

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.778.942,60	9,37%	549	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.632.749,91	5,89%	787	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.260.959,98	3,67%	1.126	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	2.124.039,18	3,44%	113	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	245	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.374.137,59	16,82%	1.059	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	11.902.762,53	19,30%	1.021	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.015.348,25	3,27%	834	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	618.456,62	1,00%	1.237	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	4.101.701,14	6,65%	868	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.238.279,64	3,63%	110	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.720.299,37	10,89%	219	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.527.745,78	12,20%	881	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	2.387.516,50	3,87%	470	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SANTANDER PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	0,01	0,00%	2.681	0,00%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			61.682.939,11				

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	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2022** não está cadastrada !!!

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	

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	32.438.450,77	52,59	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.774.353,63	25,57	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	11.082.618,20	17,97	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.387.516,51	3,87	0,00

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)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

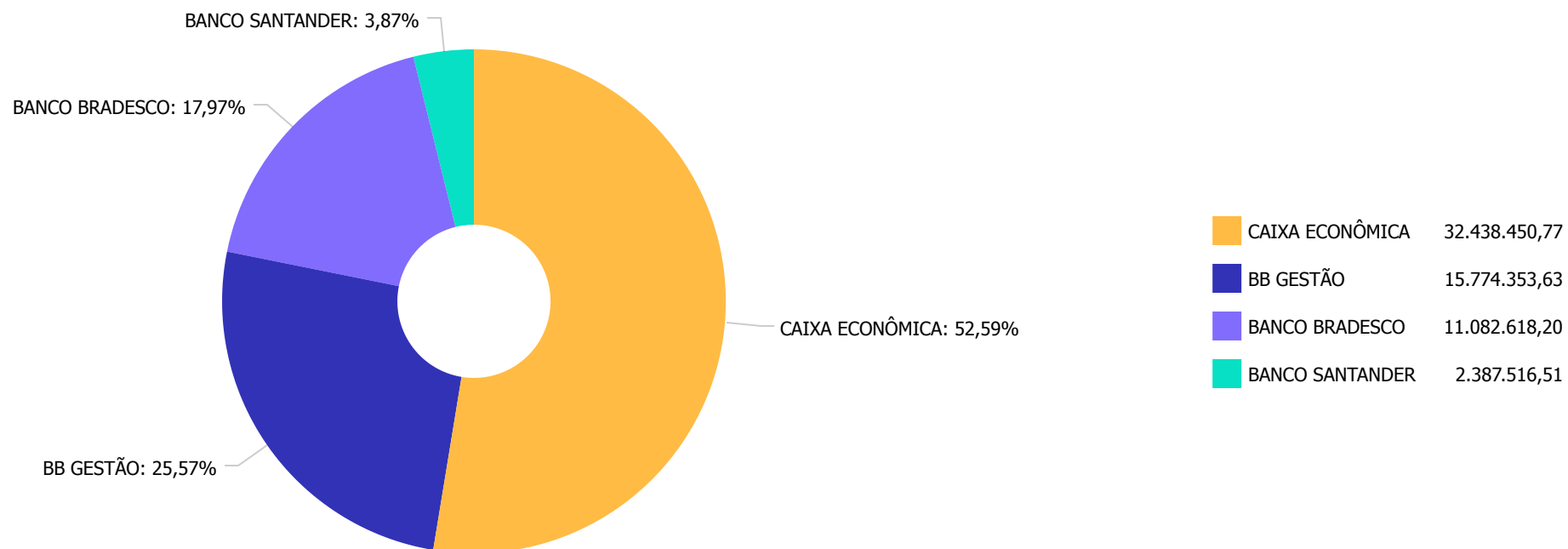
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	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%	-	-
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%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	0,61%	2,25%	2,44%	3,30%	6,63%	0,37%	0,01%
BRANCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	0,62%	2,26%	2,46%	3,26%	6,44%	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%
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%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,74%	-0,74%	2,81%	-1,28%	-2,06%	2,77%	1,93%	0,05%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,76%	-0,76%	2,86%	-1,08%	-1,50%	3,29%	2,01%	0,05%
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%

