### :: AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES

29/10/2021

#### Características

CNP.J: 35 002 482/0001-01 Gestão: XP Asset Management Administrador: BNP Paribas Taxa de Administração: 0,80%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui Classificação Anbima: Ações Investimento no Exterior

Código de Referência: 522147 Início do Fundo: 23/12/2019

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 25,000,00 Aplicação Adicional: Não informado Saldo Mínimo: Não informado Resgate Mínimo: Não informado

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+6 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	67,03	17,43	32,49	-	-	5,53	-5,03	2,82	1,62	5,86	-1,62	7,87	-2,28	2,35	-0,19	5,26	8,60
% do S&P 500	68,56	52,58	84,17	-	-	50,64	-693,11	84,63	34,28	-257,78	61,31	-4.303,79	-30,86	64,90	-4,52	484,48	372,57
INPC + 6% META ATUARIAL	27,68	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
S&P 500	97,78	33,14	38,59	114,24	159,51	10,92	0,73	3,34	4,72	-2,27	-2,64	-0,18	7,39	3,63	4,20	1,09	2,31

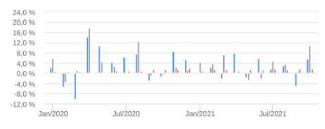
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	167,0323949	645.954,82	506.442,02	17,60%	-11,72%	8,36%	0,31	20,71%	8,60%	-5,03%	5
S&P 500	-	-	-	19,75%	-11,30%	9,38%	1,00	0,00%	7,39%	-2,64%	0

#### Gráficos

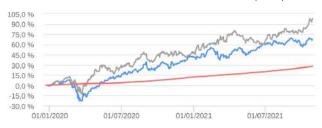
S&P

INPC + 6% META ATUARIAL

#### Retorno Mensal - 24/12/2019 a 29/10/2021 (mensal)



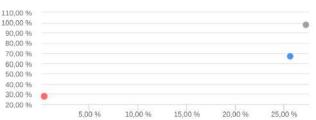
#### Retorno Acumulado - 24/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Volatilidade Anualizada - 24/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



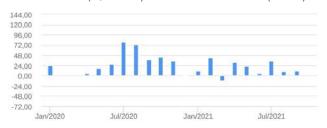
### Risco x Retorno - 24/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 24/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 24/12/2019 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - S&P 500



### :: AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES

FUNDO	% do PL	Mé	ês	Aı	no	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
FUNDO			Relativo	Nominal	Relativo	Nomina	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Cotas de Fundos (omitidas)	-	_	-	-	-	-	-	-	-	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	99,98%	100,35%	100,09%	100,32%	100,58%	99,89%	100,96%	99,80%
Valores a receber	0,75%	0,45%	0,53%	0,37%	1,04%	1,05%	0,32%	9,72%
Valores a pagar	0,73%	0,79%	0,62%	-0,69%	-1,62%	-0,94%	-1,28%	-9,52%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	645.954,82	610.901,89	630.642,22	604.180,67	560.062,36	523.638,44	510.132,79	443.487,80
Data da Divulgação	04/11/2021	04/10/2021	03/09/2021	03/08/2021	06/07/2021	02/06/2021	04/05/2021	06/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)								jul/2021



Cotas de AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY	99,86 %
INVESTIMENTO	
Outros Valores a pagar	-0,69 %
Cotas de BNP PARIBAS SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,46 %
Outros Valores a receber	0,37 %
Outrae Disponibilidades	0.00 %

### \*\* BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/10/2021

### Características

CNPJ: 25.078.994/0001-90

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Taxa de Administração: 0,30%

Taxa de Administração (Máxima): 0,50%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 423041 Início do Fundo: 31/08/2016

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000.000,00
Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Saldo Mínimo: R\$ 300.000,00
Resgate Mínimo: R\$ 1.000.000,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+3 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	48,23	-2,98	0,12	2,22	18,08	-1,63	0,00	-0,45	-0,25	0,11	0,48	0,62	-0,42	-0,91	-0,55	2,38	0,85
% do IMA Geral ex-C	96,60	141,87	19,48	71,54	98,10	120,25	-26,61	131,99	251,66	34,92	95,83	127,03	110,35	110,75	125,93	112,13	121,70
INPC + 6% META ATUARIAL	70,92	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA Geral ex-C	49,93	-2,10	0,64	3,11	18,43	-1,35	0,02	-0,34	-0,10	0,32	0,50	0,49	-0,38	-0,83	-0,44	2,12	0,70
																V	0700

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,482278227	7.937.028,59	9.245.444,21	2,83%	-3,46%	1,34%	1,12	0,42%	2,38%	-0,91%	3
IMA Geral ex-C	-	-	-	2,57%	-2,82%	1,22%	1,00	0,00%	2,12%	-0,83%	0

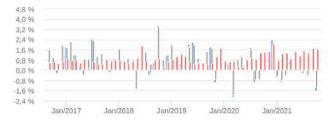
#### Gráficos

## IMA Geral ex-

INPC + 6% META

#### ATUARIAL

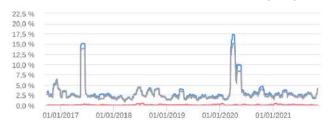
#### Retorno Mensal - 01/09/2016 a 29/10/2021 (mensal)



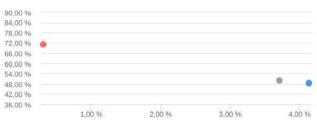
### Retorno Acumulado - 01/09/2016 a 29/10/2021 (diária)



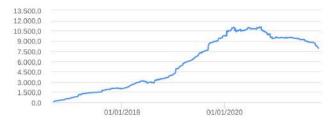
## Volatilidade Anualizada - 01/09/2016 a 29/10/2021 (diária)



Risco x Retorno - 01/09/2016 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 01/09/2016 a 29/10/2021 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/09/2016 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - IMA Geral ex-C



### :: BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

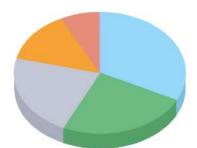
29/10/2021

FUNDO	% do PL	M	ês	Ar	no	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
FUNDO			Relativo	Nominal	Relativo	Nomina	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Cotas de Fundos (omitidas)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	99,99%	99,99%	99,99%	99,99%	99,99%	100,00%	100,00%	100,00%
Disponibilidades	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,01%	0,00%	0,01%
Valores a pagar	0,00%	0,00%	0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	7.937.028,59	8.672.013,98	8.803.716,46	8.970.903,96	9.201.718,78	9.352.083,34	9.467.835,83	9.507.617,90
Data da Divulgação	08/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	06/08/2021	05/07/2021	04/06/2021	07/05/2021	06/04/2021
								. 1/0004

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2021



Cotas de BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  PREVIDENCIÁRIO	32,47 %
Cotas de BB TOP IRF-M 1 FI RENDA FIXA	24,59 %
Cotas de BB TOP IMA-B 5 ALOCAÇÃO FI RENDA FIXA	21,91 %
Cotas de BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,65 %
Cotas de BB TOP IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	7,38 %
Outras Disponibilidades	0,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Controladoria	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Auditoria	0,00 %

### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/10/2021

### Características

CNPJ: 15.486.093/0001-83

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Taxa de Administração: 0,15%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 358721 Início do Fundo: 23/01/2014

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	151,56	1,74	5,02	11,65	31,35	-1,10	1,13	0,29	-0,01	-0,25	0,89	0,97	0,38	-0,58	0,02	1,97	1,31
% do IPCA	265,36	21,10	46,60	77,51	173,94	-87,83	97,72	33,87	-1,20	-47,10	107,37	313,11	40,39	-68,00	9,87	145,87	146,77
INPC + 6% META ATUARIAL	148,26	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IPCA	57,11	8,24	10,76	15,03	18,02	1,25	1,16	0,87	0,96	0,53	0,83	0,31	0,93	0,86	0,25	1,35	0,89

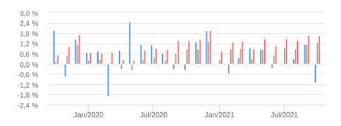
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,515580578	348.432,37	349.709,41	2,60%	-2,05%	1,23%	0,44	2,61%	1,97%	-0,58%	4
IPCA	-	-	-	0,24%	-	0,11%	1,00	0,00%	1,35%	0,25%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IPCA

#### INPC + 6% META ATUARIAL

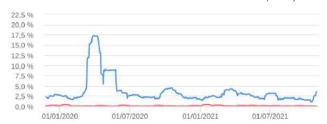
### Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



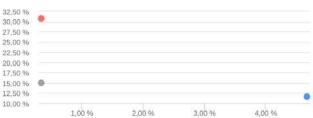
Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



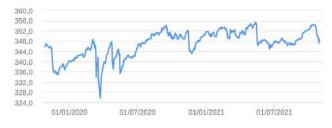
## Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



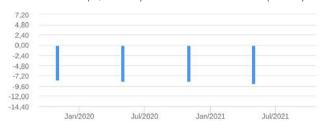




## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

## out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira

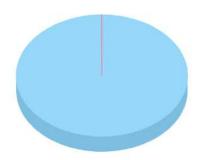


### **::** BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,93%	99,91%	99,90%	99,88%	99,86%	99,85%	99,93%	99,92%
Operações Compromissadas	0,05%	0,06%	0,08%	0,09%	0,11%	0,15%	0,06%	0,08%
Disponibilidades	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,03%	0,01%	0,01%	0,01%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	348.432,37	352.300,30	348.351,39	347.328,01	347.367,87	348.237,09	354.246,00	350.840,59
Data da Divulgação	09/11/2021	04/10/2021	02/09/2021	10/08/2021	08/07/2021	07/06/2021	07/05/2021	08/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/05/2023	99,93 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2031	0,05 %
Outras Disponibilidades	0,03 %
Outros Valores a receber	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %

### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/10/2021

## Características

CNPJ: 19.303.793/0001-46

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Taxa de Administração: 0,15%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 360090 Início do Fundo: 30/01/2014

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	154,04	4,20	6,69	14,00	31,97	-0,49	1,30	0,46	0,66	0,36	0,75	0,41	0,40	0,00	0,29	1,22	1,18
% do IPCA	270,44	50,99	62,15	93,13	177,40	-39,45	112,36	52,69	68,93	68,45	90,32	131,81	42,67	-0,99	116,62	90,10	132,36
INPC + 6% META ATUARIAL	147,75	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IPCA	56,96	8,24	10,76	15,03	18,02	1,25	1,16	0,87	0,96	0,53	0,83	0,31	0,93	0,86	0,25	1,35	0,89

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,540397268	512.630,58	513.857,84	1,60%	-0,95%	0,76%	0,37	1,61%	1,30%	0,00%	4
IPCA	-	-	-	0,24%	-	0,11%	1,00	0,00%	1,35%	0,25%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IPCA

#### INPC + 6% META ATUARIAL

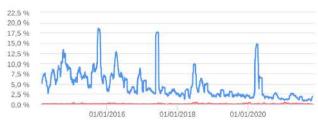
## Retorno Acumulado - 30/01/2014 a 29/10/2021 (diária)



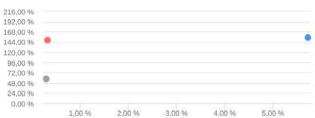
Retorno Mensal - 30/01/2014 a 29/10/2021 (mensal)



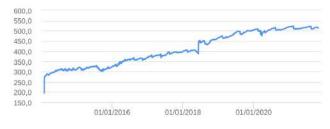
### Volatilidade Anualizada - 30/01/2014 a 29/10/2021 (diária)



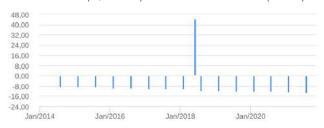




## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 30/01/2014 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 30/01/2014 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira

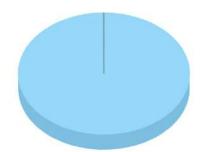


### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

out/21 99,87%	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	:/04		
99.87%			•	Juli/21	mai/21	abr/21	mar/21
,,-	99,85%	99,84%	99,93%	99,92%	99,91%	99,89%	99,87%
0,12%	0,13%	0,15%	0,05%	0,07%	0,10%	0,11%	0,13%
0,02%	0,02%	0,02%	0,02%	0,02%	0,01%	0,01%	0,01%
0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,01%
512.630,58	515.171,03	508.542,73	520.079,17	516.660,06	514.792,55	510.961,93	508.882,54
08/11/2021	04/10/2021	06/09/2021	06/08/2021	07/07/2021	07/06/2021	11/05/2021	06/04/2021
	0,02% 0,00% -0,00% 512.630,58	0,02% 0,02% 0,00% - -0,00% -0,00% 512.630,58 515.171,03	0,02%         0,02%         0,02%           0,00%         -         0,00%           -0,00%         -0,00%         -0,00%           512.630,58         515.171,03         508.542,73	0,02%         0,02%         0,02%         0,02%           0,00%         -         0,00%         0,00%           -0,00%         -0,00%         -0,00%         -0,00%           512.630,58         515.171,03         508.542,73         520.079,17	0,02%         0,02%         0,02%         0,02%         0,02%           0,00%         -         0,00%         0,00%         0,00%           -0,00%         -0,00%         -0,00%         -0,00%         -0,00%           512.630,58         515.171,03         508.542,73         520.079,17         516.660,06	0,02%         0,02%         0,02%         0,02%         0,01%           0,00%         -         0,00%         0,00%         0,00%         0,00%           -0,00%         -0,00%         -0,00%         -0,00%         -0,01%           512.630,58         515.171,03         508.542,73         520.079,17         516.660,06         514.792,55	0,02%         0,02%         0,02%         0,02%         0,01%         0,01%           0,00%         -         0,00%         0,00%         0,00%         0,00%         0,00%           -0,00%         -0,00%         -0,00%         -0,00%         -0,01%         -0,01%           512.630,58         515.171,03         508.542,73         520.079,17         516.660,06         514.792,55         510.961,93



NTN-B - Venc.: 15/08/2022 (BRSTNCNTB3Y0)	99,87 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2031	0,12 %
Outras Disponibilidades	0,02 %
Outros Valores a receber	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taya Selic	0.00%

### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 19.523.305/0001-06

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 390739 Início do Fundo: 16/03/2015

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	91,54	4,14	6,61	11,59	23,48	-0,50	1,30	0,45	0,66	0,35	0,75	0,40	0,39	-0,01	0,29	1,21	1,17
% do IMA-B	82,16	-86,55	377,21	795,04	81,93	19,50	-974,65	-41,58	-175,62	83,26	70,59	62,20	-84,91	0,81	-33,68	24,86	58,45
INPC + 6% META ATUARIAL	112,42	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B	111,42	-4,79	1,75	1,46	28,65	-2,54	-0,13	-1,09	-0,37	0,42	1,06	0,65	-0,46	-1,52	-0,85	4,85	2,00

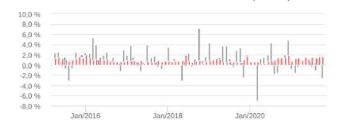
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,9153714	242.394,07	243.319,80	1,59%	-0,95%	0,75%	0,19	4,89%	1,30%	-0,01%	7
IMA-B	-	-	-	5,57%	-6,37%	2,64%	1,00	0,00%	4,85%	-1,52%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B

## INPC + 6% META

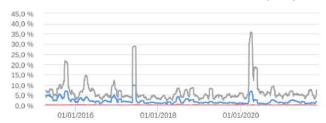
## Retorno Acumulado - 17/03/2015 a 29/10/2021 (diária)



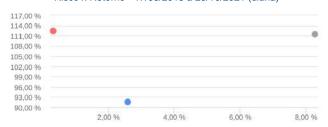
Retorno Mensal - 17/03/2015 a 29/10/2021 (mensal)



## Volatilidade Anualizada - 17/03/2015 a 29/10/2021 (diária)



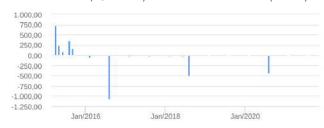
## Risco x Retorno - 17/03/2015 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/03/2015 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/03/2015 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira



### **::** BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,72%	99,71%	99,68%	99,67%	99,65%	99,63%	99,60%	99,58%
Operações Compromissadas	0,24%	0,26%	0,28%	0,29%	0,32%	0,36%	0,38%	0,41%
Disponibilidades	0,04%	0,04%	0,04%	0,04%	0,04%	0,01%	0,02%	0,02%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	242.394,07	243.602,92	240.484,28	246.212,95	244.609,02	243.755,97	241.948,85	240.972,95
Data da Divulgação	09/11/2021	07/10/2021	02/09/2021	10/08/2021	06/07/2021	07/06/2021	07/05/2021	08/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2022	99,72 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2031	0,24 %
Outras Disponibilidades	0,04 %
Outros Valores a receber	0,00 %
■ Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pager / Taya Salic	0.00%

### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/10/2021

### Características

CNPJ: 20.734.931/0001-20

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 405272 Início do Fundo: 29/09/2015

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	100,14	1,94	5,11	10,82	27,45	-0,95	1,14	0,24	0,27	0,04	0,65	0,90	0,24	-0,67	0,08	1,82	1,35
% do IMA-B	90,69	-40,49	291,86	742,24	95,79	37,41	-859,97	-21,76	-72,24	8,93	61,25	138,75	-52,90	44,23	-9,21	37,52	67,44
INPC + 6% META ATUARIAL	96,74	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B	110,43	-4,79	1,75	1,46	28,65	-2,54	-0,13	-1,09	-0,37	0,42	1,06	0,65	-0,46	-1,52	-0,85	4,85	2,00

