

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

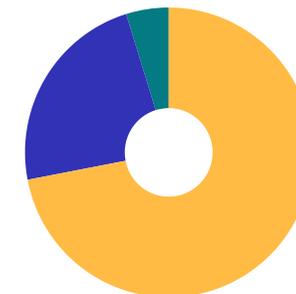
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			534.383,11	0,69%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea a
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.419.927,69	12,08%	1.035	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.772.085,39	7,40%	788	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	315.894,61	0,40%	1.127	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	881.960,46	1,13%	945	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.484.688,60	3,19%	1.060	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	707.184,13	0,91%	1.023	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	869.779,56	1,11%	840	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	320.827,00	0,41%	1.241	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	5.526.311,85	7,08%	80	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.802.515,77	4,87%	803	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	575.680,51	0,74%	244	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.550.681,79	1,99%	110	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	2.002.242,53	2,57%	305	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	3.778.913,23	4,84%	4.853	2,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	861.159,77	1,10%	99	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	10.943.233,48	14,03%	247	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.794.653,75	7,43%	143	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.245.421,83	4,16%	5.504	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea a
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.608.954,14	4,63%	2.580	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea a

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	3.472.433,69	4,45%	34.166	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea a
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	2.940.158,23	3,77%	29	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea a
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.847.750,28	3,65%	13.421	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.016.806,63	2,59%	12.762	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	3.734.386,25	4,79%	82	0,25%	Artigo 9º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			78.008.034,28				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			107.923,07				Artigo 6º
PL Total			78.115.957,35				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	100,00%	534.383,11	0,69%	0,00%	0,76%	1,00%	245.697,23
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	26.298.659,29	33,71%	11,37%	50,84%	71,05%	29.126.049,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	50,00%	29.309.080,83	37,57%	4,07%	20,36%	40,00%	1.894.132,88
Total Renda Fixa	100,00%	56.142.123,23	71,97%	15,44%	71,96%	112,05%	



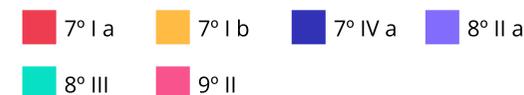
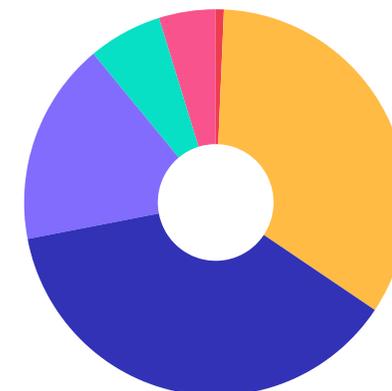
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	30,00%	13.266.967,89	17,01%	4,00%	19,24%	20,00%	2.334.638,97
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.864.556,91	6,24%	3,09%	8,09%	10,00%	2.936.246,52
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	18.131.524,80	23,24%	7,09%	27,33%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.734.386,25	4,79%	0,00%	0,35%	5,00%	166.015,46
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,36%	5,00%	3.900.401,71
Total Exterior	10,00%	3.734.386,25	4,79%	0,00%	0,71%	10,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea a	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	11,37	71,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	4,07	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	19,24	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,09	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

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	27.229.444,36	34,91	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	26.597.792,54	34,10	0,00
CAIXA DTVM	12.131.239,19	15,55	0,04
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	3.778.913,23	4,84	0,05
AZ QUEST INVESTIMENTOS	3.245.421,83	4,16	0,01
TRÍGONO CAPITAL	2.940.158,23	3,77	0,07
BANCO BRADESCO	1.550.681,79	1,99	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	534.383,11	0,69	-

