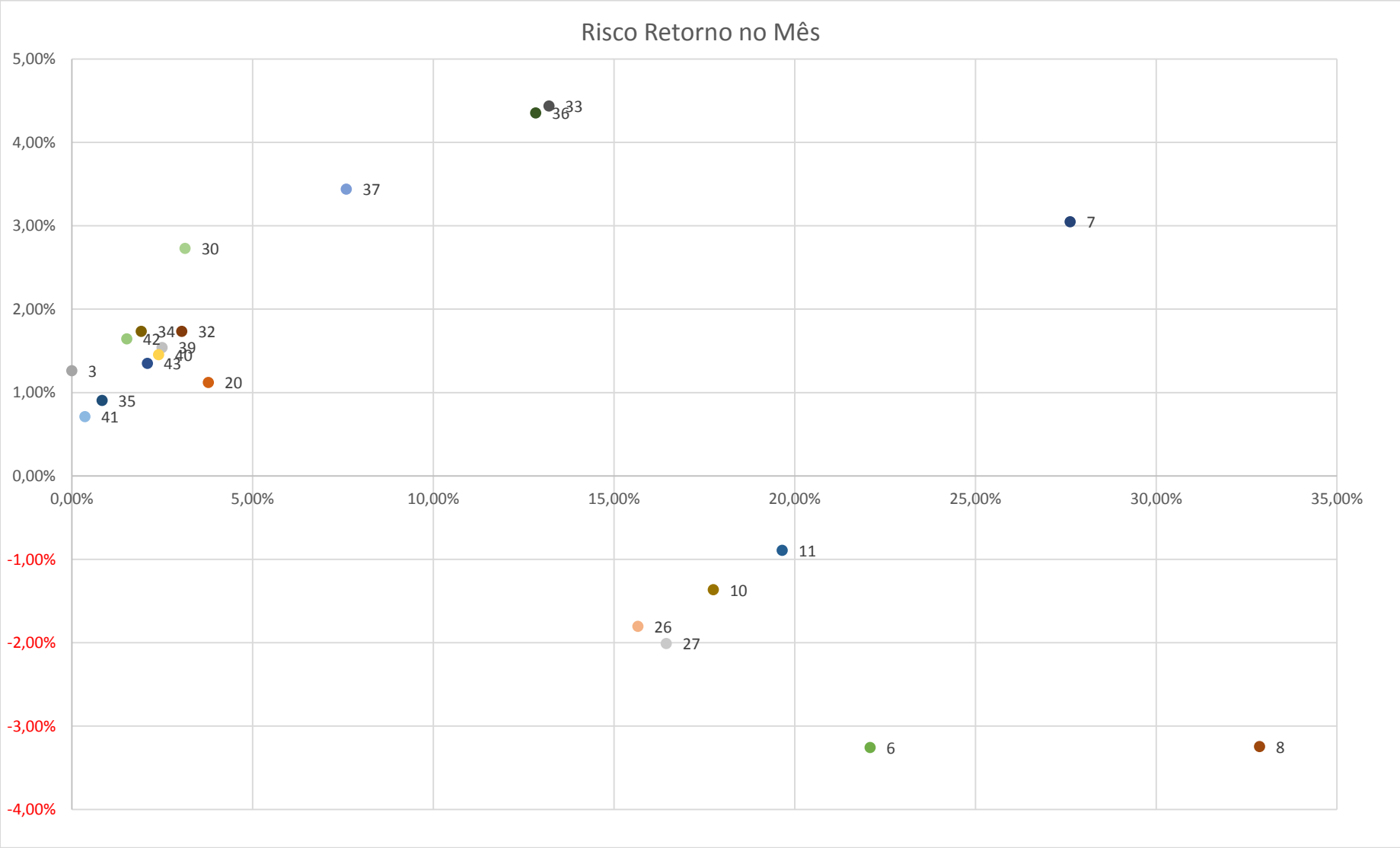