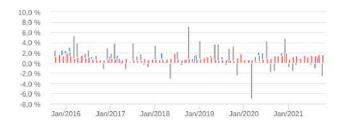
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,001441401	421.746,69	428.189,76	2,47%	-1,74%	1,17%	0,38	3,85%	1,82%	-0,67%	7
IMA-B	-	-	-	5,57%	-6,37%	2,64%	1,00	0,00%	4,85%	-1,52%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B

## INPC + 6% META

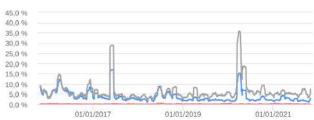
## Retorno Acumulado - 30/09/2015 a 29/10/2021 (diária)



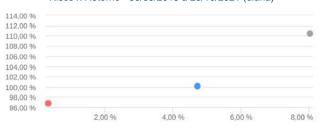
Retorno Mensal - 30/09/2015 a 29/10/2021 (mensal)



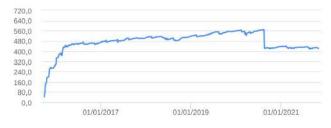
### Volatilidade Anualizada - 30/09/2015 a 29/10/2021 (diária)







## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 30/09/2015 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 30/09/2015 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira



### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/10/2021

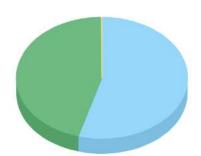
Fundo	% do PL	Naminal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
rundo	% UU PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	voiatilluade	PL Medio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,82%	99,80%	99,78%	99,94%	99,92%	99,98%	99,84%	99,82%
Operações Compromissadas	0,16%	0,18%	0,20%	0,04%	0,06%	0,13%	0,15%	0,17%
Disponibilidades	0,02%	0,02%	0,02%	0,02%	0,02%	0,00%	0,01%	0,01%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Outras operações passivas e exigibilidades	-	-	-	-	-	0,12%	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	421.746,69	425.799,21	420.982,20	431.155,07	429.995,31	429.834,00	427.590,22	423.762,21
Data da Divulgação	09/11/2021	06/10/2021	06/09/2021	10/08/2021	06/07/2021	07/06/2021	10/05/2021	06/04/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2022	54,45 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2024	45,37 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2031	0,16 %
Outras Disponibilidades	0,02 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0.00%

### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

29/10/2021

## Características

CNPJ: 24.117.278/0001-01

Gestão: BB Gestão de Recursos DTVM Administrador: BB Gestão de Recursos DTVM

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 414786 Início do Fundo: 14/03/2016

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	80,24	4,14	6,62	13,85	31,70	-0,50	1,30	0,45	0,66	0,35	0,75	0,41	0,39	-0,01	0,29	1,21	1,17
% do IDkA IPCA 3 Anos	109,65	-777,00	201,89	139,49	115,06	30,85	154,61	1.340,36	-201,66	-58,17	99,06	21,51	-1.103,17	1,07	-115,78	47,21	86,43
INPC + 6% META ATUARIAL	81,53	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IDkA IPCA 3 Anos	73,18	-0,53	3,28	9,93	27,55	-1,61	0,84	0,03	-0,33	-0,60	0,75	1,89	-0,04	-1,19	-0,25	2,56	1,36

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,802427313	201.324,56	201.748,39	1,59%	-0,95%	0,76%	0,35	3,03%	1,30%	-0,01%	8
IDkA IPCA 3 Anos	-	-	-	3,89%	-3,09%	1,85%	1,00	0,00%	2,56%	-1,19%	0

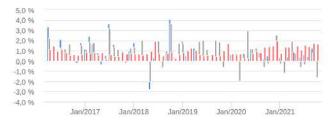
#### Gráficos

IDkA IPCA 3

Anos

INPC + 6% META ATUARIAL

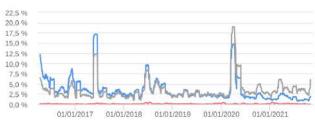




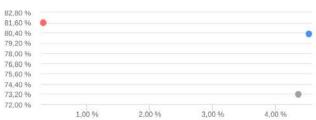
### Retorno Acumulado - 15/03/2016 a 29/10/2021 (diária)



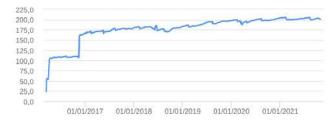
### Volatilidade Anualizada - 15/03/2016 a 29/10/2021 (diária)



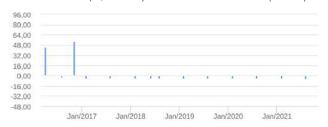
### Risco x Retorno - 15/03/2016 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 15/03/2016 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 15/03/2016 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira



### \*\* BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,79%	99,78%	99,75%	99,91%	99,89%	99,87%	99,84%	99,82%
Operações Compromissadas	0,16%	0,18%	0,20%	0,04%	0,06%	0,12%	0,14%	0,16%
Disponibilidades	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,05%	0,02%	0,02%	0,02%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Valores a pagar	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	201.324,56	202.327,91	199.736,38	204.146,38	202.815,12	202.111,31	200.613,14	199.800,74
Data da Divulgação	09/11/2021	06/10/2021	06/09/2021	10/08/2021	06/07/2021	07/06/2021	10/05/2021	06/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2022	99,79 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2031	0,16 %
Outras Disponibilidades	0,05 %
Outros Valores a receber	0,00 %
■ Valores a pagar / Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Valores a pagar / Taya Selic	0.00 %

#### **::** BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 08.266.261/0001-60
Gestão: Banco do Nordeste do Brasil
Administrador: Santander Caceis
Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): 0,20%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Alta Soberano

Código de Referência: 184373 Início do Fundo: 24/04/2007

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 75.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 500,00 Saldo Mínimo: R\$ 5.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 500,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	329,99	-4,25	1,46	0,95	25,28	-2,35	-0,01	-0,97	-0,30	0,35	0,99	0,64	-0,41	-1,43	-0,78	4,18	1,79
% do IMA-B	78,10	88,77	83,24	65,26	88,24	92,35	11,23	88,95	79,09	82,26	93,11	97,58	89,55	94,24	91,83	86,03	89,31
INPC + 6% META ATUARIAL	436,71	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B	422,53	-4,79	1,75	1,46	28,65	-2,54	-0,13	-1,09	-0,37	0,42	1,06	0,65	-0,46	-1,52	-0,85	4,85	2,00

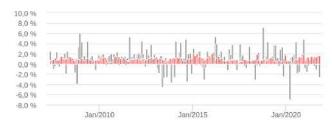
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	4,299864	256.297,69	273.837,62	4,99%	-5,66%	2,37%	0,89	0,61%	4,18%	-1,43%	6
IMA-B	-	-	-	5,57%	-6,37%	2,64%	1,00	0,00%	4,85%	-1,52%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B

## INPC + 6% META

## Retorno Acumulado - 25/04/2007 a 29/10/2021 (diária)



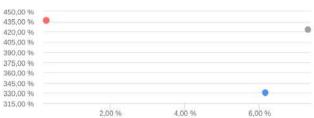
Retorno Mensal - 25/04/2007 a 29/10/2021 (mensal)



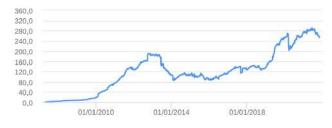
## Volatilidade Anualizada - 25/04/2007 a 29/10/2021 (diária)







## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 25/04/2007 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 25/04/2007 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira

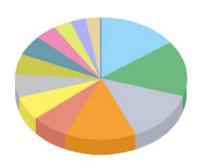


#### :: BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)												
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21				
Títulos Públicos	96,76%	97,17%	96,55%	97,05%	92,62%	90,98%	94,94%	95,57%				
Operações Compromissadas	3,26%	2,84%	3,55%	5,72%	7,42%	9,05%	5,25%	4,45%				
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%				
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%				
Valores a pagar	-0,02%	-0,02%	-0,10%	-2,78%	-0,05%	-0,03%	-0,19%	-0,02%				
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	256.297,69	261.486,01	270.402,44	276.257,98	282.834,94	286.830,14	283.341,66	279.598,13				
Data da Divulgação	10/11/2021	08/10/2021	10/09/2021	10/08/2021	09/07/2021	10/06/2021	11/05/2021	12/04/2021				
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021				



NTN-B - Venc.: 15/08/2050	14,97 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	14,82 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	13,64 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	13,44 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	6,91 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	6,29 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	6,22 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	5,41 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	5,29 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	4,05 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	3,26 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	2,92 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	2,69 %
LFT - Venc.: 01/09/2026	0,09 %
Outros Valores a pagar	-0,02 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Outras Disponibilidades	0.00 %

### ■ BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA

29/10/2021

## Características

CNPJ: 28.515.874/0001-09
Gestão: Bradesco Asset Management
Administrador: Banco Bradesco
Taxa de Administração: 0,40%

Taxa de Administração (Máxima): 0,40%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Código de Referência: 456306 Início do Fundo: 28/12/2017

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 50.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00 Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+3 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+4 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	25,84	-2,35	0,80	2,40	17,81	-0,72	-0,15	-0,50	-0,20	0,33	0,42	0,53	-0,54	-0,96	-0,58	2,48	0,78
% do IPCA	115,16	-28,55	7,41	15,94	98,81	-57,24	-13,28	-57,90	-20,85	62,44	51,09	171,92	-58,28	-111,38	-231,71	183,69	88,00
INPC + 6% META ATUARIAL	54,43	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IPCA	22,44	8,24	10,76	15,03	18,02	1,25	1,16	0,87	0,96	0,53	0,83	0,31	0,93	0,86	0,25	1,35	0,89

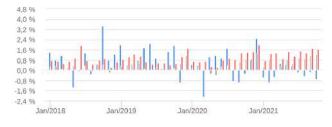
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,2584469	1.258.083,25	1.403.060,32	2,82%	-2,73%	1,34%	0,70	2,82%	2,48%	-0,96%	2
IPCA	-	-	-	0,24%	-	0,11%	1,00	0,00%	1,35%	0,25%	0

#### Gráficos

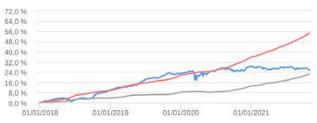
■ Fundo ■ IPCA

INPC + 6% META ATUARIAL

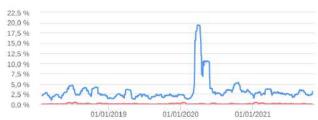
#### Retorno Mensal - 29/12/2017 a 29/10/2021 (mensal)



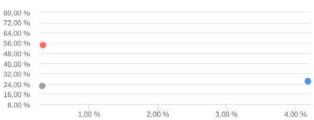
### Retorno Acumulado - 29/12/2017 a 29/10/2021 (diária)



### Volatilidade Anualizada - 29/12/2017 a 29/10/2021 (diária)



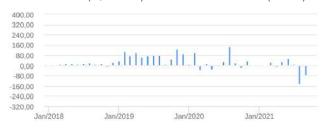
Risco x Retorno - 29/12/2017 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 29/12/2017 a 29/10/2021 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 29/12/2017 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - IPCA



### :: BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA

FUNDO	% do PL	М	ês	Aı	no	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
FUNDO	% d0 PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	59,90	0,53	42,29	3,08	37,44	187,06	177,62	187,06	177,62	0,08	R\$ 7.922.642.132,6
BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	22,76	-2,63	-210,34	-5,51	-66,91	145,89	263,55	145,89	263,55	5,73	R\$ 2.856.984.818,6
BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	13,27	-2,76	-220,96	-6,03	-73,21	112,04	193,57	112,04	193,57	3,74	R\$ 456.454.256,3
BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,28	-2,56	-204,89	-4,88	-59,26	143,32	258,55	143,32	258,55	5,73	R\$ 773.827.456,6
BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	0,71	-5,45	-435,99	-17,79	-216,08	26,43	126,58	26,43	126,58	10,07	R\$ 327.951.126,4
BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,06	-1,26	-101,08	0,60	7,27	133,82	199,34	133,82	199,34	2,82	R\$ 3.180.562.004,0
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,06	-3,48	-278,43	-7,28	-88,34	56,97	200,12	56,97	200,12	4,20	R\$ 520.101.371,0
BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	0,00	-3,94	-315,47	-10,24	-124,40	155,63	280,39	155,63	280,39	8,98	R\$ 282.940.192,1
BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	0,00	-0,82	-65,27	-6,39	-77,63	270,43	231,63	270,43	231,63	4,08	R\$ 724.770.568,0

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	100,03%	100,06%	100,04%	100,04%	100,04%	100,04%	100,10%	100,05%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,04%	-0,06%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,04%	-0,10%	-0,05%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.258.083,25	1.272.446,78	1.351.295,81	1.505.438,53	1.501.428,50	1.440.715,54	1.403.021,63	1.406.629,48
Data da Divulgação	05/11/2021	04/10/2021	03/09/2021	04/08/2021	06/07/2021	07/06/2021	05/05/2021	07/04/2021

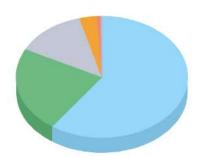


### :: BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA

29/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2021



Cotas de BRAM FEDERAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	59,90 %
Cotas de BRAM IMA-B FI RENDA FIXA	22,76 %
Cotas de BRAM INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA	13,27 %
Cotas de BRAM IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,28 %
Cotas de BRAM IDKA PRÉ 5 FI RENDA FIXA	0,71 %
Cotas de BRAM IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,06 %
Cotas de BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,06 %
Outros Valores a pagar	-0,04 %
Cotas de BRAM IMA-B 5+ FI RENDA FIXA	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Cotas de BRAM H VOLGA FI RENDA FIXA LP	0.00 %

## :: BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 06.988.623/0001-09
Gestão: Bradesco Asset Management
Administrador: BEM DTVM

Taxa de Administração: 1,50% Taxa de Administração (Máxima): 1,50%

Início do Fundo: 24/09/2004

Classificação Anbima: Ações Small Caps Código de Referência: 131679

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 20.000.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00 Saldo Mínimo: R\$ 20.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+1 du Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	933,28	-10,38	3,46	1,40	41,80	-12,54	-3,91	-2,76	-3,42	0,89	8,31	4,34	3,12	-0,77	-2,67	8,61	8,45
% do SMLL	-	59,73	186,64	-84,15	97,28	100,08	60,75	72,08	59,02	68,69	131,43	99,16	68,31	42,12	77,83	114,50	50,80
INPC + 6% META ATUARIAL	592,88	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
SMLL	-	-17,37	1,85	-1,67	42,96	-12,53	-6,43	-3,82	-5,80	1,29	6,32	4,38	4,56	-1,84	-3,43	7,52	16,64

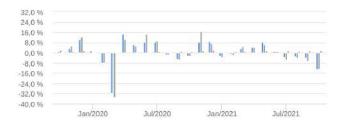
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	10,3327939	1.715.756,64	2.170.103,63	21,18%	-22,21%	10,06%	0,80	9,37%	8,61%	-3,91%	7
SMLL	-	-	-	23,86%	-27,69%	11,33%	1,00	0,00%	16,64%	-6,43%	0

#### Gráficos

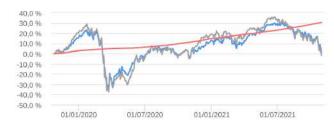
#### Fundo ■ SMLL

#### INPC + 6% META ATUARIAL

## Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



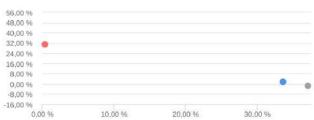
Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



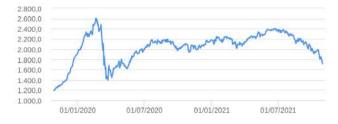
### Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



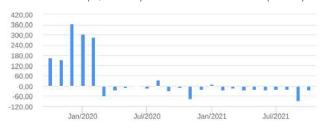
Risco x Retorno - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira

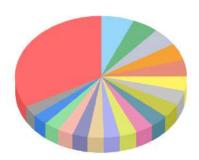


### **::** BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Ações	84,42%	86,46%	85,86%	87,14%	87,10%	87,61%	88,55%	90,47%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	12,41%	12,35%	12,47%	11,62%	12,17%	11,37%	10,70%	8,76%
Operações Compromissadas	3,39%	1,09%	2,62%	1,27%	0,95%	0,81%	0,70%	1,10%
Valores a receber	0,24%	0,37%	0,12%	0,20%	0,19%	0,47%	1,72%	0,08%
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	0,01%	0,01%	0,00%	0,01%	0,01%	0,01%	0,00%	0,01%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,48%	-0,28%	-1,07%	-0,24%	-0,42%	-0,27%	-1,68%	-0,41%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.715.756,64	1.995.199,09	2.170.284,03	2.255.908,28	2.359.525,96	2.367.208,84	2.207.865,21	2.141.846,2
Data da Divulgação	09/11/2021	06/10/2021	03/09/2021	06/08/2021	07/07/2021	07/06/2021	05/05/2021	09/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021



