

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

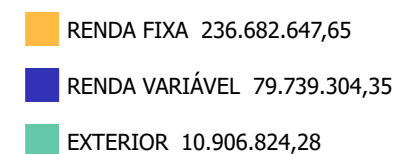
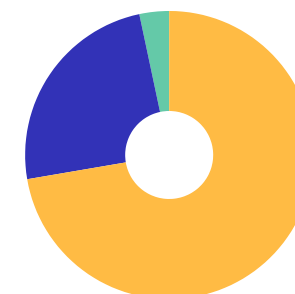
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	5.068.626,30	1,55%	5.026	1,22%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.835.002,86	1,17%	12.763	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	1.591.654,20	0,49%	122	4,38%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	4.222.155,91	1,29%	591	0,20%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.114.932,54	1,87%	61.312	0,27%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	713.142,56	0,22%		0,25%	Artigo 11º
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	489.832,57	0,15%	549	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.540.835,20	2,91%	1.032	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.422.483,97	1,96%	787	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	11.397.416,38	3,48%	1.126	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.566.143,29	1,39%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	143.489,60	0,04%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.195.675,86	2,50%	105	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	27.760.207,80	8,48%	941	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	18.601.866,70	5,68%	1.059	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	17.880.008,45	5,46%	1.021	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.441.949,17	2,58%	834	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.985.764,70	8,86%	821	0,93%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.486.665,79	1,68%	191	0,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	277.811,62	0,08%	219	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.822.133,72	8,50%	142	2,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	46.812.311,29	14,30%	131	2,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	6.630.815,37	2,03%	248	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.227.236,17	2,21%	87	1,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	409.136,91	0,12%	7.004	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.184.295,12	1,89%	2.508	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	29.318,11	0,01%	918	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.871.865,39	3,93%	9.958	1,41%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	5.047.451,55	1,54%	4.707	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.834.347,65	1,48%	33.381	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.631.534,03	2,03%	3.778	1,82%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	10.216.940,06	3,12%	14	2,64%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	11.968.901,16	3,66%	30	1,28%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	3.157.398,75	0,96%	90	0,17%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	3.817.343,32	1,17%	80	0,42%	Artigo 9º, Inciso II
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCI...	D+6 du	Não há	378.187,61	0,12%	10	0,00%	Artigo 9º, Inciso II
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD IN...	D+6 du	Não há	374.704,01	0,11%	10	0,01%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.179.190,59	0,97%	1.176	0,10%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			327.328.776,28				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,62%	59,24%	193.909.567,07
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	113.439.908,99	34,66%	14,72%	18,62%	59,24%	80.469.658,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	65,00%	123.242.738,66	37,65%	13,08%	17,44%	55,00%	56.788.088,29
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,44%	20,00%	65.465.755,26
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	16.366.438,81
Total Renda Fixa	100,00%	236.682.647,65	72,31%	27,80%	74,90%	198,48%	



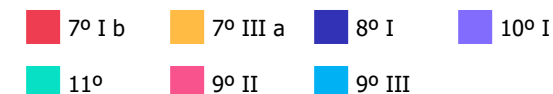
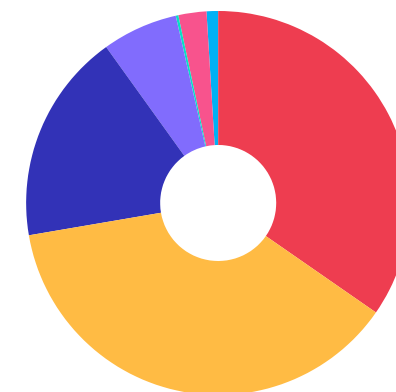
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	58.193.789,98	17,78%	11,21%	12,70%	25,00%	23.638.404,09
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,24%	25,00%	81.832.194,07
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	20.832.371,81	6,36%	2,09%	2,78%	10,00%	11.900.505,82
Artigo 11º	5,00%	713.142,56	0,22%	0,00%	0,37%	0,37%	497.973,91
Total Renda Variável	35,00%	79.739.304,35	24,36%	13,30%	18,09%	60,37%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	7.727.633,69	2,36%	1,88%	2,50%	10,00%	25.005.243,94
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.179.190,59	0,97%	1,88%	2,50%	10,00%	29.553.687,04
Total Exterior	10,00%	10.906.824,28	3,33%	3,76%	5,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	172.221.021,24	52,61	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	74.705.002,90	22,82	0,00
TRÍGONO CAPITAL	22.185.841,22	6,78	0,50
ITAÚ UNIBANCO	11.465.163,02	3,50	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	7.401.346,50	2,26	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	7.227.236,17	2,21	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	6.631.534,03	2,03	-
WESTERN ASSET	6.114.932,54	1,87	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.764.477,41	1,76	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	5.068.626,30	1,55	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	5.047.451,55	1,54	0,35
MULTINVEST CAPITAL	1.591.654,20	0,49	0,16
MIRAE ASSET	752.891,62	0,23	0,16
ZION INVEST	713.142,56	0,22	0,09
AZ QUEST INVESTIMENTOS	409.136,91	0,12	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	29.318,11	0,01	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	113.439.908,99	34,66	14,72	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	123.242.738,66	37,65	13,08	55,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	58.193.789,98	17,78	11,21	25,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 9º, Inciso II	7.727.633,69	2,36	1,88	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.179.190,59	0,97	1,88	10,00
Artigo 10º, Inciso I	20.832.371,81	6,36	2,09	10,00
Artigo 11º	713.142,56	0,22	0,00	0,37
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Artigo 14º - 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)

