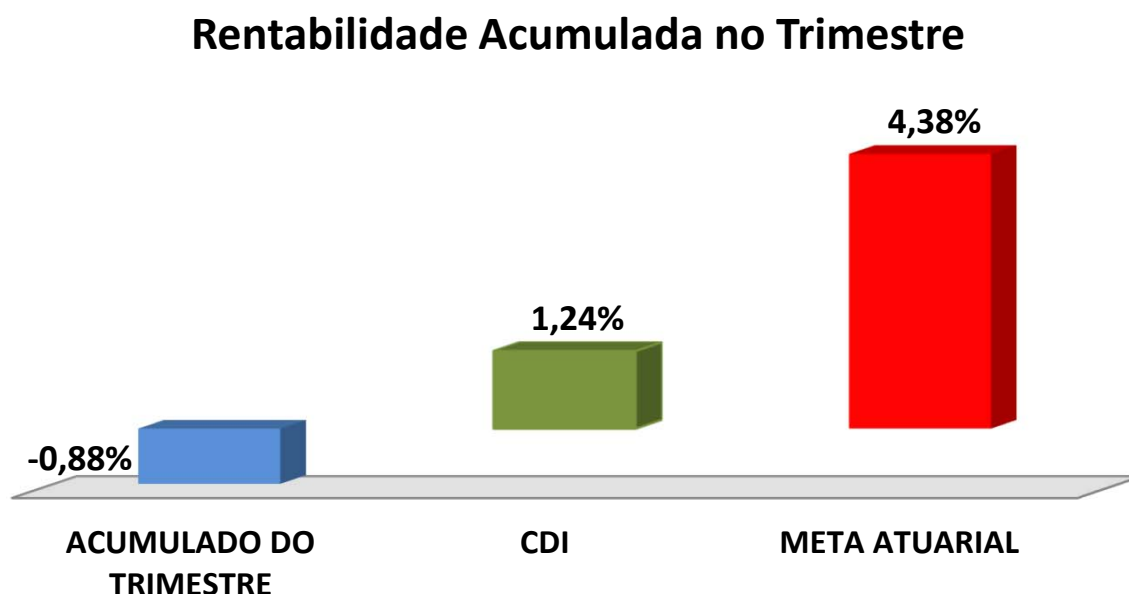
## 7-CONCLUSÃO

Atendendo o Art. 3, V, da Portaria MPS 519, detalhado na página 3 deste relatório, segue abaixo uma análise da Carteira de Investimento do PREVPORTO, no 3º Trimestre/2021, analisando rentabilidade, risco das operações e aderência ao PAI/2021.

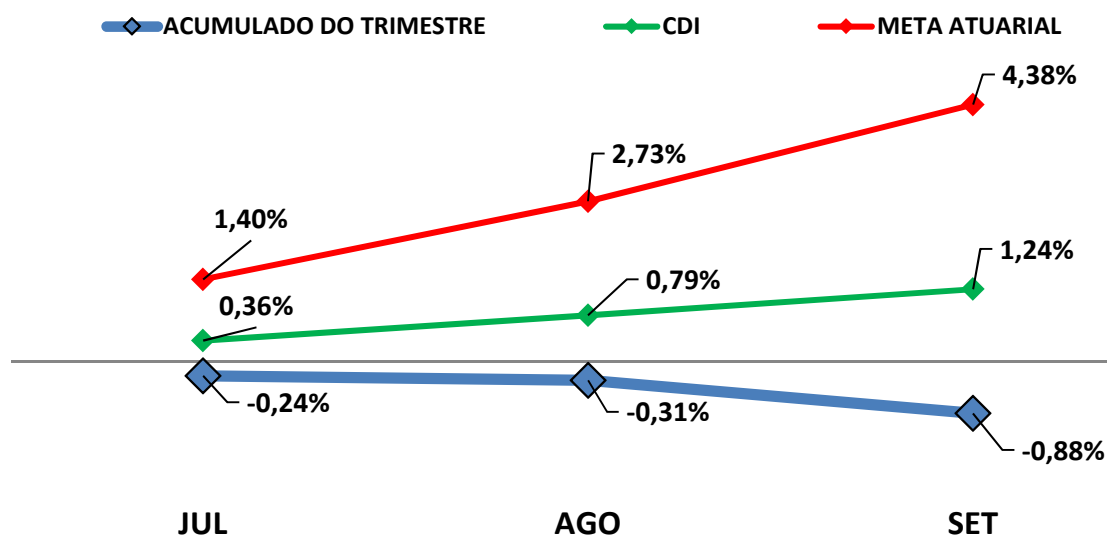
### 7.1.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA TRIMESTRAL

A Carteira de Investimentos do PREVPORTO, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada no trimestre de -0,88% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado no trimestre de 1,24% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou no período, uma rentabilidade de -71,11% sobre o índice de referência do mercado.