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,83%	4,97%	1,84%	3,05%	4,97%	14,02%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,72%	4,66%	1,82%	3,05%	4,66%	13,07%	1,10%	3,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	3,12%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,88%	2,93%	1,13%	2,10%	2,93%	6,88%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	1,09%	1,99%	2,70%	6,43%	0,20%	1,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	2,64%	1,10%	1,97%	2,64%	6,20%	0,20%	1,24%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	4,31%	1,97%	3,12%	4,31%	12,39%	1,02%	3,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,77%	4,35%	1,99%	3,14%	4,35%	12,52%	1,02%	3,21%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	4,27%	1,94%	3,06%	4,27%	12,38%	1,04%	3,23%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,75%	3,51%	1,82%	2,71%	3,51%	11,05%	1,06%	3,23%
IMA-B (Benchmark)	0,22%	-1,26%	1,06%	-0,55%	-1,26%	5,06%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21%	-1,53%	1,00%	-0,70%	-1,53%	4,44%	2,16%	5,20%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,09%	-1,47%	0,38%	-0,61%	-1,47%	5,95%	2,27%	6,18%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	-1,48%	0,99%	-0,65%	-1,48%	4,35%	2,16%	5,23%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,16%	-2,34%	0,83%	-0,99%	-2,34%	3,82%	2,09%	5,33%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,63%	3,29%	1,49%	2,41%	3,29%	5,25%	0,02%	0,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,46%	6,00%	2,19%	4,92%	6,00%	10,36%	0,21%	1,47%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,67%	3,27%	1,58%	2,49%	3,27%	4,96%	0,02%	0,65%
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	2,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,86%	4,53%	2,16%	3,49%	4,53%	7,52%	0,23%	1,79%

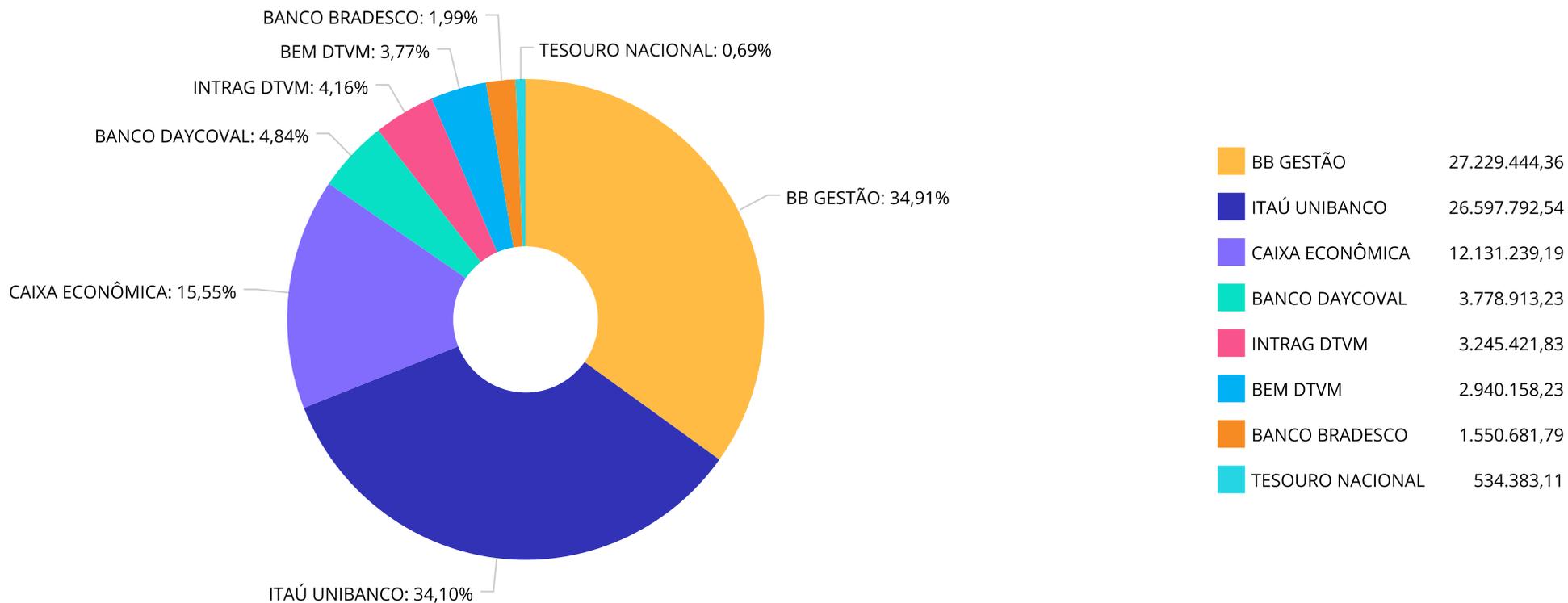
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,27%	-0,83%	-0,10%	-3,05%	-0,83%	1,68%	2,65%	4,07%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	1,44%	0,85%	-1,63%	1,44%	5,01%	1,69%	3,44%
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,08%	-4,76%	-2,54%	-8,88%	-4,76%	0,93%	9,34%	15,88%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,61%	42,30%	-6,04%	-7,90%	42,30%	-	11,29%	26,09%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,97%	-8,51%	-7,99%	-18,47%	-8,51%	-12,97%	6,70%	14,33%
SMLL (Benchmark)	3,80%	-16,20%	-11,28%	-24,79%	-16,20%	-16,75%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,32%	-9,66%	-8,26%	-20,26%	-9,66%	-12,52%	8,07%	14,71%

