

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2021

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.119.555,58	5,81%	578	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.134.820,05	7,24%	1.014	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.141.751,80	3,02%	770	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.939.027,30	4,14%	650	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.749.058,96	2,47%	1.140	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.786.300,91	5,34%	964	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.788.469,34	8,16%	1.057	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.502.192,83	4,94%	1.013	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	96.979,05	0,14%	1.264	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.334.128,33	1,88%	294	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	407.966,85	0,58%	361	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... P	D+3	Não há	8.147.638,13	11,49%	587	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	731.080,49	1,03%	800	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.632.921,85	2,30%	81	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.820,95	0,06%	500	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	608,51	0,00%	16.102	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.218.310,68	3,13%	249	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.712.266,26	3,82%	2.466	0,24%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	896.597,03	1,26%	906	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	3.886.992,30	5,48%	45.479	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento	
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.394.679,53	1,97%	2.705	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.901.689,00	2,68%	27.215	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.434.400,21	2,02%	18.349	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	942.378,96	1,33%	1.367	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	377.349,53	0,53%	2.256	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	246.251,16	0,35%	6.097	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	290.319,26	0,41%	53	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.146.657,64	3,03%	111	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	5.037.836,24	7,10%	108	3,90%	Artigo 8º, Inciso III	
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	2.030.719,22	2,86%	84	0,17%	Artigo 9º, Inciso II	
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.857.898,63	5,44%	24.127	0,33%	Artigo 9º, Inciso III	
Total para cálculo dos limites da Resolução			70.926.666,58					



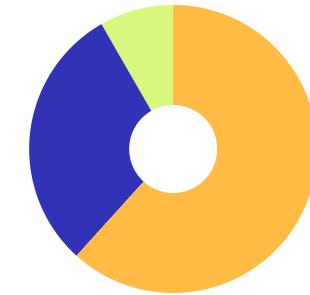
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	31.000.251,00	43,71%	11,51%	57,54%	80,00%	25.741.082,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	14.185.333,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	12.770.380,61	18,01%	4,06%	15,32%	40,00%	15.600.286,02
Total Renda Fixa	100,00%	43.770.631,61	61,71%	15,57%	77,86%	140,00%	



- █ RENDA FIXA 43.770.631,61
- █ RENDA VARIÁVEL 21.267.417,12
- █ EXTERIOR 5.888.617,85



**CRÉDITO
& MERCADO**

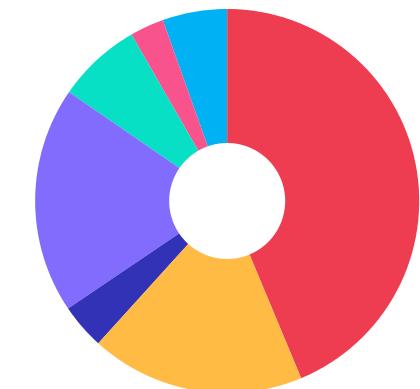
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2021)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	2.712.266,26	3,82%	0,00%	2,00%	5,00%	834.067,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	13.517.314,62	19,06%	3,69%	16,45%	20,00%	668.018,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.037.836,24	7,10%	3,07%	3,07%	10,00%	2.054.830,42
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	21.267.417,12	29,99%	6,76%	21,52%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.030.719,22	2,86%	0,00%	0,31%	5,00%	1.515.614,11
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.857.898,63	5,44%	0,00%	0,31%	5,00%	-311.565,30
Total Exterior	10,00%	5.888.617,85	8,30%	0,00%	0,62%	10,00%	