ENEVA ON NM - ENEV3	6,31 %
HAPVIDA ON NM - HAPV3	4,91 %
SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3	4,87 %
QUERO-QUERO ON NM - LJQQ3	4,56 %
ALPARGATAS PN N1 - ALPA4	4,44 %
BRADESPAR PN N1 - BRAP4	3,88 %
■ GERDAU MET PN N1 - GOAU4	3,85 %
KLABIN S/A UNT N2 - KLBN11	3,82 %
■ CESP PNB N1 - CESP6	3,43 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/08/2028	3,39 %
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	3,23 %
ALIANSCSONAEON NM - ALSO3	3,10 %
ECORODOVIAS ON NM - ECOR3	2,95 %
■ INTELBRAS ON NM - INTB3	2,92 %
RANDON PART PN N1 - RAPT4	2,91 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	2,90 %
■ VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	2,90 %
■ GRUPO SBF ON NM - SBFG3	2,86 %
Lancamentos positivos menores que 2.86%	33.24 %

### **::** BRADESCO SELECTION FI AÇÕES

#### 29/10/2021

### Características

CNPJ: 03.660.879/0001-96 Gestão: Bradesco Asset Management

Administrador: BEM DTVM Taxa de Administração: 1,50%

Taxa de Administração (Máxima): 1,50% Classificação Anbima: Ações Índice Ativo

Código de Referência: 95664 Início do Fundo: 09/03/2000

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 20.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00 Saldo Mínimo: R\$ 20.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	1.471,12	-17,61	-4,74	-15,85	5,98	-8,62	-8,28	-2,27	-4,87	2,09	5,99	3,39	0,16	-3,24	-2,48	7,90	8,19
% do Ibovespa	181,86	135,09	-55,64	440,53	25,88	127,88	126,13	91,45	123,54	450,52	97,30	175,20	2,59	74,16	74,75	85,02	51,53
INPC + 6% META ATUARIAL	1.009,08	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
Ibovespa	808,94	-13,04	8,53	-3,60	23,09	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16	1,94	6,00	-4,37	-3,32	9,30	15,90

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	818,4384168	548.943,48	745.188,27	21,24%	-22,92%	10,09%	0,99	8,71%	8,19%	-8,28%	6
Ibovespa	-	-	-	21,03%	-20,86%	9,99%	1,00	0,00%	15,90%	-6,57%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ Ibovespa

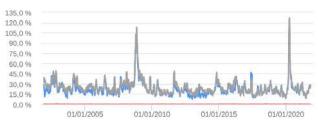
## INPC + 6% META

## Retorno Mensal - 05/11/2001 a 29/10/2021 (mensal) Retorno

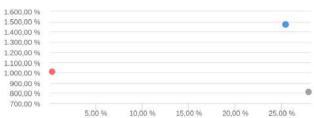




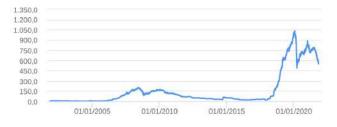
### Volatilidade Anualizada - 05/11/2001 a 29/10/2021 (diária)



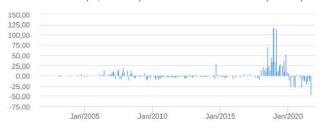




## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 05/11/2001 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 05/11/2001 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

Retorno (%) / % do Benchmark - Ibovespa

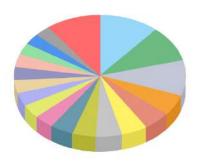
Performance dos Fundos em Carteira



### **::** BRADESCO SELECTION FI AÇÕES

FUNDO	0/ da DI	М	ês	Aı	no	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
FUNDO	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
ETF BRADESCO IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVB11	4,91	-6,73	99,85	-12,95	99,34	3,11	111,42	3,11	111,42	19,83	R\$ 2.067.862.748,0

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Ações	83,61%	83,64%	85,78%	84,96%	85,01%	85,01%	81,37%	85,96%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	8,40%	7,95%	7,12%	8,03%	8,13%	7,38%	4,92%	1,23%
Cotas de Fundos	4,91%	4,06%	2,89%	3,71%	3,40%	5,89%	11,68%	11,90%
Operações Compromissadas	2,93%	3,93%	5,70%	2,26%	3,17%	1,17%	2,57%	2,07%
Valores a receber	0,29%	0,61%	0,01%	1,20%	0,43%	1,23%	0,33%	0,21%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,14%	-0,18%	-1,50%	-0,16%	-0,13%	-0,68%	-0,87%	-1,36%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	548.943,48	600.652,32	705.518,16	733.885,42	776.844,73	773.978,44	749.896,82	736.778,25
Data da Divulgação	09/11/2021	04/10/2021	06/09/2021	04/08/2021	05/07/2021	05/06/2021	05/05/2021	07/04/202
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



PETROBRAS PN - PETR4	11,33 %
■ ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	9,61 %
■ VALE ON N1 - VALE3	9,46 %
BRADESCO PN N1 - BBDC4	5,52 %
■ CESP PNB N1 - CESP6	5,16 %
Cotas de ETF BRADESCO IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVB11	4,91 %
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	4,90 %
ELETROBRAS PNB N1 - ELET6	4,44 %
■ VIBRA ON NM - VBBR3	4,35 %
AREZZO CO ON NM - ARZZ3	3,70 %
VIVARA S.A. ON NM - VIVA3	3,66 %
HAPVIDA ON NM - HAPV3	3,55 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	3,51 %
■ GERDAU PN N1 - GGBR4	3,48 %
B3 ON NM - B3SA3	3,45 %
GRUPO SBF ON NM - SBFG3	3,09 %
ALPARGATAS PN N1 - ALPA4	2,93 %
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2035	2,93 %
Lançamentos positivos menores que 2,93%	10,17 %

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Pátina 2 de 3



### **## BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA**

#### Características

CNPJ: 23.176.675/0001-91

Gestão: BTG Pactual Gestora de Recursos Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros

Taxa de Administração: 0,15%

Taxa de Administração (Máxima): 0,15%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 405515 Início do Fundo: 16/10/2015

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	0,16	-3,60	-0,64	-29,81	-23,89	-1,38	1,11	-2,62	0,49	-0,04	0,58	1,19	-2,64	-0,17	-0,11	1,83	1,22
% do IMA-B	0,15	75,31	-36,43	-2.045,29	-83,39	54,13	-837,66	240,26	-131,66	-9,42	55,10	182,78	572,69	11,07	13,04	37,74	61,20
INPC + 6% META ATUARIAL	95,36	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B	106,73	-4,79	1,75	1,46	28,65	-2,54	-0,13	-1,09	-0,37	0,42	1,06	0,65	-0,46	-1,52	-0,85	4,85	2,00

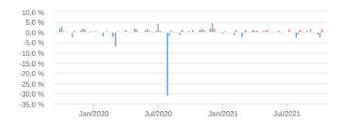
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,0016183	36.765,34	37.546,41	4,33%	-4,31%	2,05%	0,22	7,35%	1,83%	-2,64%	6
IMA-B	-	-	-	5,57%	-6,37%	2,64%	1,00	0,00%	4,85%	-1,52%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B

## INPC + 6% META

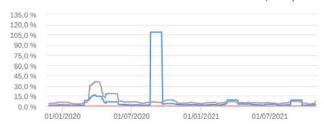
## Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



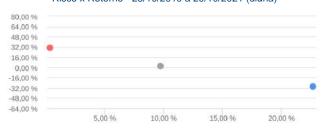
Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



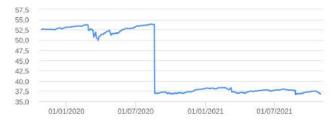
## Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Risco x Retorno - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)







### Composição da Carteira

## out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira

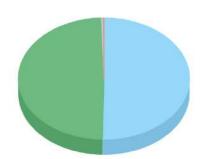


### **## BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA**

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,58%	99,57%	99,54%	99,63%	99,61%	99,59%	99,57%	99,55%
Operações Compromissadas	0,41%	0,43%	0,45%	0,35%	0,38%	0,39%	0,41%	0,47%
Valores a receber	0,02%	0,02%	0,02%	0,03%	0,03%	0,03%	0,04%	0,00%
Valores a pagar	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	36.765,34	37.278,74	36.867,83	37.858,95	37.673,75	37.688,67	37.470,24	37.029,58
Data da Divulgação	05/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	05/08/2021	08/07/2021	08/06/2021	06/05/2021	12/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	50,28 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2022 (BRSTNCNTB3Y0)	49,30 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2023	0,41 %
Outros Valores a receber	0,02 %
Outros Valores a pagar	-0,01 %

### **## BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES**

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 11.977.794/0001-64

Gestão: BTG Pactual Gestora de Recursos Administrador: BTG Pactual Serviços Financeiros

Taxa de Administração: 3,00%

Início do Fundo: 19/07/2010

Taxa de Administração (Máxima): 3,00% Classificação Anbima: Ações Livre Código de Referência: 252311

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du

Conversão da Cota para Resgate: D+1 du ou D+30 (isento de taxa de resgate)

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+4 du ou D+32 (isento de taxa de resgate)

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	263,25	-26,38	-17,53	-13,85	22,39	-13,06	-8,84	-6,82	-4,57	1,29	3,64	0,99	1,73	-2,53	-0,62	5,23	8,68
% do Ibovespa	414,46	202,33	-205,60	385,02	96,96	193,80	134,60	275,14	115,96	277,42	59,05	51,32	28,78	57,80	18,55	56,30	54,58
INPC + 6% META ATUARIAL	275,02	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
Ibovespa	63,52	-13,04	8,53	-3,60	23,09	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16	1,94	6,00	-4,37	-3,32	9,30	15,90

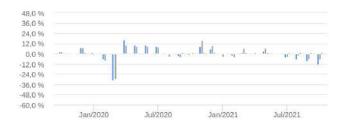
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	3,6325008	2.105.455,98	2.776.490,58	22,25%	-31,85%	10,57%	0,82	13,35%	8,68%	-8,84%	3
Ibovespa	-	-	-	21,03%	-20,86%	9,99%	1,00	0,00%	15,90%	-6,57%	0

#### Gráficos

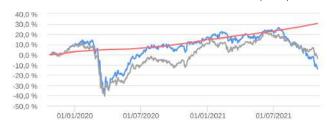
### ■ Fundo ■ Ibovespa

#### INPC + 6% META ATUARIAL

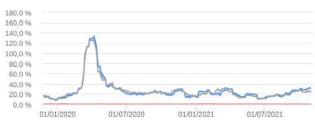
### Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



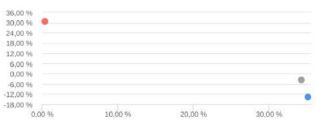
Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



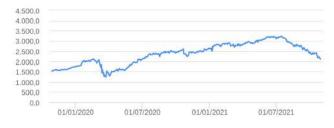
### Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



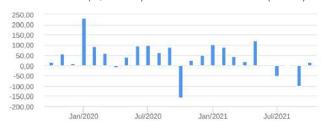
Risco x Retorno - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

Retorno (%) / % do Benchmark - Ibovespa

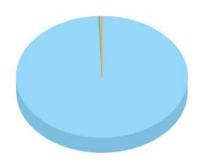
Performance dos Fundos em Carteira



### **::** BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES

FUNDO	% do PL	M	ês	Ar	no	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
TONDO		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES	100,01	-12,85	190,73	-24,56	188,35	195,60	291,71	195,60	291,71	22,51	R\$ 2.776.685.671,3

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	100,01%	99,98%	100,00%	100,00%	100,01%	100,00%	100,00%	100,01%
Operações Compromissadas	0,23%	0,31%	0,23%	0,28%	0,27%	0,32%	0,21%	0,24%
Valores a receber	0,05%	0,48%	0,05%	0,01%	0,00%	1,25%	0,06%	0,38%
Valores a pagar	-0,29%	-0,77%	-0,28%	-0,29%	-0,28%	-1,57%	-0,27%	-0,63%
Disponibilidades	-	-	0,00%	-	0,00%	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.105.455,98	2.403.304,46	2.748.098,83	2.947.905,30	3.144.220,10	3.105.254,69	2.879.178,89	2.831.568,58
Data da Divulgação	09/11/2021	08/10/2021	09/09/2021	09/08/2021	08/07/2021	08/06/2021	08/05/2021	14/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



Cotas de BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL MASTER FI AÇÕES	100,01 %
Outros Valores a pagar	-0,29 %
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/09/2023	0,23 %
Outros Valores a receber	0.05 %

### :: CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

29/10/2021

### Características

CNPJ: 18.598.288/0001-03 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 359947 Início do Fundo: 30/01/2014

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00
Aplicação Adicional: R\$ 0,00
Saldo Mínimo: R\$ 0,00
Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	66,26	-5,58	-1,83	-1,04	12,38	-1,49	0,96	-2,66	-0,18	-0,33	0,53	1,49	0,07	-3,83	-0,16	2,53	1,55
% do IMA-B	43,06	116,66	-104,28	-71,09	43,22	58,67	-722,94	243,83	49,07	-77,38	50,18	228,17	-15,24	252,75	19,06	52,16	77,72
INPC + 6% META ATUARIAL	147,75	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B	153,86	-4,79	1,75	1,46	28,65	-2,54	-0,13	-1,09	-0,37	0,42	1,06	0,65	-0,46	-1,52	-0,85	4,85	2,00

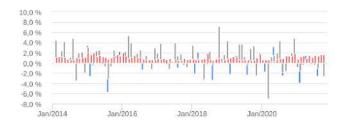
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,662572	444.321,78	457.612,09	5,15%	-6,37%	2,45%	0,63	4,68%	2,53%	-3,83%	5
IMA-B	-	-	-	5,57%	-6,37%	2,64%	1,00	0,00%	4,85%	-1,52%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B

## INPC + 6% META

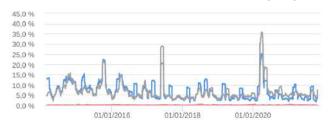
#### Retorno Acumulado - 30/01/2014 a 29/10/2021 (diária)



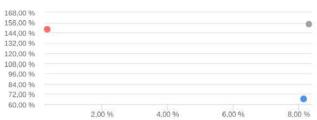
Retorno Mensal - 30/01/2014 a 29/10/2021 (mensal)



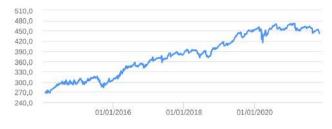
## Volatilidade Anualizada - 30/01/2014 a 29/10/2021 (diária)



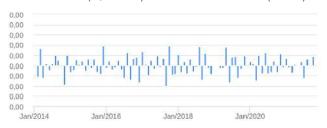
### Risco x Retorno - 30/01/2014 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 30/01/2014 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 30/01/2014 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira



### :: CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do F	PL)							
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,80%	99,79%	99,77%	99,86%	99,84%	99,82%	99,80%	99,78%
Operações Compromissadas	0,20%	0,21%	0,23%	0,15%	0,17%	0,19%	0,20%	0,22%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	444.321,78	451.054,23	446.756,84	458.950,03	459.792,55	461.292,84	458.856,86	452.140,06
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	03/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	99,80 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	0,20 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Outros Valores a receber	0.00 %

## :: CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

29/10/2021

## Características

CNPJ: 20.139.595/0001-78 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 390054 Início do Fundo: 09/03/2015

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	50,12	-5,56	-1,81	-1,04	12,40	-1,49	0,96	-2,66	-0,18	-0,32	0,53	1,49	0,07	-3,82	-0,16	2,53	1,56
% do IMA-B	44,21	116,25	-103,01	-71,54	43,27	58,65	-723,34	243,93	48,95	-77,26	50,22	228,26	-15,36	251,62	19,01	52,19	77,77
INPC + 6% META ATUARIAL	113,39	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B	113,37	-4,79	1,75	1,46	28,65	-2,54	-0,13	-1,09	-0,37	0,42	1,06	0,65	-0,46	-1,52	-0,85	4,85	2,00

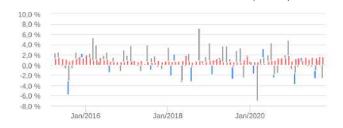
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,501173	1.382.014,26	1.423.253,51	5,14%	-6,35%	2,44%	0,63	4,67%	2,53%	-3,82%	5
IMA-B	-	-	-	5,57%	-6,37%	2,64%	1,00	0,00%	4,85%	-1,52%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B

## INPC + 6% META

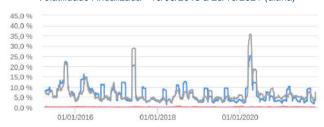
### Retorno Acumulado - 10/03/2015 a 29/10/2021 (diária)



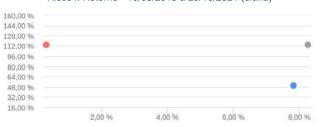
Retorno Mensal - 10/03/2015 a 29/10/2021 (mensal)



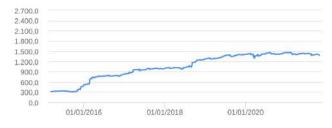
## Volatilidade Anualizada - 10/03/2015 a 29/10/2021 (diária)



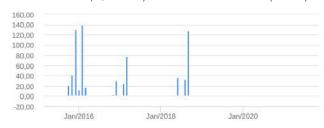




## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 10/03/2015 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 10/03/2015 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira