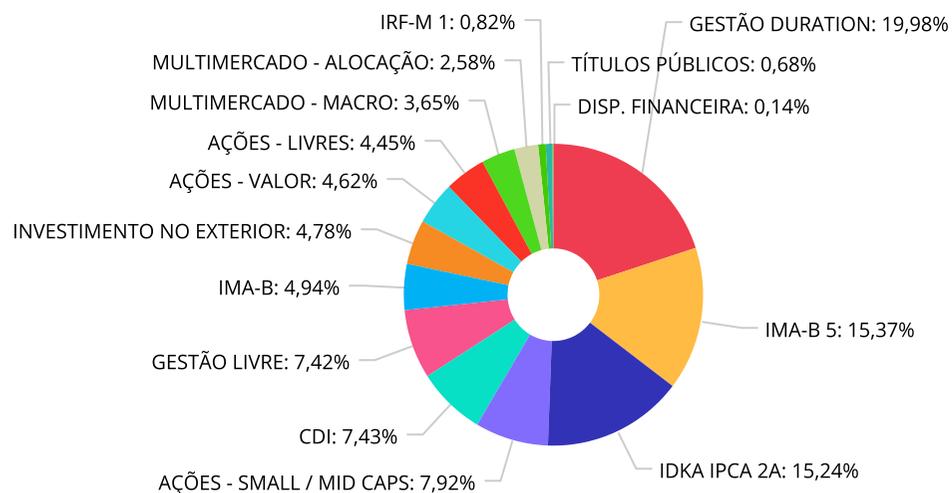
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	3,46%	29,01%	10,28%	19,49%	29,01%	89,71%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	2,39%	30,87%	7,20%	17,92%	30,87%	104,15%	7,15%	10,755%

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



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



■ GESTÃO DURATION	15.604.107,17	■ IMA-B 5	12.005.581,37	■ IDKA IPCA 2A	11.904.616,29	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.185.580,06
■ CDI	5.804.758,30	■ GESTÃO LIVRE	5.794.653,75	■ IMA-B	3.857.301,63	■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR	3.734.386,25
■ AÇÕES - VALOR	3.608.954,14	■ AÇÕES - LIVRES	3.472.433,69	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.847.750,28	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.016.806,63
■ IRF-M 1	636.721,61	■ TÍTULOS PÚBLICOS	534.383,11	■ DISP. FINANCEIRA	107.923,07		

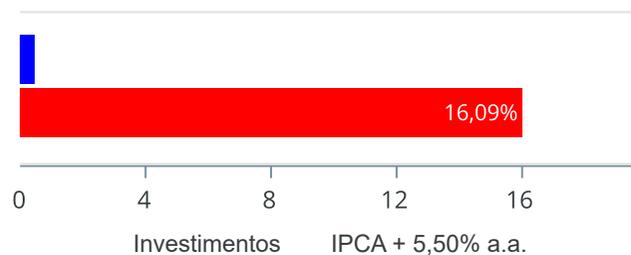
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/08/2004	303	1.649,25778877	4.061,941099	499.725,11	1.230.768,15	Mercado