■ 7º I b	■ 7º IV a	■ 8º I a	■ 8º II a
■ 8º III	■ 9º II	■ 9º III	



Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	49.748.932,58	70,14	0,00
CAIXA DTVM	15.580.067,46	21,97	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.218.310,68	3,13	-
ITAÚ UNIBANCO	2.146.657,64	3,03	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	942.378,96	1,33	0,00
ITAÚ DTVM	290.319,26	0,41	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	11,51	71,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	12,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	4,06	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	18,45	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,07	10,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,10%	3,07%	1,18%	3,12%	6,21%	14,71%	-	-
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,73%	-5,87%	-2,65%	-1,15%	-3,14%	4,23%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,40%	1,78%	0,96%	1,65%	2,49%	7,15%	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	1,00%	2,48%	1,18%	2,64%	5,95%	13,62%	-	-
IMA-B (Benchmark)	-0,13%	-2,30%	-1,59%	0,52%	4,71%	6,92%	-	-
IRF-M (Benchmark)	-0,33%	-2,95%	-1,39%	-0,15%	-1,02%	5,48%	-	-
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
IPCA (Benchmark)	1,16%	6,90%	3,02%	4,75%	10,25%	13,70%	-	-



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,44%	2,51%	1,22%	2,01%	2,99%	6,65%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-6,57%	-6,75%	-12,48%	-4,85%	17,31%	5,95%	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-4,76%	14,68%	0,23%	8,42%	28,09%	44,71%	-	-
SMALL (Benchmark)	-6,43%	-5,54%	-15,22%	-4,70%	15,75%	13,69%	-	-



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	1,22%	16,99%	8,36%	2,09%	22,47%	80,14%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-0,35%	19,63%	11,29%	2,95%	29,53%	110,87%	6,19%	0,12%

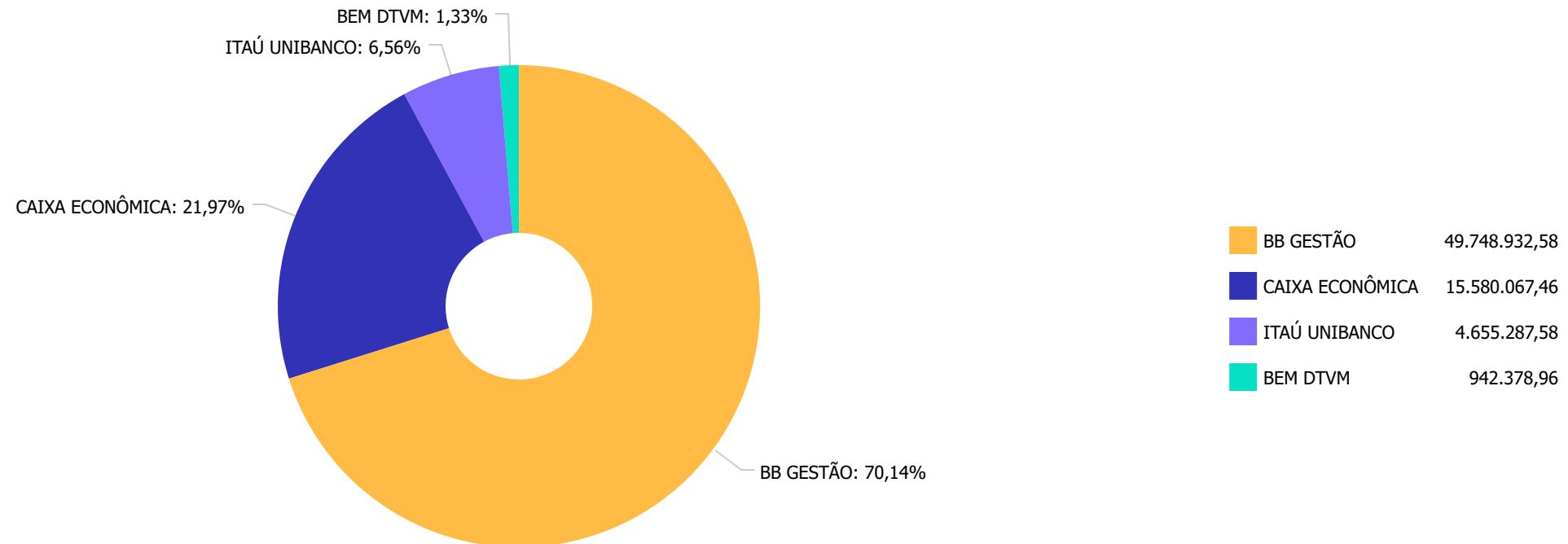


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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