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,10%	0,10%	2,87%	1,16%	1,16%	5,07%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,04%	2,70%	0,57%	0,19%	4,21%	1,02%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	3,16%	3,11%	4,47%	12,51%	1,06%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	3,17%	3,14%	4,54%	12,58%	1,11%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	0,61%	2,25%	2,43%	3,24%	6,41%	0,38%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,08%	0,08%	3,33%	3,12%	4,25%	11,85%	1,00%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	0,57%	2,92%	4,23%	6,93%	15,47%	0,92%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	0,09%	3,35%	3,20%	4,32%	11,89%	0,99%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-0,73%	-0,73%	2,94%	-0,91%	-1,15%	4,02%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	0,56%	2,91%	4,19%	6,86%	12,96%	0,92%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,76%	-0,76%	2,87%	-1,06%	-1,42%	3,39%	2,01%	0,05%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,03%	-0,03%	3,55%	0,25%	-2,08%	0,69%	1,31%	0,06%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Selic (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,78%	0,78%	2,24%	3,85%	5,59%	7,61%	0,01%	0,01%

CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,85%	0,85%	2,26%	3,75%	5,22%	7,78%	0,08%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,81%	0,81%	2,29%	1,41%	1,43%	-	0,07%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,33%	0,33%	2,47%	2,45%	3,54%	6,00%	0,55%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,52%	0,52%	3,06%	3,87%	4,94%	7,72%	0,38%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,24%	2,49%	1,09%	0,67%	4,30%	0,70%	0,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-5,26%	-5,26%	-1,95%	2,74%	21,57%	39,99%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-5,21%	-5,21%	-0,43%	5,80%	26,90%	-	8,60%	0,14%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-5,21%	-5,21%	-0,51%	5,60%	25,75%	40,32%	8,55%	0,14%

MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-8,96%	-8,96%	-6,08%	3,40%	14,87%	70,60%	9,85%	0,17%

Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,68%	3,68%	6,98%	-3,28%	4,59%	6,18%	6,86%	0,15%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3,98%	3,98%	4,88%	-18,40%	-10,73%	-17,03%	15,73%	0,20%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,51%	7,51%	7,26%	-8,88%	-0,08%	-10,08%	9,32%	0,17%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9,15%	9,15%	10,15%	-8,85%	-5,27%	-5,23%	8,85%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,34%	1,34%	0,85%	-14,76%	-5,90%	-11,63%	10,71%	0,14%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,07%	-2,07%	-2,40%	-7,04%	-	-	13,54%	-
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,12%	-3,12%	-4,37%	-13,04%	35,26%	-	14,98%	0,27%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,88%	3,88%	6,64%	-8,47%	2,09%	-9,60%	9,05%	0,17%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,72%	7,72%	5,42%	-12,07%	-7,60%	-16,70%	8,08%	0,17%

CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,27%	1,27%	3,05%	-0,01%	2,83%	5,63%	1,39%	0,04%