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	74.056.389,05	996.675,97	1.045.205,34	73.459.943,30	-547.916,38	-547.916,38	-0,74%	-0,74%	0,68%	0,68%	-109,30%	3,71%
Fevereiro	73.459.943,30	2.030.452,20	1.198.209,91	73.536.334,68	-755.850,91	-1.303.767,29	-1,02%	-1,75%	1,25%	1,93%	-90,58%	3,38%
Março	73.536.334,68	4.063.446,49	3.818.180,21	74.381.758,39	600.157,43	-703.609,86	0,81%	-0,95%	1,42%	3,38%	-28,09%	3,83%
Abril	74.381.758,39	1.386.645,06	1.656.259,71	75.105.637,29	993.493,55	289.883,69	1,34%	0,37%	0,74%	4,15%	8,98%	2,23%
Mai	75.105.637,29	2.976.967,19	2.697.581,97	76.830.595,04	1.445.572,53	1.735.456,22	1,92%	2,30%	1,28%	5,48%	41,92%	2,62%
Junho	76.830.595,04	4.421.286,69	4.701.973,17	76.690.219,21	140.310,65	1.875.766,87	0,18%	2,48%	0,98%	6,51%	38,14%	1,92%
Julho	76.690.219,21	5.397.097,99	5.141.077,87	76.391.824,41	-554.414,92	1.321.351,95	-0,72%	1,75%	1,43%	8,04%	21,71%	2,51%
Agosto	76.391.824,41	4.268.513,79	4.021.309,25	76.263.060,82	-375.968,13	945.383,82	-0,49%	1,25%	1,34%	9,49%	13,13%	2,49%
Setembro	76.263.060,82	1.418.235,85	1.129.036,56	76.357.318,63	-194.941,48	750.442,34	-0,25%	0,99%	1,61%	11,26%	8,78%	2,50%
Outubro	76.357.318,63	5.850.101,81	5.619.685,12	75.057.044,13	-1.530.691,19	-780.248,85	-2,00%	-1,03%	1,68%	13,13%	-7,85%	3,49%
Novembro	75.057.044,13	9.859.024,73	9.183.775,12	77.828.328,96	2.096.035,22	1.315.786,37	2,77%	1,71%	1,38%	14,69%	11,64%	2,95%
Dezembro	77.828.328,96	2.846.590,20	1.696.555,01	78.008.034,28	-970.329,87	345.456,50	-1,23%	0,46%	1,22%	16,09%	2,86%	2,51%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