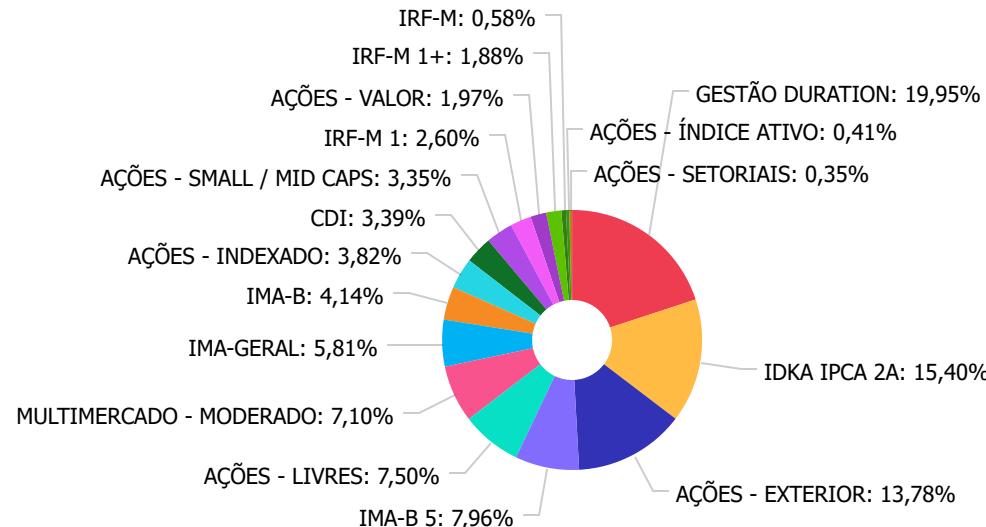


**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021



■ GESTÃO DURATION	14.152.249,72	■ IDKA IPCA 2A	10.923.289,39	■ AÇÕES - EXTERIOR	9.775.610,15	■ IMA-B 5	5.643.944,63
■ AÇÕES - LIVRES	5.322.293,20	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.037.836,24	■ IMA-GERAL	4.119.555,58	■ IMA-B	2.939.027,30
■ AÇÕES - INDEXADO	2.712.266,26	■ CDI	2.404.431,80	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.376.779,17	■ IRF-M 1	1.846.038,01
■ AÇÕES - VALOR	1.394.679,53	■ IRF-M 1+	1.334.128,33	■ IRF-M	407.966,85	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	290.319,26
■ AÇÕES - SETORIAIS	246.251,16						



**CRÉDITO
& MERCADO**

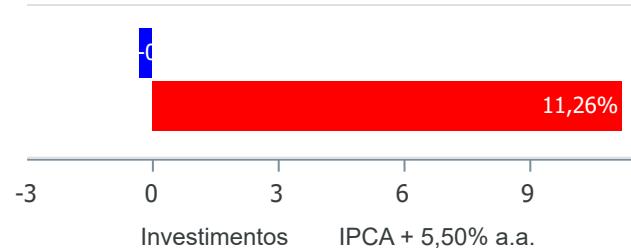
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	65.284.156,71	4.508.303,54	4.502.762,47	64.830.574,04	-459.123,74	-459.123,74	-0,70%	-0,70%	0,68%	0,68%	-103,89%	3,67%
Fevereiro	64.830.574,04	13.889.226,83	11.139.647,04	66.880.119,02	-700.034,81	-1.159.158,55	-1,04%	-1,73%	1,25%	1,93%	-89,65%	3,15%
Março	66.880.119,02	9.090.264,54	5.995.227,25	70.495.609,08	520.452,77	-638.705,78	0,74%	-1,00%	1,42%	3,38%	-29,58%	4,01%
Abril	70.495.609,08	28.778.579,24	29.277.687,84	70.710.425,55	713.925,07	75.219,29	1,01%	0,00%	0,74%	4,15%	0,04%	2,73%
Maio	70.710.425,55	4.261.616,03	3.279.948,15	72.687.789,28	995.695,85	1.070.915,14	1,39%	1,39%	1,28%	5,48%	25,38%	2,94%
Junho	72.687.789,28	3.816.529,05	4.583.730,26	71.938.545,58	17.957,51	1.088.872,65	0,02%	1,42%	0,98%	6,51%	21,74%	2,49%
Julho	71.938.545,58	10.607.749,50	10.057.890,63	72.283.602,69	-204.801,76	884.070,89	-0,28%	1,13%	1,43%	8,04%	14,04%	3,14%
Agosto	72.283.602,69	11.669.928,52	11.057.752,97	72.610.605,74	-285.172,50	598.898,39	-0,39%	0,73%	1,34%	9,49%	7,73%	3,26%
Setembro	72.610.605,74	1.665.520,73	2.598.345,23	70.926.666,58	-751.114,66	-152.216,27	-1,03%	-0,31%	1,61%	11,26%	-2,74%	3,70%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

