

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

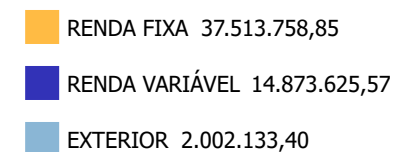
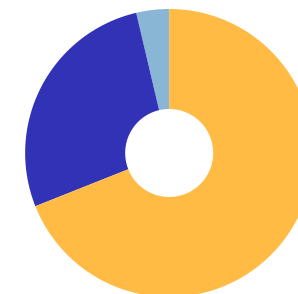
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.086.687,27	1,98%	49.084	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.286.549,27	2,35%	12.763	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	774.464,19	1,41%	18.800	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	561.026,06	1,02%	1.233	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.119.545,28	9,34%	1.032	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.113.656,47	7,50%	787	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.362.403,37	2,48%	631	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.396.200,36	2,55%	1.126	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.048.555,21	16,50%	941	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.919.437,34	5,32%	1.059	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.310.039,78	7,86%	583	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.585.465,43	2,89%	821	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.429.835,89	2,61%	868	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.536.322,26	2,80%	4.763	1,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	884.025,33	1,61%	248	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.358.545,78	2,48%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	376.448,44	0,69%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	433.406,07	0,79%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.460.506,46	2,66%	33	1,01%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	Não se ...	Não se aplica	59.315,09	0,11%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	100.215,03	0,18%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	19.835,26	0,04%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.769.531,99	3,23%	27.194	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.420.389,38	2,59%	152	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	198.882,42	0,36%	108	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.068.482,81	3,77%	4.707	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	542.004,18	0,99%	7	1,13%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	553.498,95	1,01%	469	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	437.821,65	0,80%	22.034	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.564.850,39	4,68%	230	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	944.838,54	1,72%	14	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	664.598,47	1,21%	30	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	489.944,43	0,89%	80	0,05%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	977.942,23	1,78%	146	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	534.246,74	0,97%	531	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	439.341,40	0,80%		0,23%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			54.828.859,22				

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

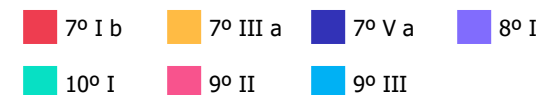
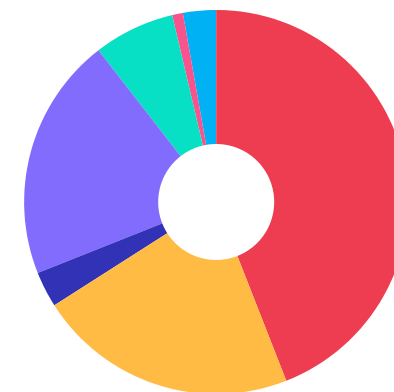
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	40,00%	21.931.543,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	23.959.798,03	43,70%	15,00%	36,00%	80,00%	19.903.289,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	11.914.088,98	21,73%	5,00%	20,00%	60,00%	20.983.226,55
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	10.965.771,84
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	1.639.871,84	2,99%	0,00%	3,00%	5,00%	1.101.571,12
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.741.442,96
Total Renda Fixa	100,00%	37.513.758,85	68,42%	20,00%	67,00%	210,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	11.164.898,78	20,36%	13,00%	20,00%	30,00%	5.283.758,99
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.708.726,79	6,76%	4,00%	7,00%	10,00%	1.774.159,13
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.741.442,96
Total Renda Variável	30,00%	14.873.625,57	27,13%	17,00%	28,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	489.944,43	0,89%	0,00%	1,00%	10,00%	4.992.941,49
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.512.188,97	2,76%	0,00%	4,00%	10,00%	3.970.696,95
Total Exterior	10,00%	2.002.133,40	3,65%	0,00%	5,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.641.252,50	43,12	0,00
CAIXA DTVM	16.182.524,55	29,51	-
ITAÚ UNIBANCO	2.978.376,17	5,43	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.919.267,27	5,32	1,64
META ASSET MANAGEMENT	2.564.850,39	4,68	0,92
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.068.482,81	3,77	0,14
TRÍGONO CAPITAL	1.609.437,01	2,94	0,04
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.536.322,26	2,80	0,02
PLURAL	492.721,16	0,90	0,01
CADENCE GESTORA	439.341,40	0,80	-
RJI CORRETORA DE VALORES	376.448,44	0,69	0,08
PETRA CAPITAL	19.835,26	0,04	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	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	23.959.798,03	43,70	15,00	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	11.914.088,98	21,73	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	1.639.871,84	2,99	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	11.164.898,78	20,36	13,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	489.944,43	0,89	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	1.512.188,97	2,76	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.708.726,79	6,76	4,00	10,00
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,11%	1,11%	4,01%	9,29%	18,11%	32,03%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,50%	0,50%	1,29%	1,55%	-0,35%	-4,92%	0,67%	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-4,15%	-4,15%	-4,53%	-9,41%	-14,21%	-27,78%	-	0,05%
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%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,08%	-0,08%	0,80%	-0,35%	-1,33%	-38,04%	0,44%	0,02%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,11%	-0,11%	-0,38%	-5,00%	-20,76%	-78,46%	0,19%	0,17%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,04%	0,04%	3,24%	2,83%	3,59%	10,54%	1,02%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-0,73%	-0,73%	2,94%	-0,91%	-1,15%	4,02%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,77%	-0,77%	2,86%	-1,09%	-1,42%	3,46%	2,02%	0,05%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,89%	0,89%	-1,01%	-3,13%	-2,96%	-5,62%	0,56%	0,02%