## :: CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

29/10/2021

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,81%	99,79%	99,77%	99,86%	99,84%	99,82%	99,80%	99,78%
Operações Compromissadas	0,20%	0,21%	0,23%	0,15%	0,16%	0,18%	0,20%	0,22%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.382.014,26	1.402.948,94	1.389.575,12	1.427.517,75	1.430.131,65	1.434.790,51	1.427.206,29	1.406.306,9
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	04/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	99,81 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	0,20 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Outros Valores a receber	0.00 %

### :: CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

29/10/2021

### Características

CNPJ: 20.139.534/0001-00 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 390313 Início do Fundo: 16/03/2015

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 300.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+2 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	52,94	-11,95	-4,72	-8,33	11,67	-2,40	-0,49	-3,83	-0,58	0,72	0,78	0,58	-1,28	-4,58	-1,43	5,52	2,42
% do IMA-B	47,51	249,63	-269,11	-571,42	40,72	94,27	364,66	351,20	155,15	172,01	73,92	89,22	277,04	301,71	167,48	113,81	121,07
INPC + 6% META ATUARIAL	112,42	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B	111,42	-4,79	1,75	1,46	28,65	-2,54	-0,13	-1,09	-0,37	0,42	1,06	0,65	-0,46	-1,52	-0,85	4,85	2,00

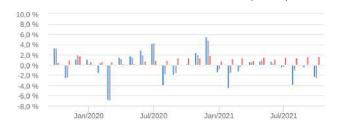
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,529407	211.455,34	290.681,49	7,62%	-13,01%	3,62%	1,15	4,29%	5,52%	-4,58%	3
IMA-B	-	-	-	5,57%	-6,37%	2,64%	1,00	0,00%	4,85%	-1,52%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B

## INPC + 6% META

#### Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



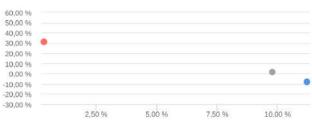
Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



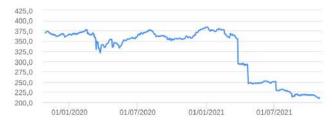
## Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



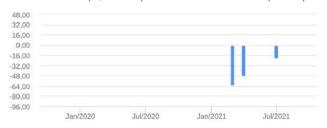




## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira



### :: CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	99,74%	99,73%	99,71%	99,34%	99,38%	99,36%	99,34%	99,68%
Operações Compromissadas	0,26%	0,27%	0,28%	0,66%	0,62%	0,64%	0,66%	0,32%
Disponibilidades	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Valores a pagar	-0,01%	-0,01%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,01%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	211.455,34	217.127,86	218.186,48	227.359,18	250.181,99	248.386,14	246.458,57	293.423,53
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	04/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							,	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	99,74 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	0,26 %
Outras Disponibilidades	0,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
Outros Valoros a receber	0.00.%



### :: CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA

#### Características

CNPJ: 14.508.643/0001-55 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,80%

Taxa de Administração (Máxima): 0,80%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Baixa Soberano

Código de Referência: 311685 Início do Fundo: 30/08/2012

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 100,00 Aplicação Adicional: R\$ 10,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	92,22	2,16	2,34	4,82	10,41	0,38	0,33	0,32	0,26	0,24	0,20	0,14	0,12	0,07	0,08	0,09	0,08
% do CDI	85,82	71,94	70,16	71,48	77,76	78,48	76,33	75,09	72,02	77,09	73,78	67,87	61,64	55,14	54,86	54,66	55,06
INPC + 6% META ATUARIAL	193,14	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
CDI	107,46	3,00	3,34	6,74	13,39	0,48	0,44	0,42	0,36	0,30	0,27	0,21	0,20	0,13	0,15	0,16	0,15

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,92221	615.231,42	717.290,57	0,08%	-	0,04%	0,87	0,01%	0,33%	0,07%	0
CDI	-	-	-	0,09%	-	0,04%	1,00	0,00%	0,44%	0,13%	0

#### Gráficos

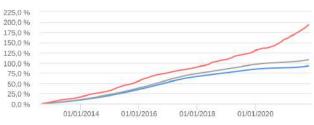
### ■ Fundo ■ CDI

### INPC + 6% META

#### Retorno Mensal - 31/08/2012 a 29/10/2021 (mensal)



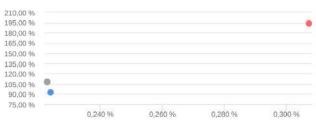
### Retorno Acumulado - 31/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



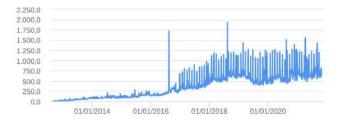
### Volatilidade Anualizada - 31/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



### Risco x Retorno - 31/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 31/08/2012 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

## Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - CDI



#### :: CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA

FUNDO	% do PL	M	ês	Ar	10	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
TONDO		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
CAIXA MASTER LIQUIDEZ FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,02	0,44	92,10	2,85	95,04	700,44	100,39	700,44	100,39	0,05	R\$ 43.375.492.503,2

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	100,02%	100,02%	100,01%	100,02%	100,02%	100,03%	100,03%	100,02%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,02%	-0,02%	-0,01%	-0,02%	-0,02%	-0,03%	-0,03%	-0,02%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	615.231,42	598.538,20	708.843,88	570.379,50	564.586,04	567.210,70	491.688,93	578.878,51
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	03/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021

Cotas de CAIXA MASTER LIQUIDEZ FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	100,02 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,02 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Outros Valores a pagar	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a receber / Ajustes de Quantidades Patrimônio Credor	0,00 %
Outras Disponibilidades	0,00 %

### :: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

29/10/2021

## Características

CNPJ: 23.215.097/0001-55 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,40%

Taxa de Administração (Máxima): 0,40%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 427683 Início do Fundo: 04/11/2016

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	48,69	-1,82	0,25	4,91	24,30	-0,66	0,35	-1,45	-0,78	0,00	0,24	0,66	0,30	-0,51	0,03	1,32	0,82
% do IPCA	183,06	-22,06	2,29	32,64	134,83	-52,90	30,60	-166,62	-80,79	-0,57	28,76	214,36	32,37	-59,02	10,12	97,83	92,13
INPC + 6% META ATUARIAL	68,75	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IPCA	26,59	8,24	10,76	15,03	18,02	1,25	1,16	0,87	0,96	0,53	0,83	0,31	0,93	0,86	0,25	1,35	0,89
Disco y Potorno				DI Má	dio		Por	rdo.				Tracking	n Po	torno	Potorn	_ V	/ezes

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,486859	13.374.488,42	15.152.437,41	2,40%	-3,46%	1,14%	0,39	2,41%	1,32%	-1,45%	1
IPCA	-	-	-	0,24%		0,11%	1,00	0,00%	1,35%	0,25%	0

#### Gráficos

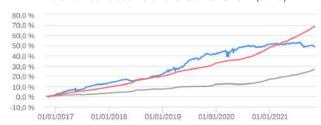
### ■ Fundo ■ IPCA

#### INPC + 6% META ATUARIAL

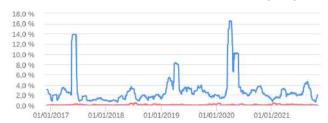
#### Retorno Acumulado - 07/11/2016 a 29/10/2021 (diária)



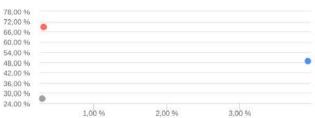
Retorno Mensal - 07/11/2016 a 29/10/2021 (mensal)



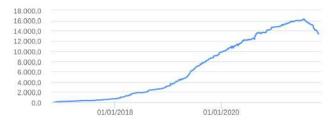
## Volatilidade Anualizada - 07/11/2016 a 29/10/2021 (diária)



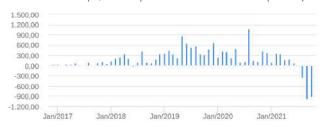




## Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 07/11/2016 a 29/10/2021 (diária)



## Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 07/11/2016 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

# Retorno (%) / % do Benchmark - IPCA

Performance dos Fundos em Carteira

As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis, não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Fundos de investimento não contam com a garantia do Administrador do fundo, Gestor da carteira, de qualquer mecanismo de seguro ou, ainda, do Fundo Garantidor de Créditos - FGC. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. As estratégias com derivativos, utilizadas como parte da política de investimento de fundos de investimento, podem resultar em significativas perdas para seus cotistas superiores ao capital aplicado e a consequente obrigação do cotista de aportar recursos adicionais para cobrir o prejuízo do fundo. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo de investimento ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo de investimento, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL). Para os cálculos foram utilizadas observações Diárias. Fonte: Quantum Axis.

out/2021



### :: CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA

EUNDO	% do PL	М	ês	Aı	no	Desde	o início	Desde o início		06 meses	12 meses
FUNDO	% d0 PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA	100,01	-0,63	-50,34	-1,60	-19,47	112,09	144,08	112,09	144,08	2,69	R\$ 13.399.003.175,5

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,00%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,01%	-0,01%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,01%	-0,01%	-0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	13.374.488,42	14.407.320,97	15.341.053,16	15.935.689,88	16.058.908,18	15.989.068,97	15.772.466,65	15.491.489,3
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	03/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)								out/2021



Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA	100,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Outras Disponibilidades	0.00 %

### :: CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 14.386.926/0001-71 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados

Código de Referência: 310638 Início do Fundo: 16/08/2012

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	143,22	1,46	4,35	10,97	23,77	-1,29	1,08	0,19	-0,06	-0,28	0,84	1,02	0,37	-0,53	0,13	1,65	1,22
% do IDkA IPCA 2 Anos	92,95	93,73	95,14	93,65	93,38	88,15	98,26	73,61	36,45	87,58	96,41	75,51	128,25	110,01	91,58	95,31	97,21
INPC + 6% META ATUARIAL	194,39	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IDkA IPCA 2 Anos	154,09	1,56	4,57	11,72	25,46	-1,47	1,10	0,26	-0,18	-0,32	0,88	1,35	0,29	-0,48	0,15	1,73	1,25

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,432232	11.036.712,36	11.069.263,42	2,64%	-2,37%	1,25%	0,94	0,76%	1,65%	-0,53%	4
IDkA IPCA 2 Anos	-	-	-	2,74%	-2,54%	1,30%	1,00	0,00%	1,73%	-0,48%	0

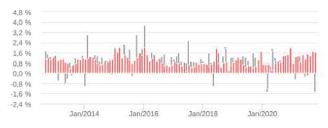
#### Gráficos

IDkA IPCA 2

Anos

INPC + 6% META ATUARIAL

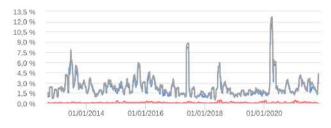




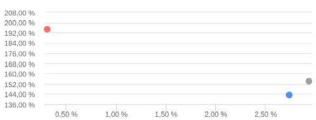




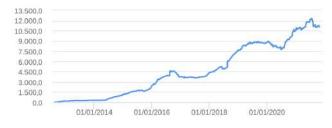
# Volatilidade Anualizada - 17/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



### Risco x Retorno - 17/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/08/2012 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira

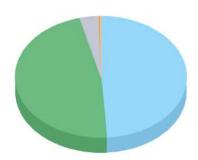


# :: CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	96,37%	95,80%	95,62%	96,02%	96,51%	96,57%	96,14%	95,75%
Operações Compromissadas	3,59%	4,20%	4,38%	3,99%	3,49%	3,43%	3,87%	4,24%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,02%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	0,00%	-0,01%	0,02%
Valores a receber	0,02%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,02%
Disponibilidades	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-	-	-	-	-	-	-	0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	11.036.712,36	11.068.272,49	11.382.462,17	12.042.628,72	11.796.463,83	11.767.802,94	11.053.033,77	10.861.361,9
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	03/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	48,93 %
■ NTN-B - Venc.: 15/05/2023 (BRSTNCNTB4O9)	47,16 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	3,59 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	0,27 %
Outras Disponibilidades	0,02 %
Outros Valores a receber	0,02 %
■ Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	0,02 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	0,01 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Valores a pagar / Taya de Permanência	0.00%

### :: CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 10.740.670/0001-06 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados

Código de Referência: 248975 Início do Fundo: 28/05/2010

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	164,04	1,05	1,59	5,52	12,98	-0,54	0,38	0,34	0,17	0,19	0,17	0,28	0,01	0,02	0,03	0,28	0,22
% do IRF-M 1	96,53	85,02	87,63	92,52	95,04	99,71	94,07	94,11	88,03	89,02	86,63	102,85	20,73	45,80	57,98	91,88	95,17
INPC + 6% META ATUARIAL	277,58	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IRF-M 1	169,95	1,23	1,82	5,97	13,66	-0,54	0,40	0,37	0,19	0,21	0,20	0,27	0,04	0,04	0,04	0,31	0,23

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,640412	6.589.712,90	9.736.626,10	0,57%	-0,87%	0,27%	1,01	0,03%	0,38%	0,01%	1
IRF-M 1	-	-	-	0,57%	-0,86%	0,27%	1,00	0,00%	0,40%	0,04%	0

#### Gráficos

### Fundo III IRF-M 1

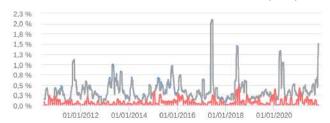
### INPC + 6% META

# Retorno Mensal - 31/05/2010 a 29/10/2021 (mensal) Retorno Acumulado - 31/05/2010 a 29/10/2021 (diária)

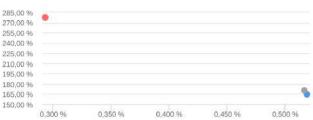




# Volatilidade Anualizada - 31/05/2010 a 29/10/2021 (diária)







# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/05/2010 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 31/05/2010 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira

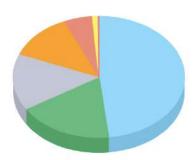


### :: CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA

Fundo	% do PL	Naminal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
rundo	% UU PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	voiatilluade	PL Medio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	51,62%	81,98%	89,74%	84,41%	97,87%	70,52%	23,52%	55,46%
Operações Compromissadas	48,20%	17,92%	10,16%	15,49%	1,90%	29,49%	76,50%	44,53%
Disponibilidades	0,13%	0,10%	0,11%	0,12%	0,23%	0,00%	0,00%	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,05%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-0,00%	-0,00%	-0,01%	0,01%
Valores a receber	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%
Valores a pagar	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-0,02%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,00%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-	-	-	-	-0,00%	-	-	-
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	6.589.712,90	6.805.654,31	7.025.686,89	7.606.396,26	8.267.613,29	8.656.297,00	9.264.610,22	9.801.758,90
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	04/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							(	out/2021



Operações Compromissadas - NTN-B - Venc.: 15/05/2023	48,20 %
LTN - Venc.: 01/01/2022 (BRSTNCLTN7K8)	17,98 %
LTN - Venc.: 01/07/2022 (BRSTNCLTN7O0)	15,07 %
LTN - Venc.: 01/04/2022 (BRSTNCLTN7T9)	12,30 %
LTN - Venc.: 01/10/2022 (BRSTNCLTN7V5)	5,27 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	1,01 %
Outras Disponibilidades	0,13 %
Outros Valores a receber	0,05 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTV22	0,03 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN22	0,01 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ22	0,01 %
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,00 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF22	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	0,00 %

### :: CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 14.508.605/0001-00 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,20%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados

Código de Referência: 310646 Início do Fundo: 16/08/2012

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+0

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	122,13	-5,68	-3,55	0,59	15,74	-2,64	-0,37	-0,63	-0,47	0,18	0,17	0,78	-0,89	-1,15	-0,77	1,96	0,33
% do IRF-M	96,16	103,39	106,66	54,15	94,93	100,50	112,06	106,17	98,92	85,07	85,09	92,35	105,26	97,81	96,08	100,38	91,30
INPC + 6% META ATUARIAL	194,39	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IRF-M	127,01	-5,50	-3,33	1,09	16,58	-2,63	-0,33	-0,60	-0,47	0,21	0,20	0,84	-0,84	-1,18	-0,80	1,95	0,36

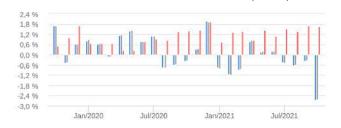
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	2,221301	1.295.006,19	2.548.969,22	3,33%	-6,12%	1,58%	1,00	0,10%	1,96%	-1,15%	4
IRF-M	-	-	-	3,31%	-5,94%	1,57%	1,00	0,00%	1,95%	-1,18%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IRF-M

### INPC + 6% META

# Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



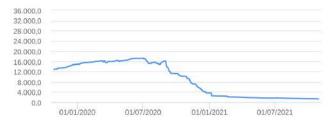
# Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



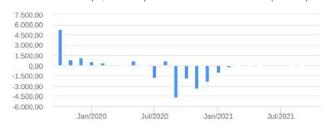




# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

# out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira

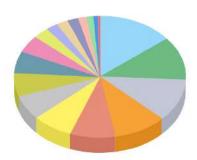


# :: CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)													
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21					
Títulos Públicos	98,22%	96,41%	99,05%	97,33%	92,23%	90,86%	92,67%	86,93%					
Operações Compromissadas	1,61%	3,65%	1,07%	2,90%	7,81%	9,21%	7,40%	13,07%					
Mercado Futuro - Posições compradas	0,17%	-0,05%	-0,13%	-0,23%	-0,08%	-0,06%	-0,06%	0,01%					
Valores a receber	0,17%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%					
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,01%	0,03%	0,00%	0,00%	0,00%					
Valores a pagar	-0,00%	-0,06%	-0,13%	-0,24%	-0,08%	-0,06%	-0,06%	-0,00%					
Mercado Futuro - Posições vendidas	-	-	-	-	-	-0,00%	0,00%	-0,00%					
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.295.006,19	1.386.776,00	1.494.910,22	1.581.480,88	1.645.783,27	1.660.439,04	1.814.422,37	1.953.428,3					
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	04/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021					
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							,	out/2021					



LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	14,29 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	11,55 %
LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	11,40 %
LTN - Venc.: 01/01/2024 (BRSTNCLTN7S1)	10,02 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	8,54 %
LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	7,63 %
■ LTN - Venc.: 01/07/2023 (BRSTNCLTN7Q5)	6,62 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2027 (BRSTNCNTF1P8)	6,21 %
LTN - Venc.: 01/01/2023 (BRSTNCLTN7D3)	5,74 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2023 (BRSTNCNTF147)	4,65 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCNTF170)	3,00 %
LTN - Venc.: 01/07/2024 (BRSTNCLTN7W3)	2,21 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2029 (BRSTNCNTF1Q6)	2,21 %
NTN-F - Venc.: 01/01/2031 (BRSTNCNTF204)	2,06 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	1,61 %
LTN - Venc.: 01/07/2022 (BRSTNCLTN7O0)	1,28 %
LTN - Venc.: 01/01/2025 (BRSTNCLTN7N2)	0,80 %
Outros Valores a receber	0,17 %
Lançamentos positivos menores que 0,17%	0,18 %



#### :: CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP

# Características

CNPJ: 30.036.235/0001-02 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,80%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui Classificação Anbima: Multimercados Livre

Código de Referência: 476692 Início do Fundo: 16/10/2018

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 100,00 Aplicação Adicional: R\$ 100,00 Saldo Mínimo: R\$ 50,00 Resgate Mínimo: R\$ 100,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	68,46	26,45	44,01	50,48	75,18	7,64	-4,64	3,34	2,63	2,71	0,48	5,38	4,05	2,70	-0,05	3,14	10,66
% do S&P 500	45,81	79,80	114,02	44,19	47,13	70,01	-638,68	100,11	55,73	-119,48	-18,20	-2.941,99	54,75	74,34	-1,26	289,27	461,64
INPC + 6% META ATUARIAL	42,66	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
S&P 500	149,43	33,14	38,59	114,24	159,51	10,92	0,73	3,34	4,72	-2,27	-2,64	-0,18	7,39	3,63	4,20	1,09	2,31

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,684579	3.490.527,60	1.758.763,11	13,17%	-5,16%	6,25%	0,34	16,65%	10,66%	-4,64%	6
S&P 500	-	-	-	19,75%	-11,30%	9,38%	1,00	0,00%	7,39%	-2,64%	0

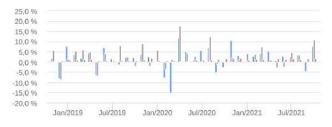
#### Gráficos

■ Fundo ■

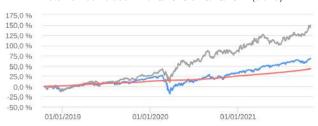
S&P

INPC + 6% META

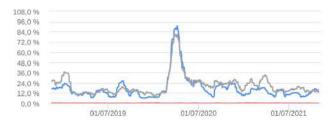
#### Retorno Mensal - 17/10/2018 a 29/10/2021 (mensal)



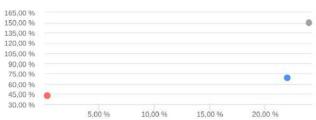
# Retorno Acumulado - 17/10/2018 a 29/10/2021 (diária)



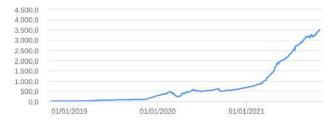
# Volatilidade Anualizada - 17/10/2018 a 29/10/2021 (diária)



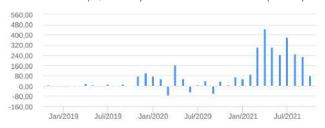
### Risco x Retorno - 17/10/2018 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 17/10/2018 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 17/10/2018 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira

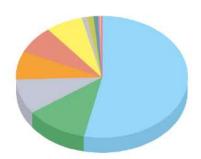


#### :: CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)													
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21					
Operações Compromissadas	54,07%	52,66%	50,57%	44,66%	51,93%	45,94%	42,05%	42,90%					
Títulos Públicos	44,89%	48,83%	49,50%	55,43%	48,00%	55,01%	58,50%	56,62%					
Mercado Futuro - Posições compradas	1,11%	-1,33%	-0,04%	-0,03%	0,12%	-0,27%	-0,47%	0,54%					
Valores a receber	1,11%	-	0,00%	0,00%	0,12%	0,00%	0,00%	0,54%					
Disponibilidades	0,00%	0,01%	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%					
Valores a pagar	-0,07%	-1,50%	-0,09%	-0,09%	-0,05%	-0,94%	-0,55%	-0,06%					
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	3.490.527,60	3.166.279,76	3.077.448,00	2.736.512,00	2.298.502,55	1.997.517,42	1.686.612,03	1.178.826,44					
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	04/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021					
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021					



Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2023	54,07 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2027 (BRSTNCLF1RH3)	11,87 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2026 (BRSTNCLF1RF7)	9,42 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2027 (BRSTNCLF1RG5)	7,56 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	7,52 %
LFT - Venc.: 01/03/2025 (BRSTNCLF1RC4)	7,05 %
Outros Valores a receber	1,11 %
Mercado Futuro - Posições compradas - ISPFUTZ21	1,11 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	0,89 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	0,40 %
LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	0,12 %
Outros Valores a pagar	-0,05 %
LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	0,04 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,02 %
■ Valores a pagar / Imposto de Renda	-0,01 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
Lancamentos positivos menores que 0.00%	0.00 %

## :: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I

#### 29/10/2021

#### Características

CNPJ: 17.502.937/0001-68 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 0,70%

Taxa de Administração (Máxima): 0,70% Classificação Anbima: Ações Livre

Código de Referência: 339075

Início do Fundo: 24/06/2013

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 100,00 Saldo Mínimo: R\$ 500,00 Resgate Mínimo: R\$ 100,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du

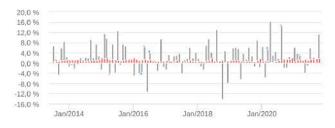
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	579,63	29,48	31,25	115,30	160,14	10,93	-0,25	2,44	5,42	-1,19	-3,79	0,61	3,43	3,55	5,79	0,69	2,43
% do Global BDRX	79,09	91,29	90,39	96,40	95,79	98,00	145,53	106,96	91,65	421,09	98,68	62,68	111,29	90,32	94,69	74,44	95,23
INPC + 6% META ATUARIAL	163,90	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
Global BDRX	732,87	32,29	34,57	119,61	167,18	11,15	-0,17	2,28	5,91	-0,28	-3,85	0,98	3,08	3,93	6,11	0,93	2,55

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	6,796263	3.720.209,18	2.714.692,33	17,56%	-12,53%	8,34%	1,00	1,73%	5,79%	-3,79%	3
Global BDRX	-	-	-	17,83%	-11,82%	8,47%	1,00	0,00%	6,11%	-3,85%	0

#### Gráficos

Global ■ Fundo ■ BDRX INPC + 6% META

#### Retorno Mensal - 26/06/2013 a 29/10/2021 (mensal)



# Retorno Acumulado - 26/06/2013 a 29/10/2021 (diária)



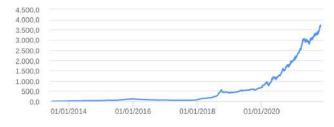
# Volatilidade Anualizada - 26/06/2013 a 29/10/2021 (diária)



### Risco x Retorno - 26/06/2013 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 26/06/2013 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 26/06/2013 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - Global BDRX



## :: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I

		Mês		Ano		Desde o início		Desde o início		06 mes	es 12	2 meses
FUNDO	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nomina	I Relativo	Nominal	Relativo	Volatilid	ade Pl	_ Médio
CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,34	0,52	4,70	3,10	9,60	513,78	-	513,78	-	0,07	R\$ 10.	770.751.786,3
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% d	o PL)											
Tipo de Aplicação		out/21		set/21	ago/21	1	jul/21	jun/21	n	nai/21	abr/21	mar/21
Brazilian Depository Receipt - BDR		98,86% 9		99,12%	99,08%	6	98,69%	99,27%	9	7,98%	98,83%	99,11%
Cotas de Fundos		1,34%		1,01%	1,29%		1,29%	0,85%	2	2,15%	2,90%	2,05%
Valores a receber		0,07%		0,07%	0,08%		0,06%		(	0,09%	0,07%	0,05%
Outras Aplicações		0,00%		0,00%	0,00%		0,00%		(	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades		0,00%		0,00%	0,00%		0,00%	0,00%	(	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar		-0,25%		-0,29%	-0,39%		-0,21%	-0,33%	-1	0,56%	-1,58%	-1,06%
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo		-		-	-		0,10%	0,13%	(	),12%	0,03%	0,09%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	3.720.209	,18 3.3	37.438,39	3.230.077	,34 3.0	76.433,38	2.860.128	,89 2.99	4.024,84	3.039.632,41	2.719.540,70	
Data da Divulgação			21 05	5/10/2021	03/09/20	21 04	1/08/2021	02/07/20	21 26/	07/2021	26/07/2021	26/07/2021

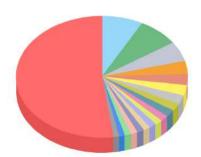


## :: CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I

29/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2021



MICROSOFT DRN - MSFT34	7,81 %
APPLE DRN - AAPL34	7,78 %
AMAZON DRN - AMZO34	5,32 %
TESLA MOTORS DRN - TSLA34	3,48 %
ALPHABET DRN - GOGL35	2,98 %
ALPHABET DRN - GOGL34	2,79 %
FACEBOOK DRN - FBOK34	2,40 %
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	2,00 %
TAIWANSMFAC DRN - TSMC34	1,85 %
JPMORGAN DRN - JPMC34	1,59 %
ALIBABAGR DRN - BABA34	1,40 %
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	1,35 %
Cotas de CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L	1,34 %
WAL MART DRN - WALM34	1,31 %
BANK AMERICA DRN - BOAC34	1,26 %
HOME DEPOT DRN - HOME34	1,23 %
PG DRN - PGCO34	1,09 %
ASML HOLD DRN - ASML34	1,06 %
Lancamentos positivos menores que 1.06%	52.22 %

#### **::** CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP

#### 29/10/2021

### Características

CNPJ: 03.737.188/0001-43 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 1,00%

Taxa de Administração (Máxima): 1,00%

Classificação Anbima: Multimercados Balanceados

Código de Referência: 94552 Início do Fundo: 20/06/2000

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 0,00 Aplicação Adicional: R\$ 0,00 Saldo Mínimo: R\$ 0,00 Resgate Mínimo: R\$ 0,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	663,01	-2,19	3,87	3,62	16,23	-1,47	-1,58	-0,57	-0,83	0,39	1,91	0,13	1,58	-1,13	-0,58	2,56	4,02
% do CDI	73,30	-72,86	115,95	53,62	121,22	-306,36	-359,91	-133,41	-233,92	129,43	714,38	64,31	797,31	-843,45	-387,49	1.557,09	2.686,88
INPC + 6% META ATUARIAL	1.132,73	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
CDI	904,57	3,00	3,34	6,74	13,39	0,48	0,44	0,42	0,36	0,30	0,27	0,21	0,20	0,13	0,15	0,16	0,15

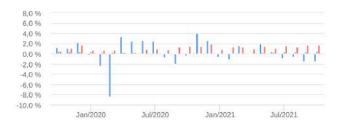
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	7,7770383	1.671.301,25	2.047.478,06	5,81%	-4,86%	2,76%	-9,15	5,82%	4,02%	-1,58%	5
CDI	-	-	-	0,09%		0,04%	1,00	0,00%	0,44%	0,13%	0

#### Gráficos

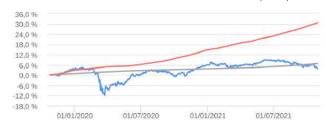
### ■ Fundo ■ CDI

# INPC + 6% META

#### Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



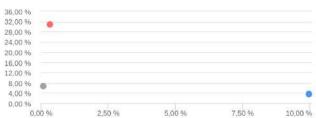
Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



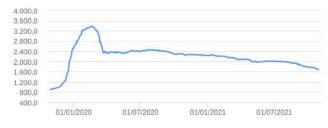
# Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



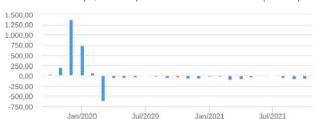




# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

# out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira



#### :: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP

29/10/2021

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

#### Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	90,88%	89,18%	83,11%	80,16%	76,84%	77,21%	77,21%	78,99%
Operações Compromissadas	8,61%	9,73%	16,06%	19,24%	21,03%	20,91%	20,85%	20,03%
Ações	1,63%	1,31%	1,36%	1,38%	1,72%	2,17%	2,16%	0,99%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	0,44%	0,33%	0,35%	0,35%	0,36%	0,37%	0,33%	0,30%
DIFERENCIAL DE SWAP A PAGAR	0,05%	0,04%	0,04%	-0,03%	-0,04%	-	-0,02%	-0,03%
Opções - Posições titulares	0,01%	0,01%	0,02%	0,01%	0,00%	0,02%	0,03%	0,03%
Mercado Futuro - Posições vendidas	0,01%	0,00%	0,01%	0,02%	0,01%	0,00%	0,01%	-0,00%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,48%	0,00%	0,12%	0,10%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Opções - Posições lançadas	-0,03%	-0,02%	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,02%	-0,02%	-0,03%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,41%	-0,13%	-0,31%	-0,83%	-0,12%	0,11%	-0,21%	-0,08%
Valores a pagar	-1,08%	0,38%	0,54%	-0,28%	-0,28%	-0,76%	-0,48%	-0,32%
DIFERENCIAL DE SWAP A RECEBER	-	-	-	-	0,02%	-	0,02%	0,02%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.671.301,25	1.779.046,99	1.905.455,97	1.969.915,38	1.998.829,24	1.978.910,27	1.980.759,33	2.072.663,72
Data da Divulgação	09/11/2021	06/10/2021	08/09/2021	09/08/2021	07/07/2021	08/06/2021	11/05/2021	07/04/2021

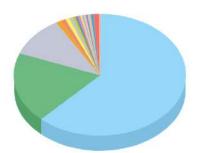


#### :: CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP

29/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2021



LFT - Venc.: 01/03/2026 (BRSTNCLF1RE0)	63,52 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2031	19,24 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	10,99 %
LFT - Venc.: 01/09/2022 (BRSTNCLF1R74)	1,11 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2024 (BRSTNCLF0008)	0,79 %
Mercado Futuro - Posições compradas - INDFUTQ21	-0,77 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2023 (BRSTNCLF1R82)	0,68 %
LFT - Venc.: 01/03/2022 (BRSTNCLF1R66)	0,54 %
■ VALE ON N1 - VALE3	0,51 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	0,45 %
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	0,36 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	0,36 %
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	0,36 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	0,36 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	0,35 %
■ LFT - Venc.: 01/09/2023 (BRSTNCLF1R90)	0,30 %
Outros Valores a pagar	-0,28 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	0,28 %
Lançamentos positivos menores que 0,28%	0,95 %
Lançamentos negativos maiores que -0,28%	-0,11 %

## :: CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

#### 29/10/2021

#### Características

CNPJ: 15.154.220/0001-47 Gestão: Caixa DTVM

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 1,50%

Taxa de Administração (Máxima): 1,50%

Classificação Anbima: Ações Small Caps Código de Referência: 317594

Início do Fundo: 01/11/2012

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 100,00 Saldo Mínimo: R\$ 500,00 Resgate Mínimo: R\$ 100,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	59,79	-17,84	0,43	-5,33	33,29	-12,37	-6,52	-5,01	-5,25	1,09	6,62	4,37	4,73	-1,99	-3,48	7,60	15,73
% do SMLL	103,10	102,66	23,19	319,83	77,49	98,75	101,47	131,13	90,60	83,96	104,81	99,91	103,63	108,50	101,31	101,08	94,53
INPC + 6% META ATUARIAL	186,11	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
SMLL	57,99	-17,37	1,85	-1,67	42,96	-12,53	-6,43	-3,82	-5,80	1,29	6,32	4,38	4,56	-1,84	-3,43	7,52	16,64

Risco x Rei (12 mese	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,597908	900.555,24	1.196.798,13	23,35%	-27,79%	11,09%	0,98	1,62%	15,73%	-6,52%	4
SMLL	-	-	-	23,86%	-27,69%	11,33%	1,00	0,00%	16,64%	-6,43%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ SMLL

### INPC + 6% META

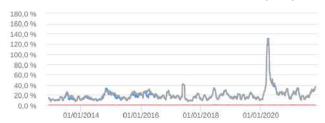
# Retorno Acumulado - 06/11/2012 a 29/10/2021 (diária)



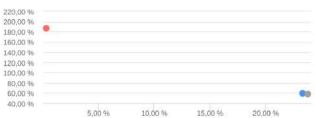
Retorno Mensal - 06/11/2012 a 29/10/2021 (mensal)