#### GRÁFICO DA RENTABILIDADE DA CARTEIRA X META ATUARIAL



## Rentabilidade Acumulada no Trimestre



### 7.2-META ATUARIAL

Enquanto a rentabilidade acumulada no trimestre do PREVPORTO é de -0,88% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 4,38%, representando -20,05% sobre a Meta Atuarial.

### 7.3-RISCOS

#### 7.3.1-RISCO DE MERCADO

É o risco de oscilações de preços dos ativos conforme o cenário macroeconômico. Este risco é voltado para a volatilidade dos papéis, sobretudo de Renda Fixa (Títulos Públicos e fundos atrelados à inflação) e Renda Variável (ações, dólar e etc..)."

Conforme a tabela abaixo, PREVPORTE aplica em alguns Fundos de Investimentos sensíveis às oscilações de mercado, conforme a classificação de Risco de Mercado, disponibilizado nas Lâminas de Informações Essenciais dos Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDOS DE INVESTIMENTO	RISCO DE MERCADO*
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	2 - Baixo
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	2 - Baixo
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	1 - Muito baixo
4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	4 - Alto
5	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	3 - Médio
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	4 - Alto
7	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	5 - Muito Alto
8	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	5 - Muito Alto
9	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	5 - Muito Alto
10	BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	4 - Alto
11	BB AÇÕES AGRO FIC FI	4 - Alto
12	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	2 - Baixo
13	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	2 - Baixo
14	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	3 - Médio
15	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	2 - Baixo
16	FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3 - Médio
17	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	3 - Médio
18	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	3 - Médio
19	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	3 - Médio
20	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	4 - Alto
21	FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVSPA	5 - Muito Alto
22	FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	4 - Alto
23	FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	4 - Alto
24	FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR	não Disponibilizado pela Instituição
25	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4 - Alto

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

### 7.3.2-RISCO DE CRÉDITO

É a possibilidade do devedor não honrar seus compromissos. Nesse caso, investimentos que possuem risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating.

#### 7.3.2.1-FUNDO DE INVESTIMENTO

A maioria dos Fundos de Investimentos em Renda Fixa e Renda Variável que o PREVPORTE aplica, não necessitam de Análise de Rating. Entretanto, alguns fundos de Renda Variável possuem certa concentração de papéis privados em sua carteira de investimento que, por possuir risco de insolvência financeira são obrigados à se submeter a classificação de risco por Agências de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating destes Fundos de Investimentos.

Nº	FUNDO DE INVESTIMENTO	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
2	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
3	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	Não Precisa	Não Precisa
4	BB PREVIDENCIÁRIO IMA - B 5 LP FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
5	BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
6	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	Não Precisa	Não Precisa
7	BB AÇÕES RETORNO TOTAL FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
8	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC FIA - BDR NÍVEL I	Não Precisa	Não Precisa
9	BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC FI	Não Precisa	Não Precisa
10	BB AÇÕES BOLSAS ASIÁTICAS EX-JAPÃO FIC FIA - BDR ETF NÍVEL I	Não há	Não há
11	BB AÇÕES AGRO FIC FI	Não há	Não há
12	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	Não Precisa	Não Precisa
13	FI CAIXA BRASIL IRF - M 1 TP RF	Fitch Rating	Forte
14	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	Fitch Rating	Forte
15	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	Fitch Rating	Forte
16	FIC FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	Fitch Rating	Forte
17	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	Fitch Rating	Forte
18	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 + TP RF LP	Fitch Rating	Forte
19	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	Fitch Rating	Forte
20	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	Não Precisa	Não Precisa
21	FI AÇÕES CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA	Não há	Não há
22	FIC FIA CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO	Não Precisa	Não Precisa
23	FIC FI AÇÕES CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR	Não Precisa	Não Precisa
24	FIC FI CAIXA MULT MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVEST EXTERIOR	Não Precisa	Não Precisa
25	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Fitch Rating	"Forte"

### 7.3.2.2-*INSTITUIÇÃO FINANCEIRA*

Todos os envolvidos na gestão do Fundo de Investimento, incluindo as Instituições Financeiras, o Administrador, o Gestor e o Distribuidor necessitam de Análise de Rating. Abaixo segue a Classificação de Rating dos envolvidos na gestão e distribuição dos Fundos de Investimentos.