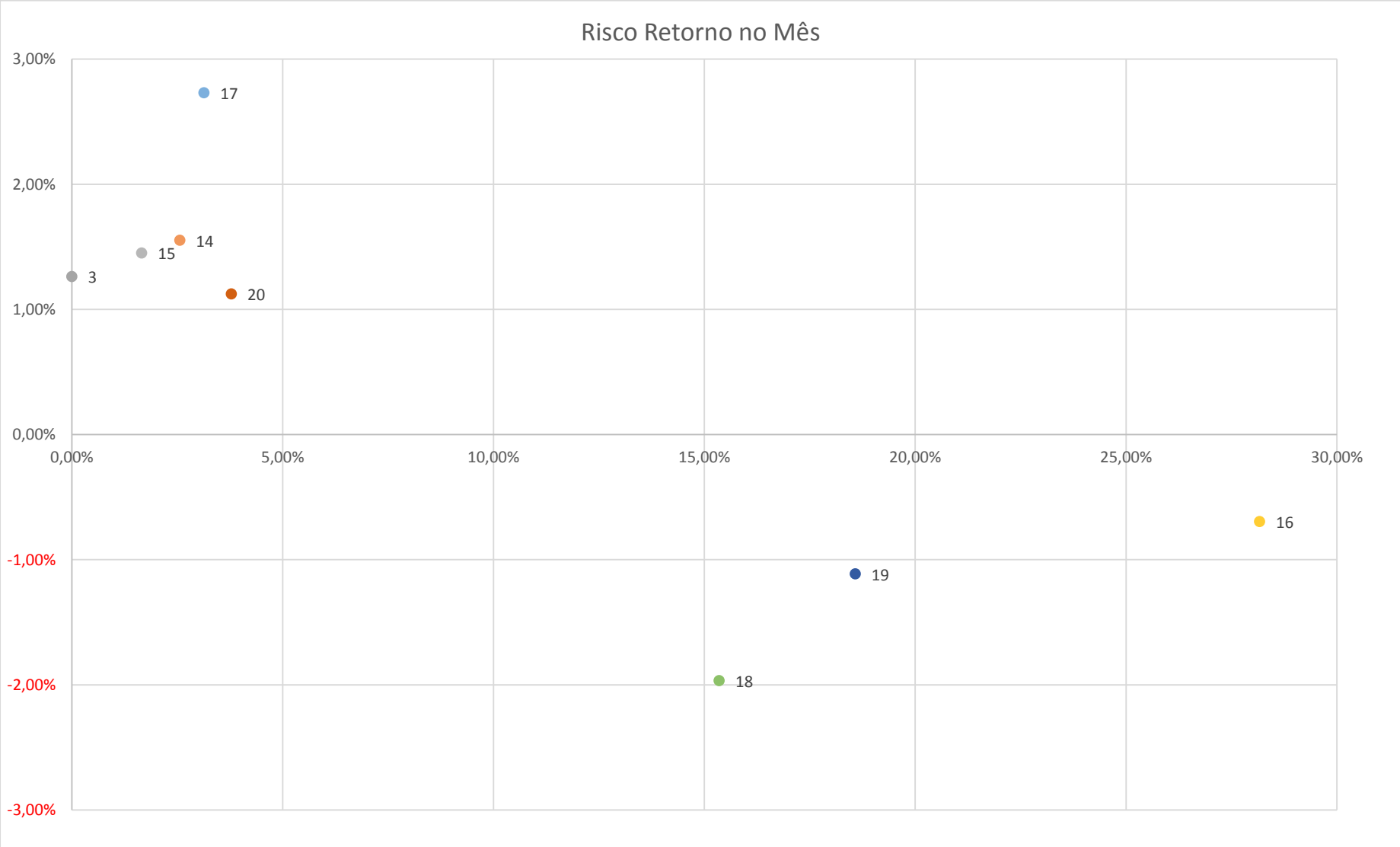
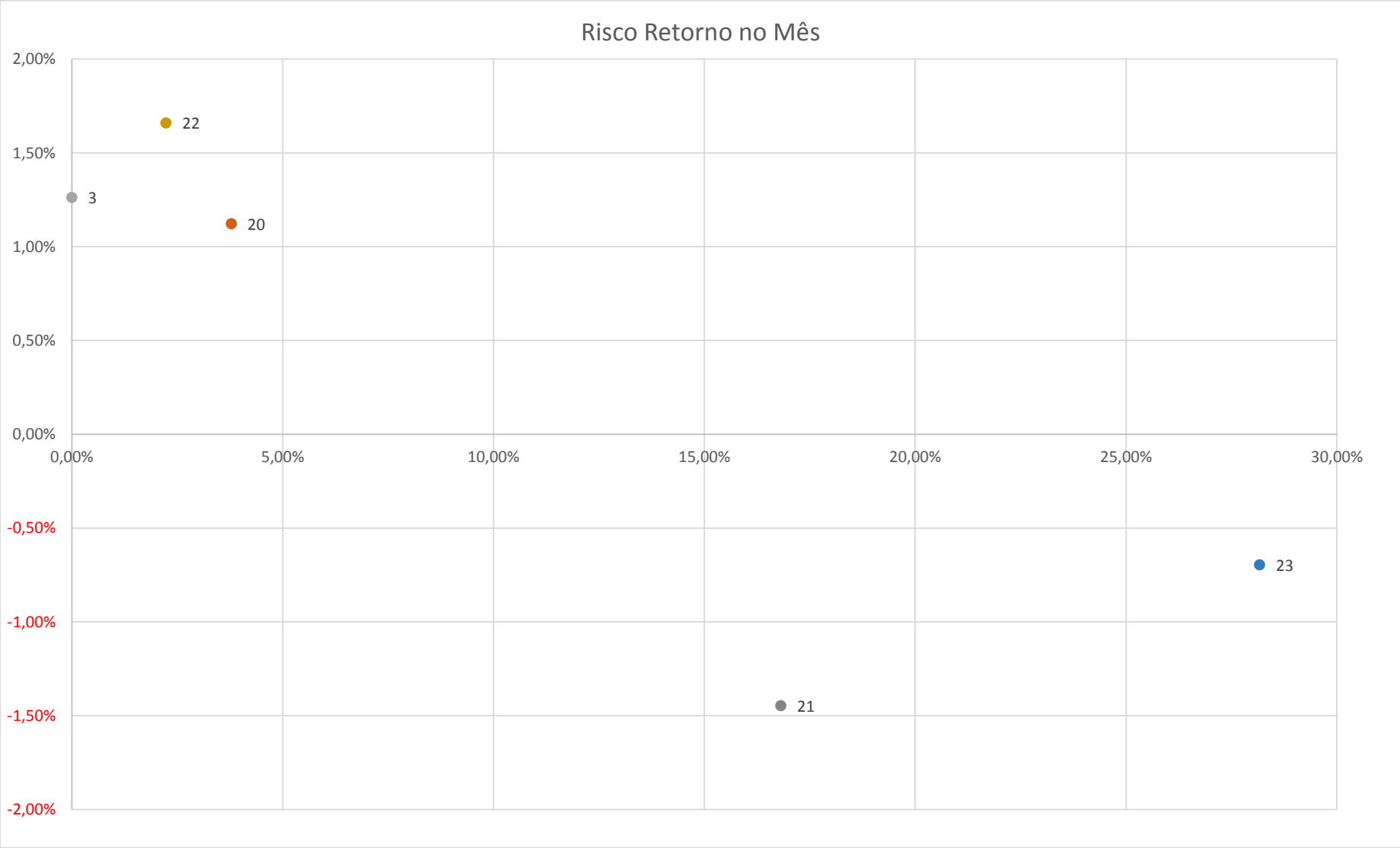
Risco x Retorno Carteira IPMU 30/11/2021