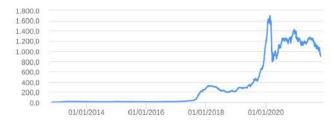
# Volatilidade Anualizada - 06/11/2012 a 29/10/2021 (diária)







# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 06/11/2012 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 06/11/2012 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - S&P 500



#### **::** CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

FUNDO %	6 do PL	M	ês	A	no	Desde	o início	Desde	o início	06 mes	es 12	? meses
1 UNDC	O GO FL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilida	ade PL	Médio
CAIXA MASTER CONSERVADOR FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,70	0,52	4,81	3,10	9,35	513,78	65,95	513,78	65,95	0,07	R\$ 10.7	770.751.786,3
Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do P	PL)											
Tipo de Aplicação		out/2	1	set/21	ago/21	ı	jul/21	jun/21	m	nai/21	abr/21	mar/21
Ações		90,799	%	91,51%	93,20%	6 9	3,69%	92,61%	6 9	1,97%	91,90%	92,73%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários		8,46%	6	7,51%	5,94%		5,54%	3,21%	, 4	1,30%	4,57%	6,10%
Cotas de Fundos		0,70%	6	0,95%	0,82%	. (	0,81%	0,95%	, 1	,69%	1,14%	0,42%
Valores a receber		0,36%	6	0,34%	0,28%	. (	0,28%	1,25%		),58%	0,81%	0,45%
Disponibilidades		0,00%	ó	0,00%	0,00%		0,00%	0,00%		0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar		-0,29%	6	0,25%	-0,24%	-	0,26%	-0,33%	, -(	0,78%	-0,34%	-0,30%
Brazilian Depository Receipt - BDR	razilian Depository Receipt - BDR			-	-	(	0,00%	0,12%	,	-	-	-
Outras Aplicações	-		-	-		-	2,29%	. 2	2,37%	2,19%	0,62%	
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública				-	-		0,00%	0,04%	. (	0,00%	0,00%	0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)			,24 1.0	47.084,85	1.120.309	,78 1.19	98.050,35	1.246.438	3,86 1.22	5.325,29	1.149.638,97	1.134.931,03
Data da Divulgação			021 05	/10/2021	03/09/20	21 03	/08/2021	02/07/20	21 26/	07/2021	26/07/2021	26/07/2021

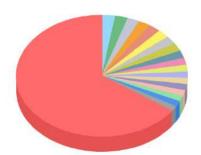


### **::** CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES

29/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2021



MARFRIG ON NM - MRFG3	2,53 %
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	2,40 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	2,32 %
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	2,25 %
AZUL PN N2 - AZUL4	2,24 %
TAESA UNT N2 - TAEE11	2,20 %
PETZ ON NM - PETZ3	2,19 %
LOCAWEB ON NM - LWSA3	2,17 %
SUL AMERICA UNT N2 - SULA11	2,03 %
MINERVA ON NM - BEEF3	1,91 %
LOCAMERICA ON NM - LCAM3	1,76 %
YDUQS PART ON NM - YDUQ3	1,72 %
BR MALLS PAR ON NM - BRML3	1,66 %
■ IRBBRASIL RE ON NM - IRBR3	1,62 %
FLEURY ON NM - FLRY3	1,57 %
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	1,52 %
SAO MARTINHO ON NM - SMTO3	1,50 %
MULTIPLAN ON N2 - MULT3	1,39 %
Lancamentos positivos menores que 1.39%	65.34 %

# :: CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES

#### 29/10/2021

#### Características

CNPJ: 15.154.441/0001-15 Gestão: Vinci Partners

Administrador: Caixa Econômica Federal

Taxa de Administração: 1,72%

Taxa de Administração (Máxima): 1,72% Classificação Anbima: Ações Dividendos

Código de Referência: 311383

Início do Fundo: 23/08/2012

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 10.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 100,00 Saldo Mínimo: R\$ 5.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 100,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+30 du

Conversado da Cota para recogato. E 100 da	
Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+32 du	

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	94,66	-11,26	9,08	2,27	45,18	-4,31	-6,49	-1,32	-3,17	-1,76	5,95	2,52	5,62	-4,31	-3,76	9,37	14,26
% do IDIV	107,78	129,28	75,22	97,39	98,71	101,72	144,63	262,90	184,71	81,12	105,45	124,34	74,26	82,85	74,08	104,83	99,02
INPC + 6% META ATUARIAL	193,64	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IDIV	87,83	-8,71	12,08	2,33	45,77	-4,23	-4,48	-0,50	-1,72	-2,17	5,64	2,03	7,57	-5,21	-5,08	8,94	14,40

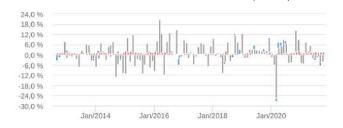
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	1,946622	970.137,12	998.011,85	18,89%	-18,70%	8,97%	0,95	5,90%	14,26%	-6,49%	6
IDIV	-	-	-	19,15%	-15,86%	9,10%	1,00	0,00%	14,40%	-5,21%	0

#### Gráficos

## ■ Fundo ■ IDIV

#### INPC + 6% META ATUARIAL

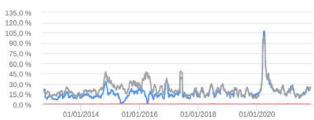
### Retorno Acumulado - 27/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



Retorno Mensal - 27/08/2012 a 29/10/2021 (mensal)



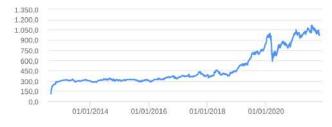
### Volatilidade Anualizada - 27/08/2012 a 29/10/2021 (diária)







# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 27/08/2012 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 27/08/2012 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - IDIV



#### **::** CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES

		М	ês	Ano		Desde o início		Desde o início		06 meses	12 meses
FUNDO	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	99,97	-4,17	98,62	-9,98	114,56	148,23	168,77	148,23	168,77	18,00	R\$ 997.643.513,2

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	99,97%	99,98%	100,00%	100,02%	100,02%	100,01%	100,03%	100,05%
Operações Compromissadas	0,17%	0,17%	0,15%	0,12%	0,13%	0,13%	0,10%	0,10%
Valores a receber	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-5,43%	-4,62%	-0,40%	-0,34%	-0,71%	-0,45%	-3,63%	-3,95%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	970.137,12	1.005.326,84	1.063.389,65	1.075.548,70	1.018.349,88	1.038.685,44	1.009.047,13	979.013,92
Data da Divulgação	04/11/2021	05/10/2021	03/09/2021	03/08/2021	02/07/2021	04/06/2021	05/05/2021	01/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021



Cotas de CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	99,97 %
Outros Valores a pagar	-5,35 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/10/2022	0,17 %
■ Valores a pagar / Taxa de Administração	-0,08 %
Outras Disponibilidades	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Cetip	0,00 %
■ Valores a receber / Taxa de Fiscalização CVM	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,00 %
■ Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
Valores a pagar / Taxa Selic	0.00 %

## :: CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 11.182.064/0001-77
Gestão: Constância Investimentos
Administrador: BEM DTVM
Taxa de Administração: 2,00%
Taxa de Administração (Máxima): 2,50%
Classificação Anbima: Ações Livre

Código de Referência: 236942

Início do Fundo: 16/10/2009

### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00 Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+14 du Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+15 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	250,59	-8,05	8,67	1,41	41,81	-6,92	-4,73	-3,21	-4,13	-0,26	4,36	5,27	8,97	-2,57	-3,95	6,28	13,48
% do Ibovespa	444,73	61,71	101,65	-39,27	181,05	102,72	72,01	129,37	104,72	-56,47	70,84	271,92	149,65	58,70	118,96	67,59	84,77
INPC + 6% META ATUARIAL	307,71	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
Ibovespa	56,35	-13,04	8,53	-3,60	23,09	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16	1,94	6,00	-4,37	-3,32	9,30	15,90

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	3,5058602	1.046.179,74	1.181.902,53	18,28%	-20,11%	8,68%	0,87	7,45%	13,48%	-4,73%	4
Ibovespa	-	-	-	21,03%	-20,86%	9,99%	1,00	0,00%	15,90%	-6,57%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ Ibovespa

#### INPC + 6% META ATUARIAL

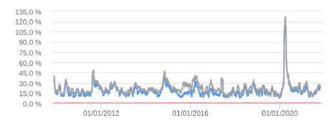
#### ATOANIAL



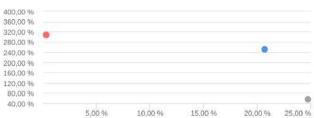
Retorno Mensal - 19/10/2009 a 29/10/2021 (mensal)



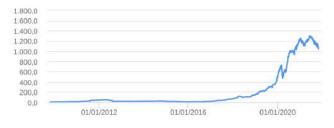
# Volatilidade Anualizada - 19/10/2009 a 29/10/2021 (diária)







# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 19/10/2009 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 19/10/2009 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

# out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira



## :: CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES

29/10/2021

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Ações	85,40%	87,54%	85,75%	87,93%	87,44%	86,16%	88,46%	86,90%
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	9,09%	8,23%	10,83%	9,36%	9,36%	9,22%	9,35%	8,53%
Operações Compromissadas	5,77%	3,48%	3,09%	1,68%	3,09%	3,10%	2,23%	2,96%
Valores a receber	0,64%	1,38%	1,37%	2,76%	0,61%	1,55%	1,46%	0,86%
Títulos Públicos	0,11%	0,10%	0,09%	0,09%	0,08%	0,09%	0,09%	0,09%
Opções - Posições titulares	0,11%	0,39%	0,36%	0,05%	0,32%	0,44%	0,09%	0,26%
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo	0,02%	-	-	-	0,08%	0,09%	-	0,60%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Mercado Futuro - Posições compradas	-0,01%	-0,01%	-0,01%	-0,22%	0,02%	0,05%	-0,11%	0,05%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-0,02%	0,05%	-0,00%	-0,00%	-0,07%	0,00%	-0,06%	0,05%
Opções - Posições lançadas	-0,54%	-0,22%	-0,15%	-0,22%	-0,18%	-0,07%	-0,08%	-0,05%
Valores a pagar	-0,57%	0,94%	-1,39%	-1,49%	-0,74%	-0,68%	-1,63%	-0,34%
Obrigações por ações e outros TVM recebidos em empréstimo	-	-	-	-	-	-	-0,07%	-
Outros valores mobiliários registrados na CVM objeto de oferta pública	-	-	0,06%	0,07%	-	0,05%	0,12%	0,08%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.046.179,74	1.103.362,09	1.182.033,10	1.205.805,40	1.271.005,43	1.253.084,48	1.190.223,58	1.164.556,50
Data da Divulgação	09/11/2021	11/10/2021	09/09/2021	11/08/2021	12/07/2021	10/06/2021	11/05/2021	12/04/2021

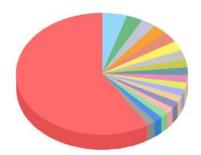


### :: CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES

29/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

jul/2021



VALE ON N1 - VALE3	4,87 %
JBS ON NM - JBSS3	3,10 %
TAESA UNT N2 - TAEE11	2,86 %
PETROBRAS DISTRIB ON - BRDT3	2,86 %
Outros Valores a receber	2,76 %
CEMIG PN N1 - CMIG4	2,67 %
CSNMINERACAOON N2 - CMIN3	2,54 %
GERDAU PN N1 - GGBR4	2,17 %
ALUPAR UNT N2 - ALUP11	2,11 %
GRENDENE ON NM - GRND3	2,06 %
KEPLER WEBER ON - KEPL3	1,89 %
FERBASA PN N1 - FESA4	1,84 %
JHSF PART ON NM - JHSF3	1,79 %
SLC AGRICOLA ON NM - SLCE3	1,75 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2022	1,68 %
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	1,68 %
■ BTGP BANCO UNT - BPAC11	1,66 %
■ ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	1,66 %
Lançamentos positivos menores que 1,66%	60,00 %



### :: INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP

#### Características do FIDC

Gestão: Singulare Invest Administrador: Singulare Invest Custodiante: Singulare Invest Auditoria: BDO Brasil

Classificação Anbima: FIDC Fomento Mercantil Foco de Atuação: FIDC Fomento Mercantil

Cedente: Multicedente

Condomínio: Fechado Prazo do Fundo: 10 anos Classificação Legal: FIDC Data de Registro: 11/12/2012

Direito Creditório: Recebíveis Comerciais Razão de Garantia Mínima: 175 44%

Política de Investimento: Aplica em direitos creditórios representados por duplicatas ou cheques por contratos de compra e venda e/ou de prestação de serviços, de titularidade de empresas atuantes nos segmentos financeiro, comercial, industrial.

#### Características da Série

Classe: Sênior Série: 1

Rating Agencia: Dispensada Rating Atual: Dispensado Rentabilidade Alvo: 125% do CDI Amortização Tipo Regra: Outros Início da Série: 17/02/2014

Situação Atual: Em funcionamento normal

Prazo da Série: Junho de 2018 Rating Última Atualização: Não se aplica Rating Monitoramento: Retirado

% Mínimo de Cotas Subordinadas: 45% de cotas subordinadas.

Próxima data de Amortização: Não Informado

Amortização Principal a Pagar: R\$ 3 milhões até 31/01/2018; 60% das liquidações da carteira de 29/12/2017 divididos em parcelas iguais; pagos nos últimos dias dos meses de fevereiro até maio. Saldo remanescente será pago em 29/06/2018.

Retorno (%)	Mês	Ano	6 meses	12 meses	24 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Série	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	0,00
CDI	0,48	3,00	2,02	3,32	6,65	0,48	0,44	0,42	0,36	0,30	0,27	0,21	0,20	0,13	0,15	0,16	0,15
% CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,00	0,00	0,00
+ CDI	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,15	-0,16	-0,15
IPCA	1,25	8,24	4,86	10,67	15,01	1,25	1,16	0,87	0,96	0,53	0,83	0,31	0,93	0,86	0,25	1,35	0,89
+ IPCA	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-0,25	-1,35	-0,89
CDI	0,48	3,00	2,02	3,32	6,65	0,48	0,44	0,42	0,36	0,30	0,27	0,21	0,20	0,13	0,15	0,16	0,15

#### Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 18/02/2021 (mensal)



# Retorno Acumulado - 28/10/2019 a 18/02/2021 (mensal)



ATUARIAL

Histórico*	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
FIDC (R\$)	0,03	0,03	0,02	0,01	0,00	0,01	0,02	0,00	0,01	0,03	0,02	0,03
Série (R\$)	0,03	0,03	0,02	0,01	0,00	0,01	0,02	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Sênior (R\$)	0,03	0,03	0,02	0,01	0,00	0,01	0,02	-	-	0,00	0,00	0,00
Subordinada/Única (R\$)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,03	0,02	0,03
% Subordinação	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	100,07%	100,32%	99,73%
DC (R\$)	1,59	1,63	1,67	0,51	0,56	0,61	0,67	0,72	0,76	0,81	0,82	0,87
PDD (R\$)	1,59	1,63	1,67	0,51	0,56	0,61	0,67	0,72	0,76	0,81	0,82	0,87
CVNP (R\$)	0,63	0,72	0,80	0,89	0,98	1,06	1,16	1,26	1,15	1,15	1,13	1,13
PDD/DC (%)	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%	100,00%
DC/PL (%)	5.773,13%	5.058,60%	7.682,79%	5.687,79%	11.206,23%	4.701,82%	3.419,95%	15.936,59%	5.312,89%	2.486,35%	3.394,68%	3.062,14%
CVNP/DC (%)	39,83%	44,08%	47,88%	175,53%	175,02%	174,87%	174,75%	174,18%	151,20%	142,35%	137,88%	130,42%

Fundo

■ CDI

:: ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES 29/10/2021

#### Características

CNPJ: 24.571.992/0001-75
Gestão: Itaú Unibanco
Administrador: Itaú Unibanco
Taxa de Administração: 1,90%
Taxa de Administração (Máxima): 2,00%
Classificação Anbima: Ações Livre
Código de Referência: 423701

Início do Fundo: 12/09/2016

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1,00 Aplicação Adicional: R\$ 1,00 Saldo Mínimo: R\$ 1,00 Resgate Mínimo: R\$ 1,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+21 du Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+23 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	107,70	-8,06	9,27	-2,56	35,81	-7,54	-6,52	-2,21	-3,08	-0,21	7,67	3,31	2,12	0,47	-1,46	6,30	12,28
% do Ibovespa	140,48	61,82	108,67	71,05	155,07	111,84	99,29	88,95	78,00	-45,46	124,55	170,95	35,32	-10,82	44,12	67,71	77,21
INPC + 6% META ATUARIAL	70,60	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
Ibovespa	76,66	-13,04	8,53	-3,60	23,09	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16	1,94	6,00	-4,37	-3,32	9,30	15,90

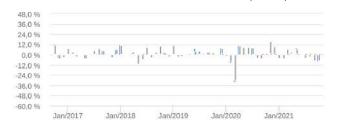
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	20,76961	2.833.533,74	3.446.527,69	18,12%	-20,31%	8,60%	0,85	8,17%	12,28%	-6,52%	8
Ibovespa	-	-	-	21,03%	-20,86%	9,99%	1,00	0,00%	15,90%	-6,57%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ Ibovespa