ANO

36M

Evolução do Patrimônio



Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
 IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
 IMA-B 5

IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
 Ibovespa IBX SMLL IDIV



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.726.717,33	0,00	0,00	5.788.469,34	61.752,01	1,08%	1,08%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.082.297,23	0,00	0,00	5.134.820,05	52.522,82	1,03%	1,03%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.468.167,85	0,00	0,00	3.502.192,83	34.024,98	0,98%	0,98%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.121.017,06	0,00	0,00	2.141.751,80	20.734,74	0,98%	0,98%	0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.199.899,22	0,00	0,00	2.218.310,68	18.411,46	0,84%	0,84%	0,54%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.625.342,29	0,00	0,00	1.632.921,85	7.579,56	0,47%	0,47%	0,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.650,09	0,00	0,00	39.820,95	170,86	0,43%	0,43%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.742.675,25	0,00	0,00	1.749.058,96	6.383,71	0,37%	0,37%	0,30%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.772.908,83	0,00	0,00	3.786.300,91	13.392,08	0,35%	0,35%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	57.382,87	39.282,77	0,00	96.979,05	313,41	0,32%	0,38%	0,29%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	606,93	0,00	0,00	608,51	1,58	0,26%	0,26%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.759.902,92	1.563.488,71	2.598.345,23	731.080,49	6.034,09	0,18%	0,35%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.138.912,03	0,00	0,00	8.147.638,13	8.726,10	0,11%	0,11%	0,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.119.774,43	0,00	0,00	4.119.555,58	-218,85	-0,01%	-0,01%	0,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.943.547,22	0,00	0,00	2.939.027,30	-4.519,92	-0,15%	-0,15%	2,18%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	409.478,34	0,00	0,00	407.966,85	-1.511,49	-0,37%	-0,37%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.344.609,65	0,00	0,00	1.334.128,33	-10.481,32	-0,78%	-0,78%	2,06%
Total Renda Fixa	44.552.889,54	1.602.771,48	2.598.345,23	43.770.631,61	213.315,82	0,48%		0,80%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	250.980,76	0,00	0,00	246.251,16	-4.729,60	-1,88%	-1,88%	11,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.430.757,81	0,00	0,00	1.394.679,53	-36.078,28	-2,52%	-2,52%	12,52%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	980.689,79	0,00	0,00	942.378,96	-38.310,83	-3,91%	-3,91%	12,89%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.980.555,07	0,00	0,00	1.901.689,00	-78.866,07	-3,98%	-3,98%	11,83%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	4.082.219,35	0,00	0,00	3.886.992,30	-195.227,05	-4,78%	-4,78%	5,97%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	399.413,52	0,00	0,00	377.349,53	-22.063,99	-5,52%	-5,52%	10,75%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	310.846,17	0,00	0,00	290.319,26	-20.526,91	-6,60%	-6,60%	11,68%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.908.641,88	0,00	0,00	2.712.266,26	-196.375,62	-6,75%	-6,75%	12,21%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.542.950,95	0,00	0,00	1.434.400,21	-108.550,74	-7,04%	-7,04%	13,24%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	964.622,64	0,00	0,00	896.597,03	-68.025,61	-7,05%	-7,05%	12,29%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.335.763,06	0,00	0,00	2.146.657,64	-189.105,42	-8,10%	-8,10%	12,57%
Total Renda Variável	17.187.441,00	0,00	0,00	16.229.580,88	-957.860,12	-5,57%		10,82%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.771.943,45	62.749,25	0,00	3.857.898,63	23.205,93	0,61%	0,62%	6,92%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO...	2.024.668,44	0,00	0,00	2.030.719,22	6.050,78	0,30%	0,30%	6,19%
Total Exterior	5.796.611,89	62.749,25	0,00	5.888.617,85	29.256,71	0,50%		6,67%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2021