Nº	INSTITUIÇÃO FINANCEIRA / ADMINISTRADOR / GESTOR / DISTRIBUIDOR	CLASSIFICAÇÃO DE RATING	
		AGÊNCIA	RATING
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	Fitch Ratings	AA(bra)
2	Caixa Econômica Federal	Fitch Ratings	AA(bra)

### 7.3.3-*RISCO DE LIQUIDEZ*

É o risco de o investidor não conseguir dar liquidez ao ativo financeiro (vender) ou conseguir liquidez abaixo do preço de mercado ou abaixo do preço de aquisição (compra).

O PREVPORTO não aplica em Fundos de Investimento Fechado e/ou Aberto com Carência, portanto, possui 100% de Disponibilidade Financeira (Resgate diário) não possuindo Risco de Liquidez no Curto Prazo.

## 7.4-ADERÊNCIA AO PAI

### 7.4.1-PERFIL DE RISCO (MERCADO)

#### PERFIL DOS INVESTIMENTOS



#### Descrição do Perfil de Investidor

##### Objetivo do perfil

Perfil que tem o objetivo de buscar ganhos acima da inflação. A carteira possui uma grande concentração de ativos moderados, mas busca investir um pouco em ativos arrojados. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo (como Planos de Previdência) é o perfil mais indicado.

##### Comportamento da carteira

A carteira com perfil MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA, busca investimentos que rentabilizam acima da inflação, mas que podem apresentar rentabilidades negativas no curto prazo. Para investidores que possuem obrigações de longo prazo é o perfil mais indicado, pois os investimentos podem oferecer ganhos mais vultuosos no médio e longo prazo. Esse tipo de perfil é o mais equilibrado, entre cumprir a Meta Atuarial e se proteger um pouco das oscilações de mercado.

#### Classificação de Perfil de Investidor - Metodologia Atuarial Consultoria

CONSERVADOR	1	EXTREMAMENTE CONSERVADOR
	2	CONSERVADOR
	3	CONSERVADOR COM TENDÊNCIA MODERADA
MODERADO	4	MODERADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	5	MODERADO
	6	MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA
ARROJADO	7	ARROJADO COM TENDÊNCIA CONSERVADORA
	8	ARROJADO COM TENDÊNCIA MODERADA
	9	ARROJADO
	10	EXTREMAMENTE ARROJADO



O atual perfil de risco do PREVPORTO (PERFIL 6 - MODERADO COM TENDÊNCIA ARROJADA), se encontra aderente ao Perfil de Risco proposto na Política Anual de Investimentos/2021.

#### *7.4.2-RISCO DE CRÉDITO*

A Política Anual de Investimentos/2021 do PREVPORTO, determina que fundos de investimentos e Instituições Financeiras que necessitem de Análise de Rating, só receberão recursos do PREVPORTO, caso sejam classificados, no mínimo, como BAIXO RISCO DE CRÉDITO (BBB).

As Análises de Ratings encontradas dos Fundos de Investimentos, assim como das Instituições Financeiras, dos Administradores, dos Gestores e dos Distribuidores dos fundos, se encontram aderentes à Política Anual de Investimentos/2021 do PREVPORTO.

#### *7.4.3-RISCO DE LIQUIDEZ*

##### *7.4.3.1-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - CURTO PRAZO*

Para resguardar o PREVPORTO e minimizar o risco de liquidez no Curto Prazo foi definido na Política de Investimentos/2021, uma Separação de Recursos Financeiros, no intuito de formalizar uma Provisão de Caixa.

Na Política Anual de Investimentos/2021 do PREVPORTO foi definido um valor de Provisão de Caixa de R\$ 3.980.011,51 Milhões de reais. Atualmente, a necessidade de Provisão de Caixa do PREVPORTO é de R\$ 1.224.618,93 e o Saldo financeiro da Provisão de Caixa do PREVPORTO está em R\$ 7.041.129,81 Milhões de reais.

As Obrigações Previdenciárias no Curto Prazo, ou seja, a necessidade financeira do PREVPORTO estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2021 e a sua capacidade financeira no Curto Prazo.

#### 7.4.3.2-OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS - MÉDIO e LONGO PRAZO

O PREVPORTO não possui Fundos de Investimento Aberto com Carência e Fundos de Investimentos de Condomínio Fechados na sua carteira de investimento, possuindo liquidez à qualquer momento de seus recursos financeiros.

De acordo com o Estudo de Duration do Fluxo de Caixa do Plano Previdenciário, informado na Política Anual de Investimentos/2021, o RPPS irá começar a consumir os seus recursos, à partir do ano de 2032.

As Obrigações Previdenciárias a Médio e Longo Prazo do PREVPORTO estão aderentes a Política Anual de Investimentos/2021 e a sua capacidade e necessidade financeira a Médio e Longo prazo.

As análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 3.922/10**, alterada pela **Resolução CMN 4.695/2018**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Relatório.



---

Igor França Garcia  
Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA  
Consultor de Investimentos credenciado pela CVM