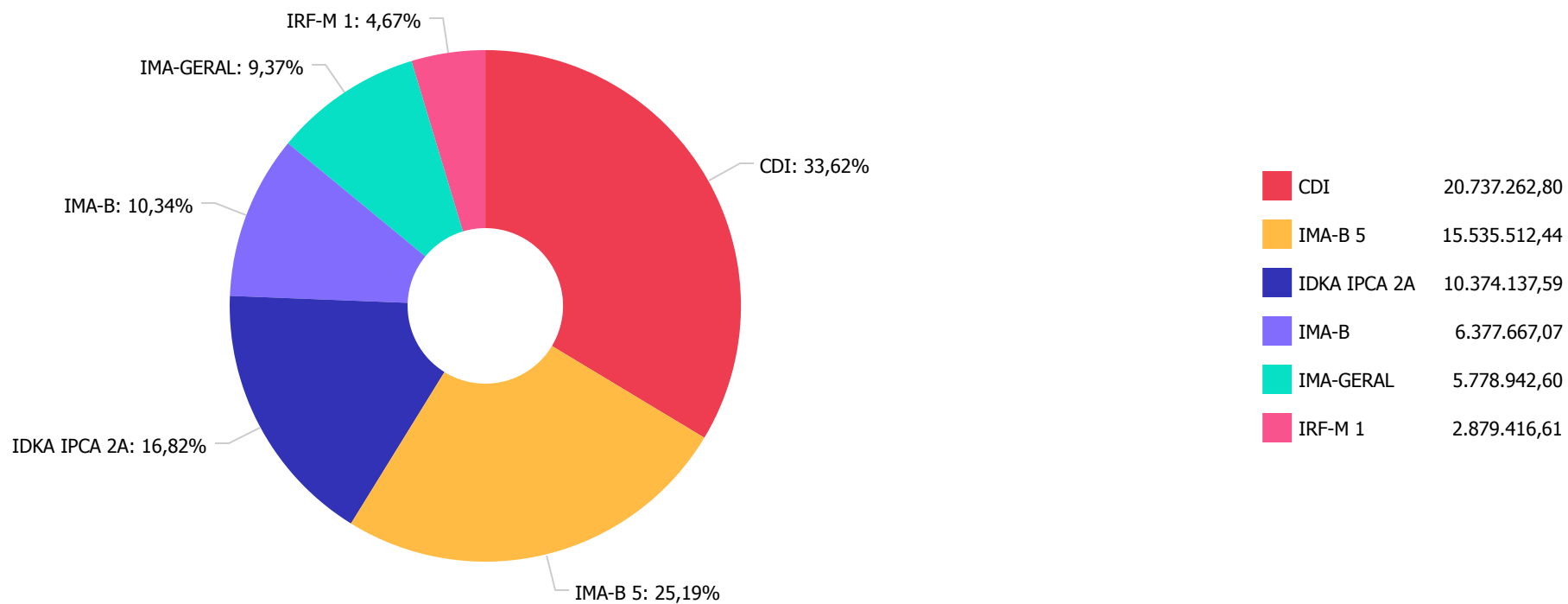
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA FIXA

	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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	0,78%	2,23%	3,66%	5,27%	7,60%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	0,79%	2,18%	3,74%	5,25%	7,57%	0,05%	0,01%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,80%	0,80%	2,25%	3,87%	5,65%	7,66%	0,03%	0,01%
SANTANDER PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,79%	0,79%	2,24%	3,84%	5,75%	8,13%	0,02%	0,01%

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
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ 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
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	2.368.657,75	0,00	0,00	2.387.516,50	18.858,75	0,80%	0,80%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.468.969,78	0,00	0,00	7.527.745,78	58.776,00	0,79%	0,79%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.089.784,36	0,00	20.000,00	4.101.701,14	31.916,78	0,78%	0,78%	0,02%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.170.057,75	0,00	505.000,00	6.720.299,37	55.241,62	0,77%	0,78%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.247.161,25	0,00	0,00	2.260.959,98	13.798,73	0,61%	0,61%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	625.152,77	0,00	10.500,00	618.456,62	3.803,85	0,61%	0,61%	0,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	11.892.014,80	0,00	0,00	11.902.762,53	10.747,73	0,09%	0,09%	0,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.629.961,64	0,00	0,00	3.632.749,91	2.788,27	0,08%	0,08%	1,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.776.748,13	0,00	0,00	5.778.942,60	2.194,47	0,04%	0,04%	1,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.372.186,27	0,00	0,00	10.374.137,59	1.951,32	0,02%	0,02%	1,11%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,62%	0,38%
SANTANDER PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,79%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.254.861,41	0,00	0,00	2.238.279,64	-16.581,77	-0,74%	-0,74%	1,93%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.030.723,61	0,00	0,00	2.015.348,25	-15.375,36	-0,76%	-0,76%	2,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	2.140.339,50	0,00	0,00	2.124.039,18	-16.300,32	-0,76%	-0,76%	2,01%
Total Renda Fixa	62.066.619,04	0,00	535.500,00	61.682.939,11	151.820,07	0,24%		0,76%

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
Total Renda Variável	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%		0,00%

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.