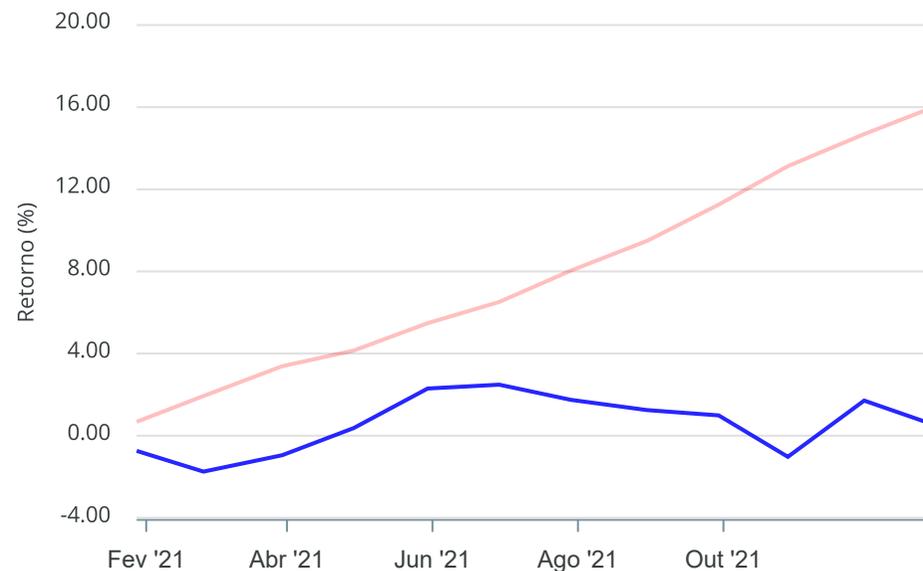
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2021
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	10.849.840,24	0,00	0,00	10.943.233,48	93.393,24	0,86%	0,86%	0,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	304.840,36	8.427,24	0,00	315.894,61	2.627,01	0,84%	0,84%	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	299.837,74	25.071,93	6.772,60	320.827,00	2.689,93	0,83%	0,85%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	874.737,87	0,00	0,00	881.960,46	7.222,59	0,83%	0,83%	0,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	874.737,87	0,00	0,00	881.960,46	7.222,59	0,83%	0,83%	0,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	5.483.929,79	0,00	0,00	5.526.311,85	42.382,06	0,77%	0,77%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	701.798,28	0,00	0,00	707.184,13	5.385,85	0,77%	0,77%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.728.422,39	0,00	0,00	5.772.085,39	43.663,00	0,76%	0,76%	1,04%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	3.750.847,73	0,00	0,00	3.778.913,23	28.065,50	0,75%	0,75%	1,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.468.284,51	0,00	1.359,80	2.484.688,60	17.763,89	0,72%	0,72%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.353.870,47	0,00	0,00	9.419.927,69	66.057,22	0,71%	0,71%	1,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.516.700,35	1.347.591,52	1.087.285,06	3.802.515,77	25.508,96	0,52%	0,67%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.768.005,64	0,00	0,00	5.794.653,75	26.648,11	0,46%	0,46%	0,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.129.971,15	1.465.499,51	601.137,55	2.002.242,53	7.909,42	0,30%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.129.971,15	1.465.499,51	601.137,55	2.002.242,53	7.909,42	0,30%	0,63%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	867.962,53	0,00	0,00	869.779,56	1.817,03	0,21%	0,21%	2,16%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	574.491,75	0,00	0,00	575.680,51	1.188,76	0,21%	0,21%	2,16%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.548.137,19	0,00	0,00	1.550.681,79	2.544,60	0,16%	0,16%	2,09%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	860.429,68	0,00	0,00	861.159,77	730,09	0,08%	0,08%	2,27%
TÍTULOS PÚBLICOS	534.383,11	0,00	0,00	534.383,11	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	56.621.199,80	4.312.089,71	2.297.692,56	59.026.326,22	390.729,27	0,67%		0,71%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕE...	2.682.395,05	0,00	0,00	2.940.158,23	257.763,18	9,61%	9,61%	11,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.467.589,23	0,00	0,00	3.608.954,14	141.364,91	4,08%	4,08%	9,34%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.172.005,10	0,00	0,00	3.245.421,83	73.416,73	2,31%	2,31%	8,07%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.807.485,78	0,00	0,00	2.847.750,28	40.264,50	1,43%	1,43%	1,69%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.991.456,36	0,00	0,00	2.016.806,63	25.350,27	1,27%	1,27%	2,65%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.439.040,18	0,00	0,00	3.472.433,69	33.393,51	0,97%	0,97%	6,70%
Total Renda Variável	17.559.971,70	0,00	0,00	18.131.524,80	571.553,10	3,25%		6,98%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	3.647.157,46	0,00	0,00	3.734.386,25	87.228,79	2,39%	2,39%	7,15%
Total Exterior	3.647.157,46	0,00	0,00	3.734.386,25	87.228,79	2,39%		7,15%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	10.712.311,26	0,00	0,00	10.943.233,48	230.922,22	2,16%	2,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.545.145,88	0,00	3.269.573,01	9.419.927,69	144.354,82	1,15%	1,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	5.418.775,74	0,00	0,00	5.526.311,85	107.536,11	1,98%	1,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	4.623.524,33	1.064.477,63	0,00	5.794.653,75	106.651,79	1,88%	2,19%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	3.678.193,78	0,00	3.778.913,23	100.719,45	2,74%	1,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.579.452,41	0,00	3.900.000,00	5.772.085,39	92.632,98	0,97%	1,94%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.315.366,64	3.591.014,24	3.164.053,37	3.802.515,77	60.188,26	0,87%	1,58%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.756.947,03	0,00	317.086,50	2.484.688,60	44.828,07	1,63%	1,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	693.524,13	0,00	0,00	707.184,13	13.660,00	1,97%	1,97%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.537.955,64	0,00	0,00	1.550.681,79	12.726,15	0,83%	0,83%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	872.654,70	0,00	0,00	881.960,46	9.305,76	1,07%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	861.163,34	0,00	0,00	869.779,56	8.616,22	1,00%	1,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	303.448,51	25.071,93	11.093,73	320.827,00	3.400,29	1,04%	1,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	304.079,91	8.427,24	0,00	315.894,61	3.387,46	1,08%	1,10%