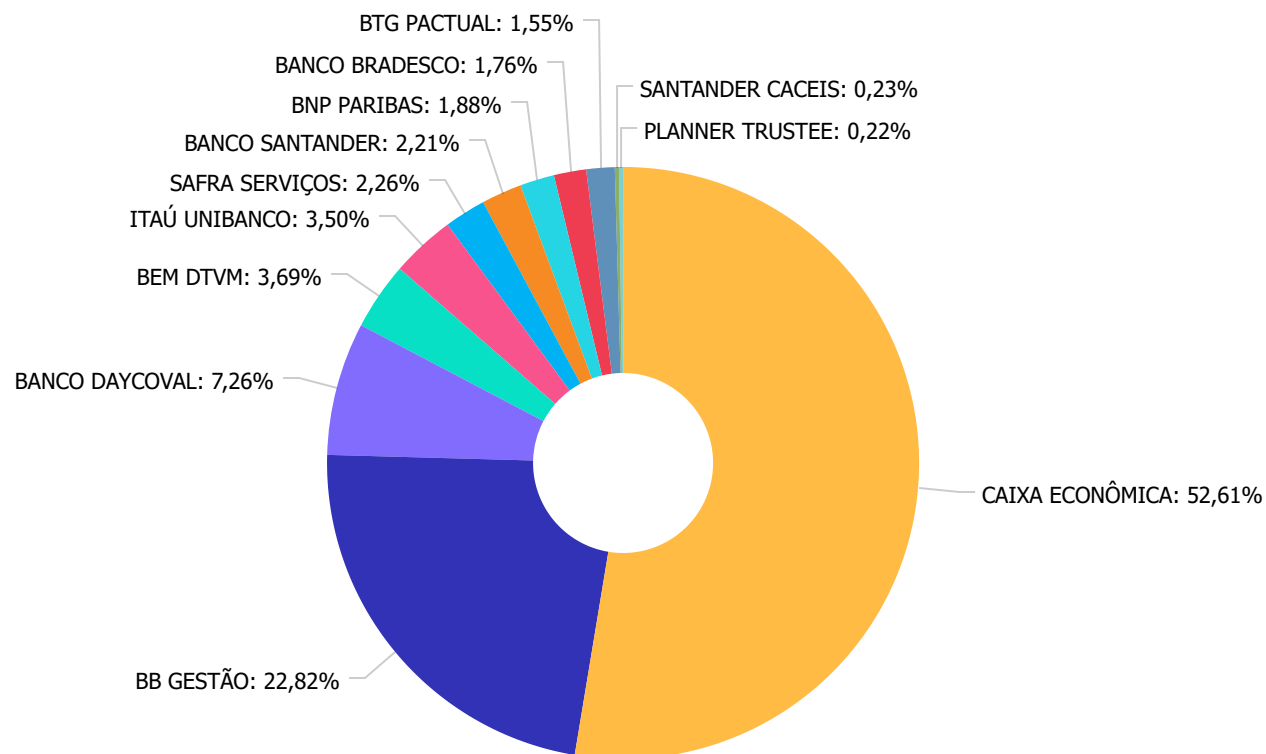
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-5,19%	-5,19%	-0,55%	5,46%	25,48%	40,50%	8,46%	0,13%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	-0,43%	-0,43%	-0,34%	-4,17%	-3,10%	-3,35%	1,19%	0,04%
IFIX (Benchmark)	-0,99%	-0,99%	3,78%	-1,67%	-3,56%	-9,76%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-24,91%	-24,91%	-18,43%	170,13%	201,45%	80,87%	41,52%	0,91%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