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
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	0,78%	2,23%	3,66%	5,27%	7,60%	0,02%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	-0,61%	-0,61%	-1,59%	-4,69%	5.044.698.071.640,00%	5.044.698.071.640,00%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,17%	-0,17%	-1,01%	-1,66%	-5,79%	-10,04%	0,01%	0,03%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	0,19%	2,51%	1,24%	1,20%	-	0,76%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,52%	0,52%	3,06%	3,87%	4,94%	7,72%	0,38%	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%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	-5,29%	-5,29%	-0,54%	5,54%	25,95%	41,47%	8,58%	0,14%
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%
IBX-50 (Benchmark)	7,65%	7,65%	9,69%	-8,20%	-0,93%	1,71%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	7,90%	7,90%	9,13%	-9,34%	-1,46%	-1,25%	8,85%	0,18%
IBX (Benchmark)	6,87%	6,87%	8,36%	-9,14%	-2,11%	-0,51%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	9,75%	9,75%	14,12%	-10,92%	-11,06%	-15,06%	11,85%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,49%	6,49%	8,64%	-2,97%	5,03%	11,07%	8,38%	0,16%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1,40%	1,40%	6,70%	-6,33%	11,05%	8,65%	8,46%	0,18%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	4,26%	4,26%	5,42%	-14,00%	-3,99%	-9,78%	14,44%	0,18%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	7,01%	7,01%	8,48%	-7,85%	-2,46%	-1,47%	8,60%	0,17%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	6,83%	6,83%	8,60%	-9,59%	-2,59%	-1,72%	9,14%	0,18%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,88%	3,88%	6,64%	-8,47%	2,09%	-9,60%	9,05%	0,17%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,12%	-3,12%	-4,37%	-13,04%	35,26%	-	14,98%	0,27%