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.398.029,65	0,00	678.907,74	5.788.469,34	69.347,43	1,08%	1,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.069.012,55	0,00	0,00	5.134.820,05	65.807,50	1,30%	1,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.463.050,86	0,00	0,00	3.502.192,83	39.141,97	1,13%	1,13%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.112.447,02	0,00	3.000.000,00	2.141.751,80	29.304,78	0,57%	1,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.189.763,30	0,00	0,00	2.218.310,68	28.547,38	1,30%	1,30%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.611.111,52	0,00	0,00	1.632.921,85	21.810,33	1,35%	1,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.027.739,76	2.404.003,15	2.700.000,00	1.749.058,96	17.316,05	0,39%	0,87%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.940.877,66	8.832.357,43	10.058.118,80	731.080,49	15.964,20	0,15%	0,90%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.341,79	0,00	0,00	39.820,95	479,16	1,22%	1,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	131.626,64	35.002,12	96.979,05	354,53	0,27%	0,89%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	604,39	0,00	0,00	608,51	4,12	0,68%	0,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	414.029,45	0,00	0,00	407.966,85	-6.062,60	-1,46%	-1,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.132.275,39	1.000.000,00	3.000.000,00	4.119.555,58	-12.719,81	-0,18%	-0,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.434.790,52	0,00	61.959,53	1.334.128,33	-38.702,66	-2,70%	-2,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.019.465,34	6.517.926,08	1.350.000,00	8.147.638,13	-39.753,29	-0,42%	-0,46%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	3.000.000,00	0,00	2.939.027,30	-60.972,70	-2,03%	-1,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.693.029,95	0,00	1.830.000,64	3.786.300,91	-76.728,40	-1,35%	-1,87%
Total Renda Fixa	44.545.569,15	21.885.913,30	22.713.988,83	43.770.631,61	53.137,99	0,08%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	263.604,28	0,00	0,00	246.251,16	-17.353,12	-6,58%	-6,58%
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	336.184,63	0,00	0,00	290.319,26	-45.865,37	-13,64%	-13,64%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	2.583.232,14	1.350.000,00	0,00	3.886.992,30	-46.239,84	-1,18%	0,67%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	431.603,86	0,00	0,00	377.349,53	-54.254,33	-12,57%	-12,57%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.096.719,63	0,00	0,00	5.037.836,24	-58.883,39	-1,16%	-1,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.440.549,80	50.000,00	0,00	1.394.679,53	-95.870,27	-6,43%	-6,51%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.044.206,12	0,00	0,00	942.378,96	-101.827,16	-9,75%	-9,75%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	2.002.168,74	51.547,85	1.000.000,00	896.597,03	-157.119,56	-7,65%	-14,12%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.080.050,95	0,00	0,00	1.901.689,00	-178.361,95	-8,57%	-8,57%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.737.891,66	0,00	0,00	1.434.400,21	-303.491,45	-17,46%	-17,46%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.451.863,40	0,00	0,00	2.146.657,64	-305.205,76	-12,45%	-12,45%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	3.134.442,93	0,00	0,00	2.712.266,26	-422.176,67	-13,47%	-13,47%
Total Renda Variável	22.602.518,14	1.451.547,85	1.000.000,00	21.267.417,12	-1.786.648,87	-7,75%	



Disclaimer

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

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

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

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

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

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

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria 1.467, de 02 de junho de 2022. e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