#### INPC + 6% META ATUARIAL

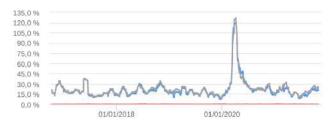
#### Determe Assessed



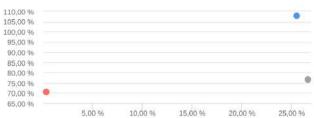
Retorno Mensal - 13/09/2016 a 29/10/2021 (mensal)



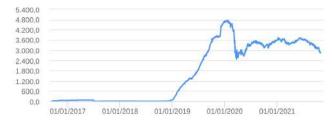
# Volatilidade Anualizada - 13/09/2016 a 29/10/2021 (diária)



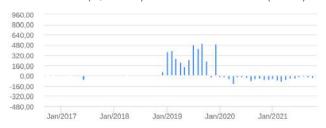




# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 13/09/2016 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 13/09/2016 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

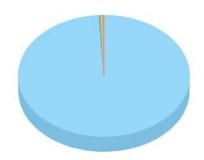
Retorno (%) / % do Benchmark - Ibovespa



### **::** ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES

FUNDO	% do PL	М	ês	Aı	no	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
TONDO		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	99,82	-7,39	109,66	-6,57	50,42	151,65	183,31	151,65	183,31	17,07	R\$ 4.264.816.394,5
ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	0,25	-6,49	96,26	-12,76	97,89	312,72	96,87	312,72	96,87	19,83	R\$ 308.070.493,1

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	100,07%	100,13%	100,16%	100,15%	100,14%	100,11%	100,09%	100,06%
Valores a receber	0,30%	0,43%	0,10%	0,13%	0,14%	0,14%	0,26%	0,37%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,37%	-0,56%	-0,26%	-0,28%	-0,28%	-0,26%	-0,36%	-0,43%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	2.833.533,74	3.106.281,74	3.356.109,15	3.453.398,73	3.594.423,12	3.647.662,72	3.432.293,08	3.385.715,2
Data da Divulgação	06/11/2021	07/10/2021	09/09/2021	05/08/2021	07/07/2021	07/06/2021	06/05/2021	07/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021



Cotas de ITAÚ DUNAMIS MASTER FI AÇÕES	99,82 %
Outros Valores a pagar	-0,37 %
Outros Valores a receber	0,30 %
Cotas de ITAÚ CAIXA FI AÇÕES	0,25 %
Outras Disponibilidades	0.00%

### :: ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I

29/10/2021

#### Características

CNPJ: 09.093.819/0001-15 Gestão: Itaú Unibanco Administrador: Itaú Unibanco Taxa de Administração: 0,18% Taxa de Administração (Máxima): 0,18%

Classificação Anbima: Renda Fixa Indexados

Código de Referência: 233651 Início do Fundo: 03/09/2009

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00 Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+0

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+1 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	254,44	1,04	4,13	10,20	25,19	-1,25	0,98	0,14	0,01	-0,15	0,67	0,86	0,33	-0,61	0,08	1,81	1,29
% do IMA-B 5	94,82	85,43	94,63	95,79	96,65	101,22	98,31	89,81	42,41	114,10	97,03	98,08	95,02	102,46	76,97	98,99	97,70
INPC + 6% META ATUARIAL	311,53	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B 5	268,34	1,22	4,37	10,65	26,07	-1,24	1,00	0,15	0,03	-0,13	0,69	0,87	0,34	-0,60	0,11	1,83	1,32

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	35,443683	1.470.480,06	1.537.565,79	2,67%	-2,28%	1,27%	1,00	0,01%	1,81%	-0,61%	0
IMA-B 5	-	-	-	2,68%	-2,28%	1,27%	1,00	0,00%	1,83%	-0,60%	0

#### Gráficos

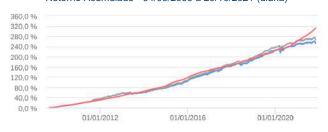
### Fundo III IMA-B 5

#### INPC + 6% META

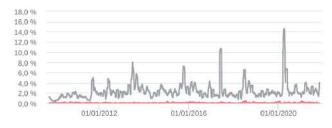
#### Retorno Mensal - 04/09/2009 a 29/10/2021 (mensal)



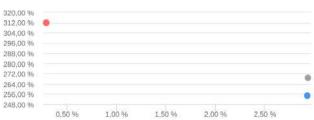
# Retorno Acumulado - 04/09/2009 a 29/10/2021 (diária)



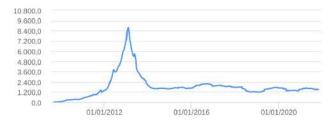
# Volatilidade Anualizada - 04/09/2009 a 29/10/2021 (diária)



### Risco x Retorno - 04/09/2009 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 04/09/2009 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 04/09/2009 a 29/10/2021 (mensal)



# Composição da Carteira

### out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira

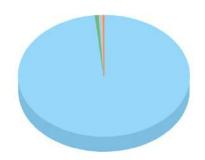
Retorno (%) / % do Benchmark - IMA-B 5



### :: ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I

FUNDO	% do PL	М	ês	Aı	no	Desde	o início	Desde	o início	06 meses	12 meses
TONDO	/8 UO F L	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
ITAÚ VERSO V FI RENDA FIXA	99,82	-1,24	100,25	1,20	98,34	177,77	99,96	177,77	99,96	2,78	R\$ 8.595.472.973,3
ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,19	0,51	-41,45	3,07	252,25	149,59	66,74	149,59	66,74	0,07	R\$ 30.165.255.824,9

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	100,01%	99,98%
Valores a receber	0,72%	0,04%	0,22%	0,14%	0,15%	0,23%	0,10%	0,17%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,74%	-0,06%	-0,23%	-0,16%	-0,16%	-0,24%	-0,12%	-0,16%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.470.480,06	1.512.297,73	1.537.702,22	1.542.726,44	1.606.247,66	1.613.211,24	1.624.728,75	1.638.822,93
Data da Divulgação	06/11/2021	07/10/2021	08/09/2021	05/08/2021	07/07/2021	07/06/2021	07/05/2021	07/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							C	out/2021



Cotas de ITAÚ VERSO V FI RENDA FIXA	99,82 %
Outros Valores a pagar	-0,74 %
Outros Valores a receber	0,72 %
Cotas de ITAÚ VERSO A FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,19 %
Outras Disponibilidades	0.00 %

### :: MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES

29/10/2021

### Características

CNPJ: 33.913.562/0001-85 Gestão: XP Asset Management Administrador: BNP Paribas Taxa de Administração: 0,80%

Taxa de Administração (Máxima): Não possui Classificação Anbima: Ações Investimento no Exterior

Código de Referência: 522163 Início do Fundo: 08/11/2019

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00 Aplicação Adicional: Não informado Saldo Mínimo: Não informado Resgate Mínimo: Não informado

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+1 du Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+6 du

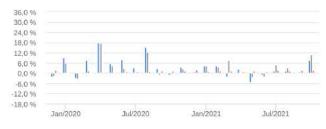
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	123,20	13,32	15,12	-	-	7,38	0,61	1,45	1,16	-1,15	-5,39	2,55	-2,14	4,42	4,30	0,18	3,60
% do S&P 500	119,47	40,19	39,17	-	-	67,59	83,79	43,35	24,69	50,61	204,22	-1.393,95	-28,99	121,84	102,46	16,18	155,68
INPC + 6% META ATUARIAL	30,25	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
S&P 500	103.12	33.14	38.59	114.24	159.51	10.92	0.73	3.34	4.72	-2.27	-2.64	-0.18	7.39	3.63	4.20	1.09	2.31

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	223,1989439	1.633.422,03	1.542.069,65	21,14%	-14,19%	10,04%	0,83	23,31%	4,42%	-5,39%	5
S&P 500	-	-	-	19,75%	-11,30%	9,38%	1,00	0,00%	7,39%	-2,64%	0

#### Gráficos

S&P 500 INPC + 6% META

#### Retorno Mensal - 11/11/2019 a 29/10/2021 (mensal)



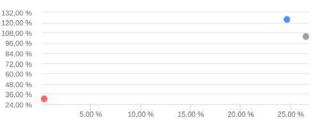
### Retorno Acumulado - 11/11/2019 a 29/10/2021 (diária)



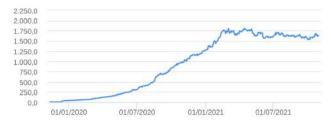
### Volatilidade Anualizada - 11/11/2019 a 29/10/2021 (diária)



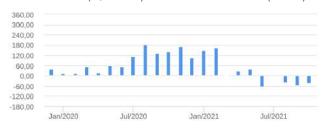
### Risco x Retorno - 11/11/2019 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 11/11/2019 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 11/11/2019 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

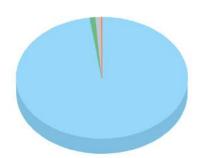
Retorno (%) / % do Benchmark - S&P 500



### :: MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES

EUNDO	% do PL	Mé	ês	Aı	Ano Desde o início			Desde	o início	06 meses	12 meses
FUNDO			Relativo	Nominal	Relativo	Nomina	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio
Cotas de Fundos (omitidas)	-	_	-	-	-	-	-	-	-	-	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	99,57%	99,97%	99,97%	99,97%	100,16%	99,83%	103,30%	100,05%
Valores a receber	1,09%	1,00%	0,63%	1,07%	1,16%	0,83%	0,80%	0,42%
Valores a pagar	0,65%	0,97%	0,60%	-1,04%	-1,33%	-0,65%	-4,15%	-0,47%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,06%	0,00%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	1.633.422,03	1.564.765,92	1.611.769,71	1.628.451,69	1.609.258,41	1.691.117,67	1.746.415,00	1.676.325,59
Data da Divulgação	04/11/2021	04/10/2021	02/09/2021	03/08/2021	06/07/2021	02/06/2021	04/05/2021	06/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)								jul/2021



Cotas de MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY MASTER	99,81 %
INVESTIMMENTO NO	
Outros Valores a receber	1,07 %
Outros Valores a pagar	-1,04 %
Cotas de BNP PARIBAS SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,16 %
Outras Disponibilidades	0,00 %



### :: SINGULARE FII - REIT11

CNPJ: 16.841.067/0001-99 | 29/10/2021

INFORMAÇÕES GERAIS

Ticker: REIT11 Local de Negociação: Bolsa B3 Data de Registro: 10/03/2014 Público Alvo: Investidores qualificados

Situação Atual: Em funcionamento normal

INSTITUIÇÕES

Administrador: Singulare Invest Gestão: Singulare Invest Gestor: Daniel Doll Lemos

Consultoria Especializada: REIT Soluções Financeiras Imobiliárias

Distribuidor: Singulare Invest

PERFIL DO FUNDO

Objetivo: Aquisição de Certificados de Recebíveis Imobiliários e participação direta em Sociedades de Propósito Específico, auferindo receitas por meio dos rendimentos dos ativos da carteira, obtendo retornos superiores à variação do IPCA acrescido de 7,5% ao ano.

da carteira, obtendo retornos superiores à variação do IPCA acrescido de 7,5% ao ano.

Política de Investimento: Investir em cotas de SPE, CRI, LH, LCI e cotas de outros FIIs, respeitando limites de concentração por emissor, modalidade, rating e outras restrições presentes no Regulamento. Pode aplicar ainda em outros ativos imobiliários e em ativos de renda fixa.

DADOS PATRIMONIAIS - OUTUBRO/2021

Cota Patrimonial: R\$ 514,95 Patrimônio Líquido: R\$ 13.538.463,95

Taxa de Administração Tipo: Flexível

Taxa de Administração Financeira: R\$ 15.000,00

Índice Performance: 100% do IPCA + 7,5% a.a.

Finalidade: Renda Regular de Títulos Mobiliários / Ganho de Capital

Taxa de Administração: 1,36%

Taxa de Performance: 20.00%

Classe de Ativos: Renda Fixa

Rentabilidade Alvo: IPCA 0.075

Localização do Imóvel: Não se aplica

Tipo Imóvel: Não se aplica

INVESTIMENTO

Quantidade de Cotas: 26.291

**TAXAS** 

### COTAÇÕES NA BMF&BOVESPA

Preço de Fechamento: -Volume Financeiro: -Número de Negócios: -

		202	21			20	20		2019				
Retorno (%)	REIT11	Excesso do IPCA	IPCA	IPCA	REIT11	Excesso do IPCA	IPCA	IPCA	REIT11	Excesso do IPCA	IPCA	IPCA	
Janeiro	23,17	22,92	0,25	0,25	2,10	1,89	0,21	0,21	12,50	12,18	0,32	0,32	
Fevereiro	-3,55	-4,41	0,86	0,86	-0,05	-0,30	0,25	0,25	0,00	-0,43	0,43	0,43	
Março	-10,94	-11,87	0,93	0,93	0,05	-0,02	0,07	0,07	-18,60	-19,35	0,75	0,75	
Abril	18,00	17,69	0,31	0,31	0,93	1,24	-0,31	-0,31	5,01	4,44	0,57	0,57	
Maio	-6,72	-7,55	0,83	0,83	0,00	0,38	-0,38	-0,38	19,88	19,75	0,13	0,13	
Junho	2,70	2,17	0,53	0,53	4,17	3,91	0,26	0,26	-15,32	-15,33	0,01	0,01	
Julho	15,64	14,68	0,96	0,96	0,11	-0,25	0,36	0,36	20,48	20,29	0,19	0,19	
Agosto	0,00	-0,87	0,87	0,87	-19,67	-19,91	0,24	0,24	13,95	13,84	0,11	0,11	
Setembro	11,11	9,95	1,16	1,16	25,00	24,36	0,64	0,64	-0,68	-0,64	-0,04	-0,04	
Outubro	52,76	51,51	1,25	1,25	13,58	12,72	0,86	0,86	-7,35	-7,45	0,10	0,10	
Novembro	-	-	-	-	-3,85	-4,74	0,89	0,89	0,00	-0,51	0,51	0,51	
Dezembro	-	-	-	-	-8,00	-9,35	1,35	1,35	1,45	0,30	1,15	1,15	
				Excesso do		EVOL	LICÃO NOST	II TIMOC 24 MI	-0-0				

Retorno Acumulado (%)	REIT11	Excesso do IPCA	IPCA	IPCA
Desde o início	430,93	378,28	52,66	52,66
No mês	52,76	51,51	1,25	1,25
No ano	134,75	126,52	8,24	8,24
03 meses	69,74	66,42	3,32	3,32
06 meses	103,42	97,73	5,69	5,69
12 meses	99,98	89,21	10,76	10,76
18 meses	146,99	134,13	12,86	12,86
24 meses	158,21	143,18	15,03	15,03
36 meses	218,43	200,41	18,02	18,02



As informações foram obtidas a partir de fontes públicas ou privadas consideradas confiáveis, cuja responsabilidade pela correção e veracidade não é assumida pela QUANTUM, pelo titular desta marca ou por qualquer das empresas de seu grupo empresarial. As informações disponíveis não devem ser entendidas como colocação, distribuição ou oferta de fundo de investimento ou qualquer outro valor mobiliário. Rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura. Ao investidor é recomendada a leitura cuidadosa do prospecto e regulamento do fundo ao aplicar seus recursos. Para avaliação da performance de um fundo, é recomendável a análise de, no mínimo, 12 (doze) meses. Os valores exibidos estão em Real (BRL).

Fonte: Quantum Axis.