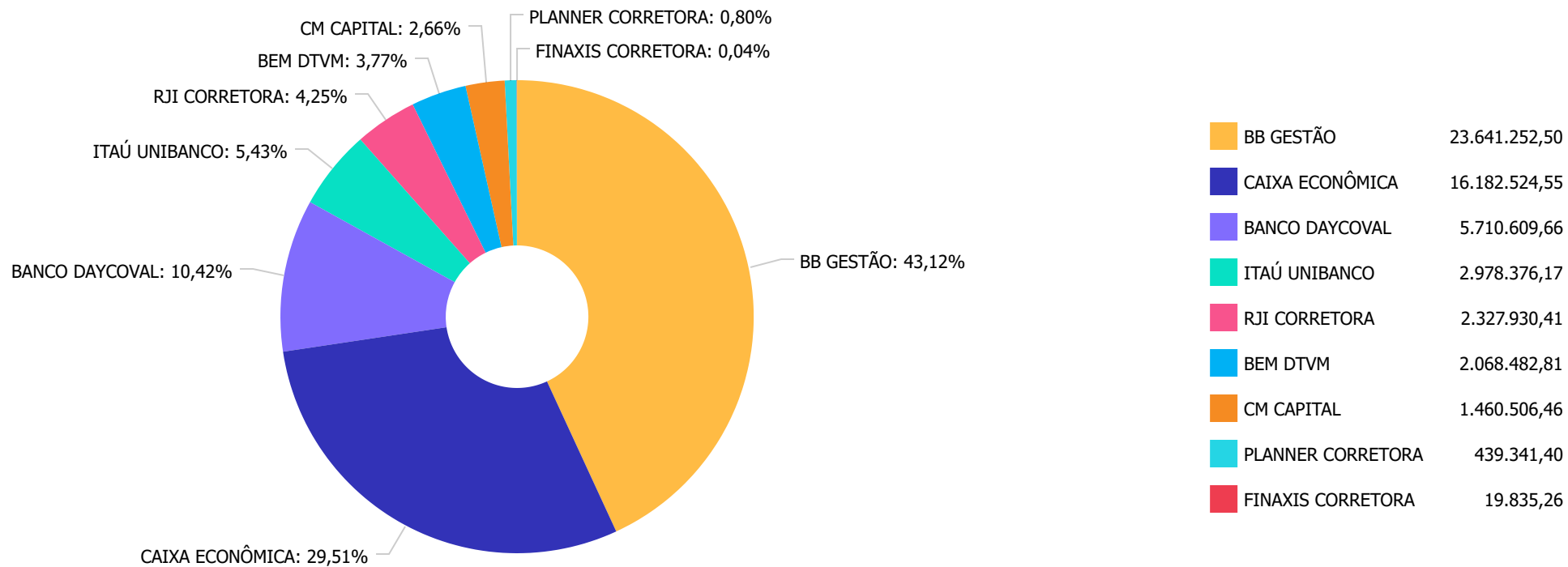
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,07%	-2,07%	-2,40%	-7,04%	-	-	13,54%	-
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,32%	1,32%	2,02%	2,41%	3,59%	7,61%	0,62%	0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,27%	1,27%	3,05%	-0,01%	2,83%	5,63%	1,39%	0,04%
MSCI ACWI (Benchmark)	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-5,30%	-5,30%	-0,53%	5,52%	25,85%	39,39%	8,59%	0,14%