TÍTULOS PÚBLICOS	534.383,11	0,00	0,00	534.383,11	0,00	0,00%	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.525.350,45	0,00	1.927.108,00	575.680,51	-22.561,94	-0,89%	0,99%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2.691.379,27	0,00	1.800.000,00	861.159,77	-30.219,50	-1,12%	0,37%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	25.435,62	3.288.531,92	896.623,01	2.002.242,53	-415.102,00	-12,53%	1,49%
Total Renda Fixa	59.300.897,97	11.655.716,74	15.285.537,62	56.142.123,23	471.046,14	0,66%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.823.864,13	0,00	0,00	2.847.750,28	23.886,15	0,85%	0,85%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.018.845,91	0,00	0,00	2.016.806,63	-2.039,28	-0,10%	-0,10%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	0,00	3.000.000,00	0,00	2.940.158,23	-59.841,77	-1,99%	-6,04%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.703.138,23	0,00	0,00	3.608.954,14	-94.184,09	-2,54%	-2,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.199.181,18	0,00	1.064.477,63	0,00	-134.703,55	-11,23%	-13,88%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.537.543,34	0,00	0,00	3.245.421,83	-292.121,51	-8,26%	-8,26%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.773.847,87	0,00	0,00	3.472.433,69	-301.414,18	-7,99%	-7,99%
Total Renda Variável	17.056.420,66	3.000.000,00	1.064.477,63	18.131.524,80	-860.418,23	-4,53%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.133.139,25	1.080.000,00	3.269.573,01	9.419.927,69	476.361,45	4,10%	4,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	8.187.753,13	2.300.000,00	0,00	10.943.233,48	455.480,35	4,50%	4,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.365.329,89	0,00	3.900.000,00	5.772.085,39	306.755,50	4,63%	4,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	4.457.248,63	1.064.477,63	0,00	5.794.653,75	272.927,49	5,84%	6,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	2.407.250,18	2.926.847,61	0,00	5.526.311,85	192.214,06	4,26%	4,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.215.491,21	4.153.586,71	2.995.305,30	2.484.688,60	110.915,98	4,32%	4,66%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	3.678.193,78	0,00	3.778.913,23	100.719,45	2,74%	3,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	857.500,40	11.555.629,39	8.698.029,39	3.802.515,77	87.415,37	2,44%	3,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.368.926,23	0,00	1.710.000,00	707.184,13	48.257,90	4,27%	4,31%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	587.617,83	8.427,24	290.000,00	315.894,61	9.849,54	2,62%	2,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	385.632,55	107.352,42	180.237,69	320.827,00	8.079,72	2,62%	2,70%
TÍTULOS PÚBLICOS	534.383,11	0,00	0,00	534.383,11	0,00	0,00%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	882.922,46	0,00	0,00	881.960,46	-962,00	1,64%	-0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.805.445,71	0,00	1.906.864,69	869.779,56	-28.801,46	-1,24%	-1,53%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.587.790,36	0,00	0,00	1.550.681,79	-37.108,57	-2,33%	-2,34%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	2.741.752,81	0,00	1.800.000,00	861.159,77	-80.593,04	-2,88%	-1,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.588.531,28	0,00	1.927.108,00	575.680,51	-85.742,77	-3,17%	-1,48%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	300.152,89	8.740.523,19	6.628.026,47	2.002.242,53	-410.407,08	2,44%	3,29%
Total Renda Fixa	52.406.867,92	35.615.037,97	33.305.144,55	56.142.123,23	1.425.361,89	2,60%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.807.250,97	0,00	0,00	2.847.750,28	40.499,31	1,45%	1,44%
BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES	541.332,33	0,00	574.784,36	0,00	33.452,03	6,18%	-17,61%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	2.881.201,35	0,00	2.914.442,70	0,00	33.241,35	1,16%	-23,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.334.640,69	0,00	3.364.477,63	0,00	29.836,94	-14,48%	-17,09%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.033.580,26	0,00	0,00	2.016.806,63	-16.773,63	-0,83%	-0,82%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	0,00	3.000.000,00	0,00	2.940.158,23	-59.841,77	-2,00%	42,30%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.789.384,58	0,00	0,00	3.608.954,14	-180.430,44	-4,76%	-4,76%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.795.331,72	0,00	0,00	3.472.433,69	-322.898,03	-8,51%	-8,51%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.466.799,23	3.000.000,00	1.600.000,00	3.245.421,83	-621.377,40	-12,51%	-9,66%
Total Renda Variável	21.649.521,13	6.000.000,00	8.453.704,69	18.131.524,80	-1.064.291,64	-3,85%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2021

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	0,00	3.900.000,00	150.000,00	3.734.386,25	-15.613,75	-0,31%	30,87%
Total Exterior	0,00	3.900.000,00	150.000,00	3.734.386,25	-15.613,75	-0,42%	

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

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

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