### :: SINGULARE FII - REIT11

CND I:	16 8/11	067/0001-99	1 20/10/2021

Últimos Proventos	Valor	Data Ex-1	Data Deliberação	Data Crédito	Ano do Exercício
Dividendo	R\$ 21,58114221596	30/09/2021	30/09/2021	15/10/2021	-
Amortização	R\$ 441,63974515994	30/09/2021	30/09/2021	15/10/2021	-
Dividendo	R\$ 17,84327906888	30/06/2021	30/06/2021	15/07/2021	-
Amortização	R\$ 343,88813890685	30/06/2021	30/06/2021	15/07/2021	-
Dividendo	R\$ 24,53159750484	31/03/2021	31/03/2021	15/04/2021	-
Amortização	R\$ 80,217506371	31/03/2021	31/03/2021	15/04/2021	-

### :: SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES

29/10/2021

CNPJ: 11.458.144/0001-02
Gestão: SulAmérica Investimentos
Administrador: BEM DTVM

Taxa de Administração: 1,50%

Características

Taxa de Administração (Máxima): 1,50% Classificação Anbima: Ações Valor/Crescimento

Código de Referência: 255173 Início do Fundo: 25/08/2010 Aplicação Mínima: R\$ 2.500,00 Aplicação Adicional: R\$ 2.500,00 Saldo Mínimo: R\$ 2.500.00

Resgate Mínimo: R\$ 2.500,00

Informações Operacionais

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+3 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	52,92	-19,54	-3,94	-21,63	9,75	-11,57	-7,31	-3,82	-3,32	1,40	6,62	2,02	2,52	-3,49	-3,26	7,70	12,93
% do Ibovespa	88,62	149,92	-46,20	601,14	42,22	171,67	111,30	154,15	84,26	300,79	107,46	103,99	41,99	79,80	98,10	82,78	81,33
INPC + 6% META ATUARIAL	273,01	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
Ibovespa	59,72	-13,04	8,53	-3,60	23,09	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16	1,94	6,00	-4,37	-3,32	9,30	15,90

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	15,2920198	479.100,36	833.606,40	20,15%	-25,06%	9,57%	0,98	5,13%	12,93%	-7,31%	6
Ibovespa	-	-	-	21,03%	-20,86%	9,99%	1,00	0,00%	15,90%	-6,57%	0

#### Gráficos

■ Fundo ■ Ibovespa

INPC + 6% META ATUARIAL

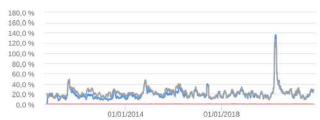
#### Retorno Mensal - 26/08/2010 a 29/10/2021 (mensal)



# ATUARIAL



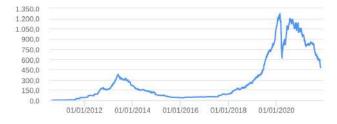
### Volatilidade Anualizada - 26/08/2010 a 29/10/2021 (diária)



# Risco x Retorno - 26/08/2010 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 26/08/2010 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 26/08/2010 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira



### **::** SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES

29/10/2021

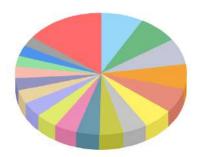
Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)											
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21			
Ações	90,32%	91,36%	93,19%	93,20%	94,73%	94,01%	93,24%	95,38%			
Certificado ou recibo de depósito de valores mobiliários	5,59%	6,74%	4,64%	3,99%	2,45%	3,42%	3,30%	2,16%			
Operações Compromissadas	4,10%	2,15%	2,25%	2,57%	3,28%	2,58%	3,02%	2,56%			
Valores a receber	0,45%	0,23%	0,57%	0,48%	0,35%	0,34%	0,75%	0,80%			
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%			
Valores a pagar	-0,46%	-0,48%	-0,65%	-0,24%	-0,81%	-0,35%	-0,31%	-0,90%			
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	479.100,36	592.996,75	660.464,36	733.421,37	827.422,01	832.180,54	810.281,22	810.805,35			
Data da Divulgação	08/11/2021	11/10/2021	08/09/2021	12/08/2021	09/07/2021	09/06/2021	06/05/2021	08/04/2021			

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2021



PETROBRAS ON - PETR3	8,08 %
■ BRADESCO PN N1 - BBDC4	7,53 %
BLAU ON NM - BLAU3	7,00 %
VALE ON N1 - VALE3	6,64 %
JBS ON NM - JBSS3	6,57 %
BTGP BANCO UNT - BPAC11	5,59 %
■ PETRORIO ON NM - PRIO3	4,66 %
VAMOS ON NM - VAMO3	4,49 %
■ ELETROBRAS PNB N1 - ELET6	4,43 %
QUERO-QUERO ON NM - LJQQ3	4,25 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	4,10 %
3R PETROLEUMON NM - RRRP3	4,04 %
CAIXA SEGURION NM - CXSE3	3,62 %
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	3,31 %
HAPVIDA ON NM - HAPV3	3,08 %
VIVEO ON NM - VVEO3	2,85 %
■ GRUPO NATURAON NM - NTCO3	2,85 %
■ WEG ON NM - WEGE3	2,76 %
Lançamentos positivos menores que 2,76%	14,60 %

29/10/2021



### :: SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP

#### Características

CNPJ: 09.326.708/0001-01
Gestão: SulAmérica Investimentos
Administrador: BEM DTVM
Taxa de Administração: 0,40%
Taxa de Administração (Máxima): 0,40%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Alta Soberano

Código de Referência: 212873 Início do Fundo: 11/07/2008

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 2.500,00 Saldo Mínimo: R\$ 2.500,00 Resgate Mínimo: R\$ 2.500,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+2 du

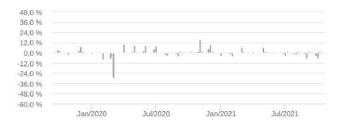
Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	353,48	-7,93	-1,98	-2,57	22,43	-3,41	-1,25	-1,75	-1,40	0,47	0,98	0,91	-0,58	-1,31	-0,81	4,58	1,84
% do Ibovespa	490,42	60,81	-23,22	71,37	97,12	50,64	19,01	70,74	35,42	100,69	15,98	47,04	-9,62	30,00	24,28	49,31	11,54
INPC + 6% META ATUARIAL	362,40	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
Ibovespa	72,08	-13,04	8,53	-3,60	23,09	-6,74	-6,57	-2,48	-3,94	0,46	6,16	1,94	6,00	-4,37	-3,32	9,30	15,90

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	45,3476339	691.950,81	1.152.248,36	6,46%	-9,83%	3,07%	0,21	19,25%	4,58%	-1,75%	7
Ibovespa	-	-	-	21,03%	-20,86%	9,99%	1,00	0,00%	15,90%	-6,57%	0

#### Gráficos

### ■Fundo ■ Ibovespa ■

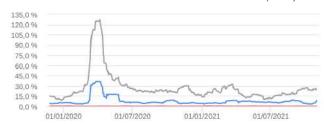
### INPC + 6% META



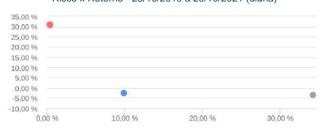
Retorno Mensal - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



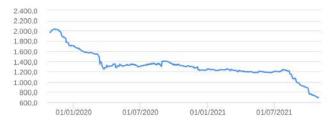
# Volatilidade Anualizada - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



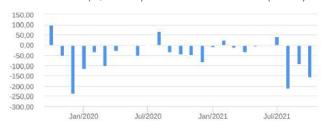
Risco x Retorno - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/10/2019 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 01/10/2019 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira

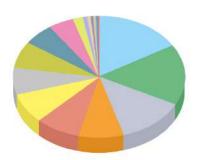


### :: SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do	PL)							
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Títulos Públicos	87,23%	89,73%	95,11%	99,55%	98,45%	100,02%	87,56%	83,59%
Operações Compromissadas	13,03%	10,43%	5,05%	0,78%	1,84%	0,40%	12,70%	16,68%
Mercado Futuro - Posições compradas	0,73%	-0,00%	-0,17%	-0,79%	-0,35%	-0,17%	-0,19%	0,09%
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,32%	-0,16%	-0,17%	-0,12%	-0,15%	-0,31%	-0,13%	-0,24%
Mercado Futuro - Posições vendidas	-0,67%	0,00%	0,18%	0,58%	0,21%	0,06%	0,05%	-0,11%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	691.950,81	880.858,52	988.162,49	1.224.224,84	1.199.981,98	1.195.025,82	1.191.947,48	1.216.367,3
Data da Divulgação	08/11/2021	11/10/2021	08/09/2021	12/08/2021	09/07/2021	09/06/2021	06/05/2021	08/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%)							,	out/2021



NTN-B - Venc.: 15/08/2050 (BRSTNCNTB3D4)	16,74 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2024 (BRSTNCNTB096)	16,52 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	13,03 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2055 (BRSTNCNTB4Q4)	8,66 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2030 (BRSTNCNTB3B8)	8,63 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2023 (BRSTNCNTB4O9)	8,18 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2025 (BRSTNCNTB633)	7,28 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2026 (BRSTNCNTB4U6)	7,26 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2040 (BRSTNCNTB3C6)	5,90 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2028 (BRSTNCNTB4X0)	4,83 %
NTN-B - Venc.: 15/05/2045 (BRSTNCNTB0A6)	1,95 %
LFT - Venc.: 01/09/2025 (BRSTNCLF1RD2)	0,83 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	0,67 %
■ LFT - Venc.: 01/03/2024 (BRSTNCLF1RA8)	0,47 %
Outros Valores a pagar	-0,32 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF25	-0,29 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF24	-0,21 %
■ Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF23	-0,16 %
Lançamentos positivos menores que 0,47%	0,06 %



### :: SULAMÉRICA JURO REAL CURTO FI RENDA FIXA LP

# CNPJ: 16.892.116/0001-12 Gestão: SulAmérica Investimentos Administrador: BEM DTVM Taxa de Administração: 0,25%

Características

Taxa de Administração (Máxima): 0,25%

Classificação Anbima: Renda Fixa Duração Livre Soberano

Código de Referência: 329355 Início do Fundo: 27/02/2013

#### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 5.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 2.500,00 Saldo Mínimo: R\$ 2.500,00 Resgate Mínimo: R\$ 2.500,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+0 Conversão da Cota para Resgate: D+1 du

Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+2 du

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	105,20	-2,55	0,40	5,22	21,58	-2,04	0,41	-0,52	-0,54	-0,18	0,51	1,22	-0,34	-0,90	-0,15	1,66	1,76
% do IMA-B 5	78,02	-208,95	9,09	49,01	82,78	165,50	40,76	-340,81	-1.879,40	141,42	73,90	139,21	-99,25	150,94	-144,60	90,91	133,63
INPC + 6% META ATUARIAL	173,78	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IMA-B 5	134,83	1,22	4,37	10,65	26,07	-1,24	1,00	0,15	0,03	-0,13	0,69	0,87	0,34	-0,60	0,11	1,83	1,32

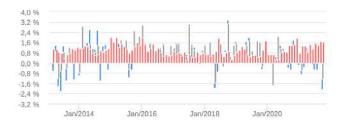
Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	20,5202176	199.895,87	218.790,83	4,43%	-3,95%	2,11%	1,34	2,49%	1,76%	-0,90%	2
IMA-B 5	-	-	-	2,68%	-2,28%	1,27%	1,00	0,00%	1,83%	-0,60%	0

#### Gráficos

### ■ Fundo ■ IMA-B 5

#### INPC + 6% META

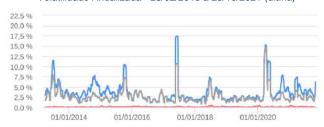
# Retorno Acumulado - 28/02/2013 a 29/10/2021 (diária)



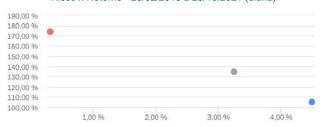
Retorno Mensal - 28/02/2013 a 29/10/2021 (mensal)



# Volatilidade Anualizada - 28/02/2013 a 29/10/2021 (diária)







# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 28/02/2013 a 29/10/2021 (diária)



# Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 28/02/2013 a 29/10/2021 (mensal)



### Composição da Carteira

### out/2021

# Performance dos Fundos em Carteira



#### :: SULAMÉRICA JURO REAL CURTO FI RENDA FIXA LP

29/10/2021

Fundo	% do PL	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio

#### Não há fundos(FI) na carteira

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)													
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21					
Títulos Públicos	98,63%	99,74%	99,92%	97,40%	98,23%	99,54%	93,29%	93,95%					
Operações Compromissadas	1,93%	0,66%	0,20%	2,76%	3,32%	0,77%	9,70%	6,20%					
Mercado Futuro - Posições compradas	1,24%	-0,12%	-0,16%	-1,81%	-0,36%	-0,31%	-0,13%	0,15%					
Opções - Posições titulares	0,00%	0,00%	0,03%	-	-	-	-	-					
Valores a receber	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%					
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%					
Opções - Posições lançadas	-0,00%	-0,00%	-0,01%	-	-	-	-	-					
Valores a pagar	-0,74%	-0,36%	-0,14%	-0,05%	-1,51%	-0,19%	-2,91%	-0,14%					
Mercado Futuro - Posições vendidas	-1,05%	0,09%	0,16%	1,69%	0,31%	0,19%	0,05%	-0,16%					
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	199.895,87	204.947,04	226.466,74	236.756,54	216.686,09	192.306,26	179.261,32	176.278,73					
Data da Divulgação	08/11/2021	11/10/2021	08/09/2021	12/08/2021	09/07/2021	09/06/2021	07/05/2021	08/04/2021					

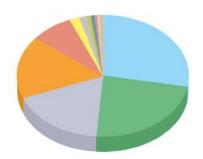


### :: SULAMÉRICA JURO REAL CURTO FI RENDA FIXA LP

29/10/2021

Composição da Carteira Individual - Ativos (%)

out/2021



NTN-B - Venc.: 15/05/2023	29,00 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2024	24,15 %
■ NTN-B - Venc.: 15/05/2025	18,41 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2022	17,29 %
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	8,24 %
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc.: 01/01/2025	1,93 %
■ NTN-B - Venc.: 15/08/2040	1,53 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN23	0,76 %
Outros Valores a pagar	-0,74 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF24	-0,57 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF25	0,45 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF27	-0,25 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTF23	-0,16 %
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN22	-0,07 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTN24	0,02 %
Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTJ22	0,00 %
Outros Valores a receber	0,00 %
■ Mercado Futuro - Posições compradas - DI1FUTF22	0,00 %
Lançamentos positivos menores que 0,00%	0,00 %
Lançamentos negativos maiores que -0,07%	0,00 %

### **::** SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES

29/10/2021

### Características

CNPJ: 34.525.068/0001-06
Gestão: SulAmérica Investimentos
Administrador: BEM DTVM
Taxa de Administração: 2,00%
Taxa de Administração (Máxima): 2,90%
Classificação Anbima: Ações Livre

Código de Referência: 520470

Início do Fundo: 30/12/2019

### Informações Operacionais

Aplicação Mínima: R\$ 1.000,00 Aplicação Adicional: R\$ 1.000,00 Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00 Resgate Mínimo: R\$ 1.000,00

Conversão da Cota para Aplicação: D+1 du Conversão da Cota para Resgate: D+30 Disponibilização dos Recursos Resgatados: D+32

Retorno (%)	Início	Ano	12 meses	24 meses	36 meses	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21	fev/21	jan/21	dez/20	nov/20
Fundo	-4,61	-6,09	19,24	-	-	-14,48	-2,11	-8,19	-2,76	4,31	3,89	9,25	1,69	3,05	1,28	14,42	12,27
% do IVBX-2	31,14	49,89	483,49	-	-	172,92	47,41	280,80	82,21	-395,00	106,97	336,07	33,38	-184,85	-71,58	195,06	102,08
INPC + 6% META ATUARIAL	27,27	13,79	17,84	30,77	42,25	1,63	1,69	1,39	1,54	1,09	1,45	0,85	1,40	1,24	0,73	1,98	1,42
IVBX-2	-14,81	-12,20	3,98	-3,53	35,82	-8,37	-4,44	-2,92	-3,36	-1,09	3,64	2,75	5,06	-1,65	-1,79	7,39	12,02

Risco x Retorno (12 meses)	Cota	PL (R\$ mil)	PL Médio (R\$ mil)	Volatilidade	Perda Máxima	VaR	Beta	Tracking Error	Retorno Máximo	Retorno Mínimo	Vezes Acima do Benchmark
Fundo	9,5386995	326.402,96	199.822,73	21,46%	-26,35%	10,19%	0,97	12,73%	14,42%	-8,19%	9
IVBX-2	-	-	-	20,14%	-21,14%	9,56%	1,00	0,00%	12,02%	-4,44%	0

#### Gráficos

Fundo III IVBX-2

INPC + 6% META

#### Retorno Acumulado - 31/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



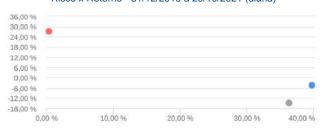
Retorno Mensal - 31/12/2019 a 29/10/2021 (mensal)



# Volatilidade Anualizada - 31/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



Risco x Retorno - 31/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



# Patrimônio Líquido (R\$ Milhões) - 31/12/2019 a 29/10/2021 (diária)



Fluxo Mensal (R\$ Milhões) - 31/12/2019 a 29/10/2021 (mensal)



Composição da Carteira

out/2021

Performance dos Fundos em Carteira

Retorno (%) / % do Benchmark - IVBX-2



### **::** SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES

FUNDO	% do PL	М	Mês		Ano		Desde o início		o início	06 meses	12 meses	
РОИНО		Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Nominal	Relativo	Volatilidade	PL Médio	
SULAMÉRICA SELECTION MASTER I FI AÇÕES	99,83	-14,40	171,95	-0,51	4,19	32,18	2.686,11	32,18	2.686,11	23,36	R\$ 199.917.653,2	

Composição da Carteira por Tipo de Aplicação (% do PL)								
Tipo de Aplicação	out/21	set/21	ago/21	jul/21	jun/21	mai/21	abr/21	mar/21
Cotas de Fundos	99,83%	99,90%	99,86%	99,83%	102,39%	101,22%	101,26%	98,57%
Operações Compromissadas	0,35%	0,35%	0,34%	0,35%	0,35%	0,39%	0,47%	1,70%
Valores a receber	0,02%	0,01%	0,16%	0,16%	0,13%	0,02%	0,01%	0,38%
Disponibilidades	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Valores a pagar	-0,20%	-0,26%	-0,36%	-0,34%	-2,87%	-1,62%	-1,73%	-0,64%
Patrimônio Líquido (R\$ mil)	326.402,96	381.744,81	358.422,46	320.986,20	307.868,73	287.534,97	239.900,07	66.071,47
Data da Divulgação	08/11/2021	11/10/2021	06/09/2021	12/08/2021	09/07/2021	09/06/2021	06/05/2021	08/04/2021
Composição da Carteira Individual - Ativos (%) out/2021								



Cotas de SULAMÉRICA SELECTION MASTER I FI AÇÕES	99,83 %
Operações Compromissadas - LTN - Venc.: 01/01/2025	0,35 %
Outros Valores a pagar	-0,20 %
Outros Valores a receber	0,02 %
Outras Disponibilidados	0.00.9/