Risco Retorno no Mês
3,00%
2,00%
1,00%
0,00%
-1,00%
-2,00%
-3,00%
0,00%
5,00%
10,00%
15,00%
20,00%
25,00%
30,00%
17
14
15
3
20
16
19
18

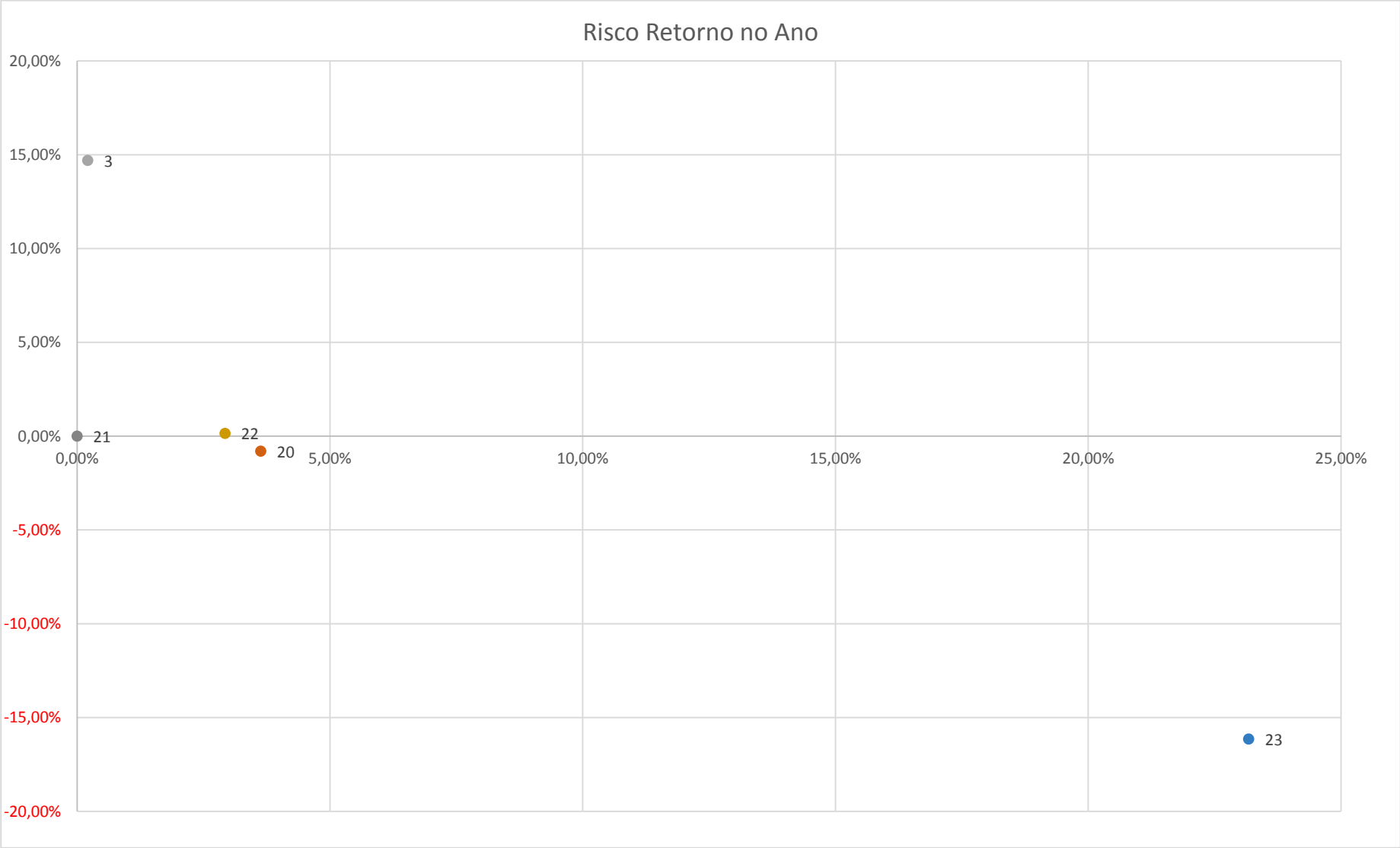

Risco Retorno no Mês
2,00%
1,50%
1,00%
0,50%
0,00%
-0,50%
-1,00%
-1,50%
-2,00%
0,00%
5,00%
10,00%
15,00%
20,00%
25,00%
30,00%
22
3
20
23
21