IFIX (Benchmark)	-0,99%	-0,99%	3,78%	-1,67%	-3,56%	-9,76%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-0,03%	-0,03%	-0,20%	0,03%	3,35%	-53,96%	-	-

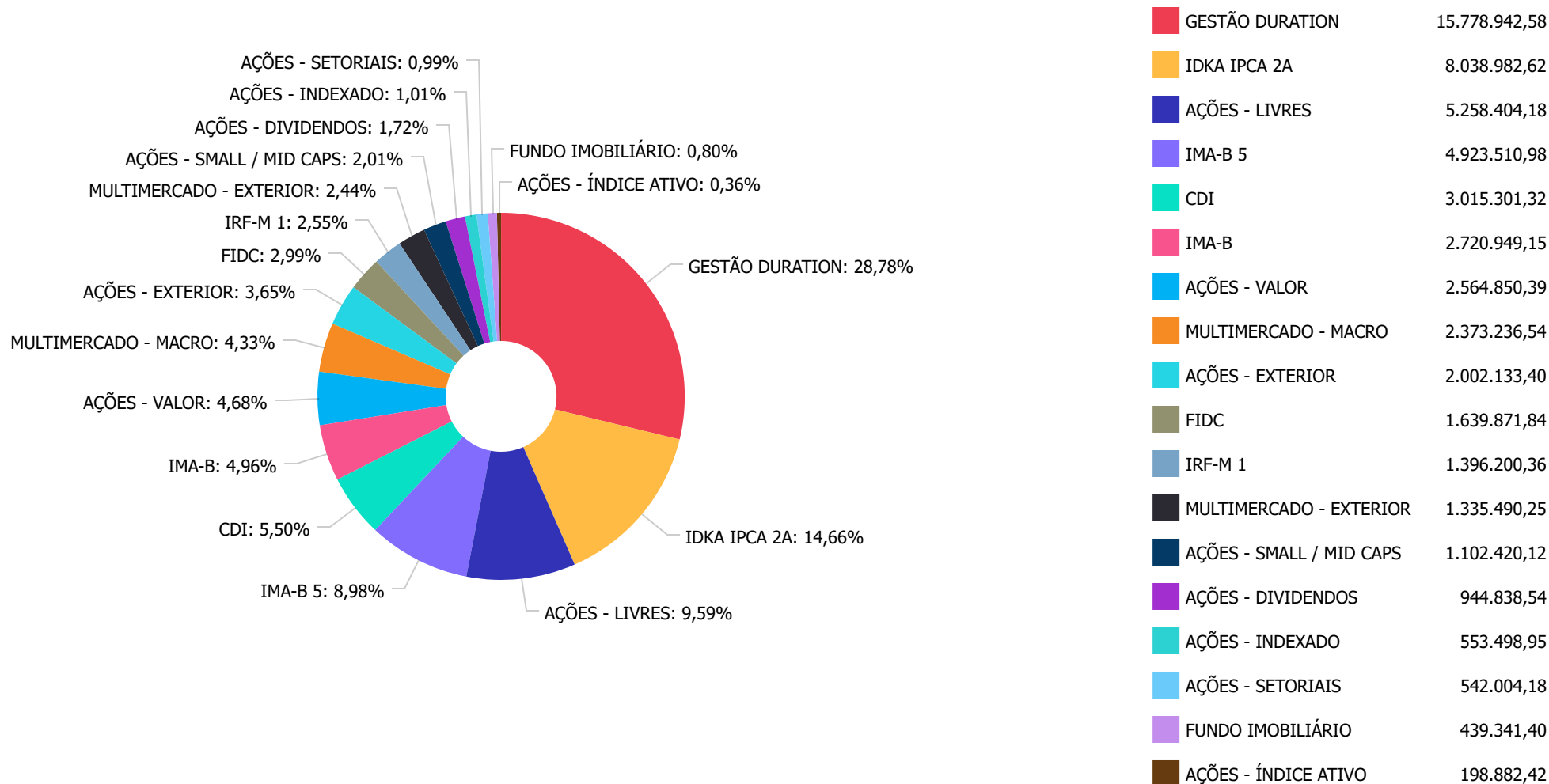
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-10,54%	-10,54%	-9,05%	4,48%	13,64%	72,99%	10,14%	0,18%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%
MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
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%