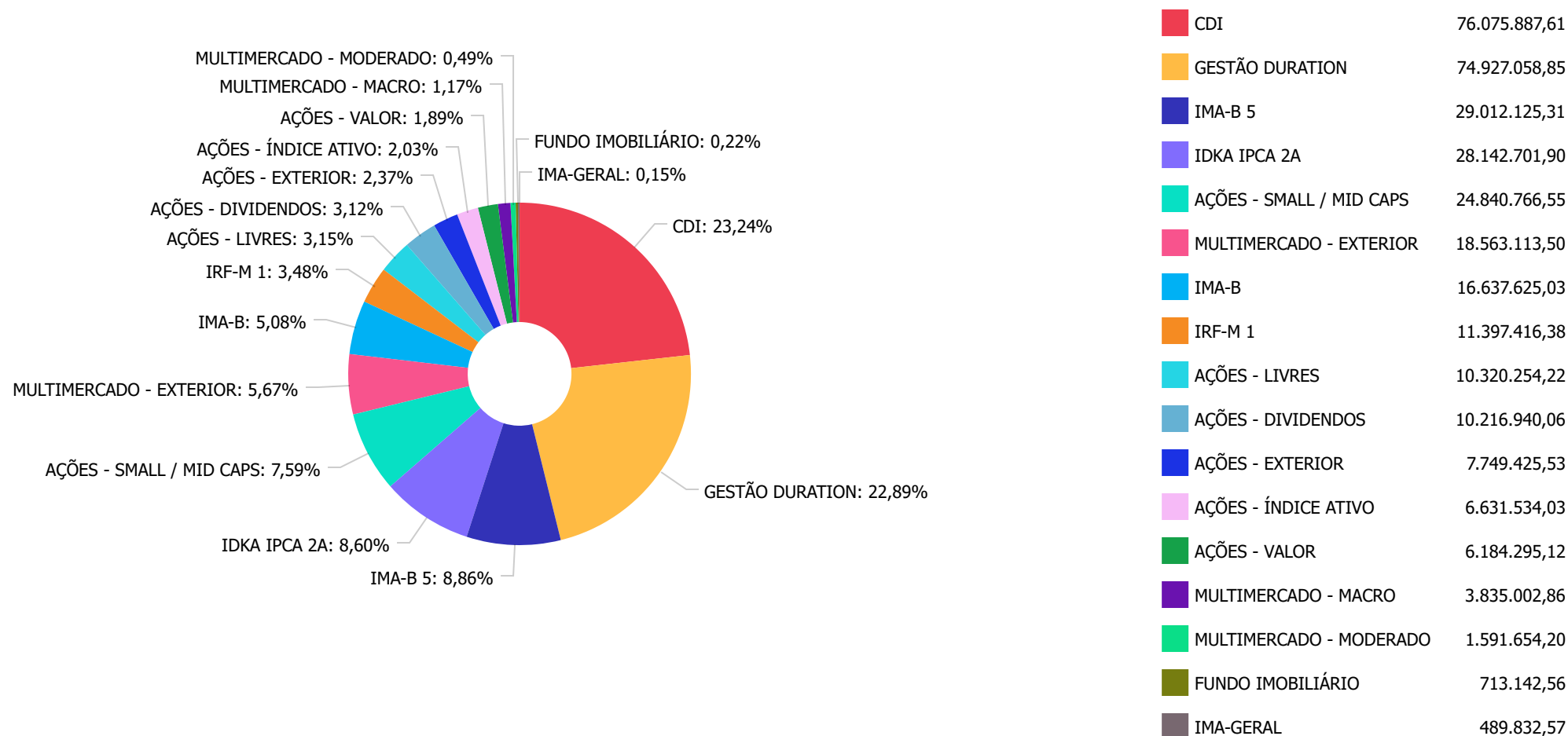
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-11,73%	-11,73%	-8,49%	0,72%	13,94%	59,64%	8,24%	0,18%
MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-8,96%	-8,96%	-6,08%	3,40%	14,87%	70,60%	9,85%	0,17%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-15,52%	-15,52%	-12,90%	-3,21%	5,84%	73,67%	9,88%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVESTIMENTO NO EXT...	-16,27%	-16,27%	-30,76%	-17,18%	-20,68%	-	18,70%	0,27%
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	-21,55%	-21,55%	-26,21%	-12,22%	-18,02%	-	13,24%	0,26%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2022)



CAIXA ECONÔMICA	172.221.021,24
BB GESTÃO	74.705.002,90
BANCO DAYCOVAL	23.777.495,42
BEM DTVM	12.088.122,49
ITAÚ UNIBANCO	11.465.163,02
SAFRA SERVIÇOS	7.401.346,50
BANCO SANTANDER	7.227.236,17
BNP PARIBAS	6.144.250,65
BANCO BRADESCO	5.764.477,41
BTG PACTUAL	5.068.626,30
SANTANDER CACEIS	752.891,62
PLANNER TRUSTEE	713.142,56

Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2022)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ ATENÇÃO! Meta de Rentabilidade de **2022** não está cadastrada !!!