Risco Retorno no Mês

	Ativo	Volatilidade	Retorno
3	Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410%	0,00%	1,26%
6	BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	22,09%	-3,26%
7	CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	27,62%	3,05%
8	CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	32,86%	-3,24%
10	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	17,75%	-1,36%
11	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19,65%	-0,89%
14	Portfólio - Art. 7°, I, b	2,56%	1,55%
15	Portfólio - Art. 7º, IV, a	1,66%	1,45%
16	Portfólio - Art. 8°, II, a	28,17%	-0,70%
17	Portfólio Art. 7°, I, a	3,14%	2,73%
18	Portfólio Art. 9º-A, II - Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior	15,35%	-1,97%
19	Portfólio Art. 9º-A, III - Fundo de Ações BDR Nível 1	18,58%	-1,11%
20	Portfólio Carteira IPMU 2021	3,78%	1,12%
21	Portfólio Exterior 2021	16,82%	-1,45%
22	Portfólio Renda Fixa 2021	2,23%	1,66%
23	Portfólio Renda Variável 2021	28,17%	-0,70%
26	CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	15,66%	-1,80%
27	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	16,45%	-2,01%
30	NTN-B 760199 20240815	3,14%	2,73%
32	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,04%	1,73%
33	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,20%	4,44%
34	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,92%	1,74%
35	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,84%	0,91%
36	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12,83%	4,35%
37	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,59%	3,44%
39	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,50%	1,54%
40	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,40%	1,45%
41	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,36%	0,71%
42	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,52%	1,64%
43	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2,09%	1,35%

Risco x Retorno Carteira IPMU 30/11/2021

Risco Retorno no Ano
20,00%
15,00%
10,00%
5,00%
0,00%
-5,00%
-10,00%
-15,00%
-20,00%
0,00%
5,00%
10,00%
15,00%
20,00%
25,00%
3
15
17
18
20
14
16


Risco Retorno no Ano
20,00%
15,00%
10,00%
5,00%
0,00%
-5,00%
-10,00%
-15,00%
-20,00%
0,00%
5,00%
10,00%
15,00%
20,00%
25,00%
3
21
22
20
23

Risco Retorno no Ano

	Ativo	Volatilidade	Retorno
3	Meta Atuarial 2021 - Índice INPC +5,410%	0,21%	14,70%
6	BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	20,83%	-14,33%
7	CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	23,13%	-10,88%
8	CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	24,61%	-20,50%
10	BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	17,30%	28,44%
11	CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17,49%	28,32%
14	Portfólio - Art. 7°, I, b	3,74%	-2,28%
15	Portfólio - Art. 7º, IV, a	1,43%	2,01%
16	Portfólio - Art. 8°, II, a	23,17%	-16,14%
17	Portfólio Art. 7°, I, a	3,94%	2,29%
18	Portfólio Art. 9º-A, II - Fundo Investimento - Sufixo Investimento no Exterior	0,00%	0,00%
19	Portfólio Art. 9º-A, III - Fundo de Ações BDR Nível 1	0,00%	0,00%
20	Portfólio Carteira IPMU 2021	3,63%	-0,80%
21	Portfólio Exterior 2021	0,00%	0,00%
22	Portfólio Renda Fixa 2021	2,93%	0,15%
23	Portfólio Renda Variável 2021	23,17%	-16,14%
26	CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	17,70%	13,30%
27	SANTANDER GLOBAL EQUITIES DOLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	16,53%	22,57%
30	NTN-B 760199 20240815	3,94%	2,29%
32	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,90%	-1,30%
33	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9,22%	-6,47%
34	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,69%	5,95%
35	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2,43%	-0,93%
36	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9,17%	-6,68%
37	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,89%	-1,74%
39	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,88%	-0,22%
40	BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,78%	-0,93%
41	CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2,16%	-0,04%
42	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,14%	3,64%
43	SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1,09%	2,44%