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



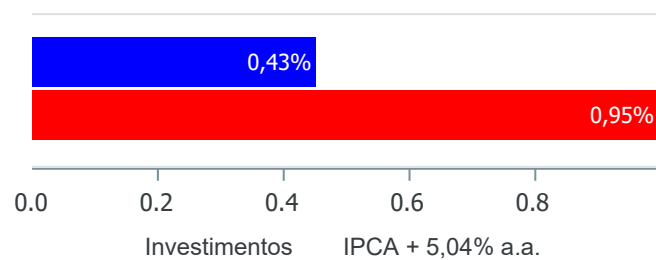
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2022)



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
Janeiro	55.168.624,82	156.267,19	731.697,17	54.828.859,22	235.664,38	235.664,38	0,43%	0,43%	0,95%	0,95%	44,83%	3,34%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



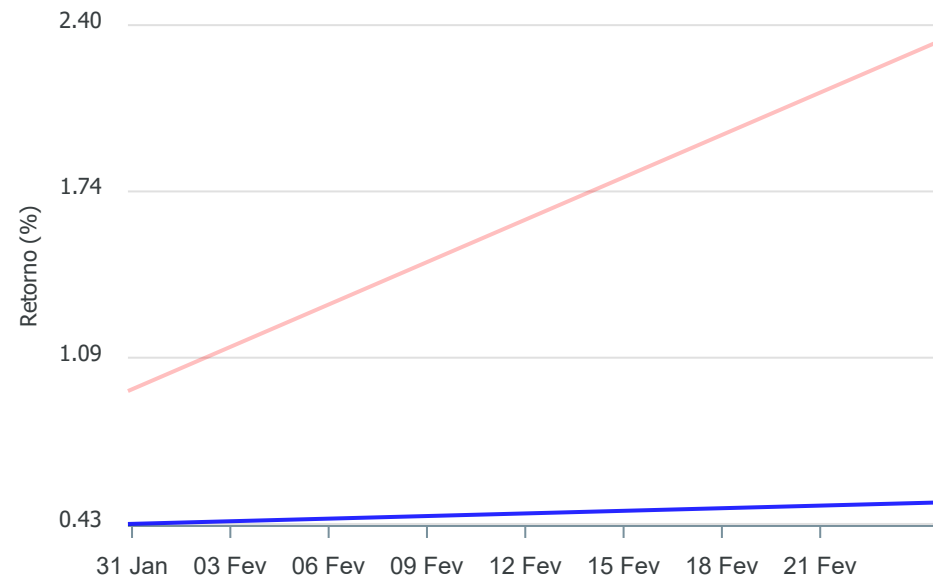
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.346.614,98	0,00	0,00	1.358.545,78	11.930,80	0,89%	0,89%	0,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.418.722,22	0,00	0,00	1.429.835,89	11.113,67	0,78%	0,78%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.988.547,06	0,00	0,00	9.048.555,21	60.008,15	0,67%	0,67%	0,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.387.679,30	0,00	0,00	1.396.200,36	8.521,06	0,61%	0,61%	0,38%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.146.885,63	156.267,19	731.697,17	1.585.465,43	14.009,78	0,61%	0,65%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	879.431,50	0,00	0,00	884.025,33	4.593,83	0,52%	0,52%	0,38%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	99.718,01	0,00	0,00	100.215,03	497,02	0,50%	0,50%	0,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.301.832,29	0,00	0,00	4.310.039,78	8.207,49	0,19%	0,19%	0,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.110.499,08	0,00	0,00	4.113.656,47	3.157,39	0,08%	0,08%	1,00%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.535.678,65	0,00	0,00	1.536.322,26	643,61	0,04%	0,04%	1,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.918.888,19	0,00	0,00	2.919.437,34	549,15	0,02%	0,02%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.119.052,24	0,00	0,00	5.119.545,28	493,04	0,01%	0,01%	1,06%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	376.759,62	0,00	0,00	376.448,44	-311,18	-0,08%	-0,08%	0,44%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	433.872,70	0,00	0,00	433.406,07	-466,63	-0,11%	-0,11%	0,19%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	19.868,59	0,00	0,00	19.835,26	-33,33	-0,17%	-0,17%	0,01%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	59.681,58	0,00	0,00	59.315,09	-366,49	-0,61%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.372.946,05	0,00	0,00	1.362.403,37	-10.542,68	-0,77%	-0,77%	2,02%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.523.803,79	0,00	0,00	1.460.506,46	-63.297,33	-4,15%	-	-
Total Renda Fixa	38.040.481,48	156.267,19	731.697,17	37.513.758,85	48.707,35	0,13%		0,71%

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
META VALOR FI AÇÕES	2.337.104,63	0,00	0,00	2.564.850,39	227.745,76	9,74%	9,74%	11,85%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	184.329,88	0,00	0,00	198.882,42	14.552,54	7,89%	7,89%	8,85%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	517.246,18	0,00	0,00	553.498,95	36.252,77	7,01%	7,01%	8,60%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	507.357,69	0,00	0,00	542.004,18	34.646,49	6,83%	6,83%	9,14%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.661.759,51	0,00	0,00	1.769.531,99	107.772,48	6,49%	6,49%	8,38%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	419.926,23	0,00	0,00	437.821,65	17.895,42	4,26%	4,26%	14,44%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.991.265,10	0,00	0,00	2.068.482,81	77.217,71	3,88%	3,88%	9,05%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.400.736,67	0,00	0,00	1.420.389,38	19.652,71	1,40%	1,40%	8,46%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.072.544,16	0,00	0,00	1.086.687,27	14.143,11	1,32%	1,32%	0,62%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.270.358,98	0,00	0,00	1.286.549,27	16.190,29	1,27%	1,27%	1,39%
OSASCO PROPERTIES FII	439.479,48	0,00	0,00	439.341,40	-138,08	-0,03%	-0,03%	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	964.774,00	0,00	0,00	944.838,54	-19.935,46	-2,07%	-2,07%	13,54%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	685.994,19	0,00	0,00	664.598,47	-21.395,72	-3,12%	-3,12%	14,98%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	592.341,83	0,00	0,00	561.026,06	-31.315,77	-5,29%	-5,29%	8,58%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	817.832,73	0,00	0,00	774.464,19	-43.368,54	-5,30%	-5,30%	8,59%
Total Renda Variável	14.863.051,26	0,00	0,00	15.312.966,97	449.915,71	3,03%		8,77%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	591.937,15	0,00	0,00	534.246,74	-57.690,41	-9,75%	-9,75%	10,47%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.093.177,06	0,00	0,00	977.942,23	-115.234,83	-10,54%	-10,54%	10,14%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	579.977,87	0,00	0,00	489.944,43	-90.033,44	-15,52%	-15,52%	9,88%
Total Exterior	2.265.092,08	0,00	0,00	2.002.133,40	-262.958,68	-11,61%		10,16%

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.