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	48.044.729,98	0,00	1.638.000,00	46.812.311,29	405.581,31	0,84%	0,85%	0,08%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	27.598.307,07	0,00	0,00	27.822.133,72	223.826,65	0,81%	0,81%	0,07%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	275.673,48	0,00	0,00	277.811,62	2.138,14	0,78%	0,78%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	27.576.107,87	0,00	0,00	27.760.207,80	184.099,93	0,67%	0,67%	0,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	28.086.076,32	1.222.511,10	507.524,60	28.985.764,70	184.701,88	0,63%	0,65%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	11.327.857,49	0,00	0,00	11.397.416,38	69.558,89	0,61%	0,61%	0,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.540.320,62	0,00	0,00	4.566.143,29	25.822,67	0,57%	0,57%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	142.684,40	0,00	0,00	143.489,60	805,20	0,56%	0,56%	0,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	6.596.358,33	0,00	0,00	6.630.815,37	34.457,04	0,52%	0,52%	0,38%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	7.203.843,51	0,00	0,00	7.227.236,17	23.392,66	0,32%	0,32%	0,55%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.473.654,52	0,00	0,00	5.486.665,79	13.011,27	0,24%	0,24%	0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.863.863,49	0,00	0,00	17.880.008,45	16.144,96	0,09%	0,09%	0,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.417.554,46	0,00	0,00	6.422.483,97	4.929,51	0,08%	0,08%	1,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	489.646,56	0,00	0,00	489.832,57	186,01	0,04%	0,04%	1,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	18.598.367,83	0,00	0,00	18.601.866,70	3.498,87	0,02%	0,02%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.539.916,33	0,00	0,00	9.540.835,20	918,87	0,01%	0,01%	1,06%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.198.241,81	0,00	0,00	8.195.675,86	-2.565,95	-0,03%	-0,03%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.506.353,94	0,00	0,00	8.441.949,17	-64.404,77	-0,76%	-0,76%	2,01%
Total Renda Fixa	236.479.558,01	1.222.511,10	2.145.524,60	236.682.647,65	1.126.103,14	0,48%		0,50%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	26.860,02	0,00	0,00	29.318,11	2.458,09	9,15%	9,15%	8,85%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	379.805,00	0,00	0,00	409.136,91	29.331,91	7,72%	7,72%	8,08%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	6.168.450,70	0,00	0,00	6.631.534,03	463.083,33	7,51%	7,51%	9,32%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12.379.273,13	0,00	0,00	12.871.865,39	492.592,26	3,98%	3,98%	15,73%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.859.027,15	0,00	0,00	5.047.451,55	188.424,40	3,88%	3,88%	9,05%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.964.548,73	0,00	0,00	6.184.295,12	219.746,39	3,68%	3,68%	6,86%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.770.336,98	0,00	0,00	4.834.347,65	64.010,67	1,34%	1,34%	10,71%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.786.742,15	0,00	0,00	3.835.002,86	48.260,71	1,27%	1,27%	1,39%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	0,04	0,00	0,04	0,00	0,00	0,00%	6,78%	10,10%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.598.509,70	0,00	0,00	1.591.654,20	-6.855,50	-0,43%	-0,43%	1,19%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.432.510,60	0,00	0,00	10.216.940,06	-215.570,54	-2,07%	-2,07%	13,54%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.354.221,43	0,00	0,00	11.968.901,16	-385.320,27	-3,12%	-3,12%	14,98%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	4.453.034,18	0,00	0,00	4.222.155,91	-230.878,27	-5,18%	-5,18%	8,46%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	5.346.918,11	0,00	0,00	5.068.626,30	-278.291,81	-5,20%	-5,20%	8,60%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.450.839,71	0,00	0,00	6.114.932,54	-335.907,17	-5,21%	-5,21%	8,55%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	949.713,89	0,00	0,00	713.142,56	-236.571,33	-24,91%	-24,91%	41,52%
Total Renda Variável	79.920.791,52	0,00	0,04	79.739.304,35	-181.487,13	-0,23%		11,21%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2022)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	3.468.063,69	0,00	0,00	3.157.398,75	-310.664,94	-8,96%	-8,96%	9,85%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.601.493,72	0,00	0,00	3.179.190,59	-422.303,13	-11,73%	-11,73%	8,24%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	4.518.828,07	0,00	0,00	3.817.343,32	-701.484,75	-15,52%	-15,52%	9,88%
CLOU GLOBAL X MIRAE ASSET CLOUD COMPUTING USD INVE...	447.499,21	0,00	0,00	374.704,01	-72.795,20	-16,27%	-16,27%	18,70%
BOTZ GLOBAL X MIRAE ASSET ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ...	482.091,31	0,00	0,00	378.187,61	-103.903,70	-21,55%	-21,55%	13,24%
Total Exterior	12.517.976,00	0,00	0,00	10.906.824,28	-1.611.151,72	-12,87%		9,81%

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 nº 519, de 24 de agosto de 2011 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.