

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021



Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

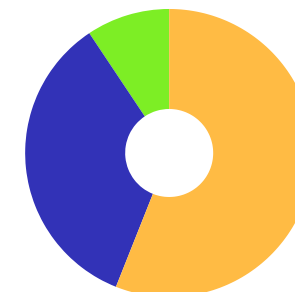
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			65.939.293,54	11,33%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	13.289.354,06	2,28%	1.035	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	14.795.005,29	2,54%	788	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	50.703.571,34	8,71%	1.060	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	65.540.196,47	11,26%	1.023	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.535.166,18	2,67%	301	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	37.294.383,40	6,41%	840	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	237,14	0,00%	1.241	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	20.366.521,45	3,50%	7.626	2,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.836.589,43	2,38%	110	1,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.133.558,36	0,88%	865	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.240.508,65	3,30%	99	3,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	717.281,82	0,12%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.000.907,80	0,52%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	0,01	0,00%	13	100,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	785.883,18	0,13%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	21.464.228,30	3,69%	2.203	2,16%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	21.073.354,37	3,62%	27.197	1,49%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.663.250,08	0,46%	150	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	20.201.869,28	3,47%	34.166	0,61%	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	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	17.802.398,71	3,06%	50	2,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.831.525,69	2,03%	106	1,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	13.076.126,28	2,25%	2.273	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	17.309.979,34	2,97%	3.970	5,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	12.089.277,19	2,08%	6.466	3,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	17.248.692,32	2,96%	19.787	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	18.197.097,09	3,13%	1.259	0,77%	Artigo 8º, Inciso III
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	1.996.577,28	0,34%	6.991	0,56%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	17.114.538,47	2,94%	64.652	0,66%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	755.513,01	0,13%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	762.315,40	0,13%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	4.741.662,03	0,81%	28	3,47%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.289.320,38	0,39%		1,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	10.682.514,44	1,83%	8.376	1,69%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	13.910.240,24	2,39%	14.033	0,99%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	16.843.061,79	2,89%	13.960	0,77%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	13.080.433,60	2,25%	529	0,34%	Artigo 9º, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	889.083,22	0,15%		0,47%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			582.201.516,63				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA 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%	65.939.293,54	11,33%	0,00%	0,50%	50,00%	225.161.464,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	217.524.435,33	37,36%	15,00%	43,50%	90,00%	306.456.929,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.110.075,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	50,00%	38.927.938,26	6,69%	2,00%	8,00%	40,00%	193.952.668,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	10,00%	3.786.790,99	0,65%	0,00%	2,00%	5,00%	25.323.284,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.110.075,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.110.075,83
Total Renda Fixa	100,00%	326.178.458,12	56,03%	17,00%	54,00%	200,00%	



REDA FIXA 326.178.458,12

REDA VARIÁVEL 201.506.808,44

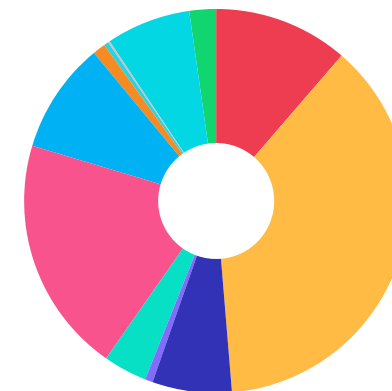
EXTERIOR 54.516.250,07

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!

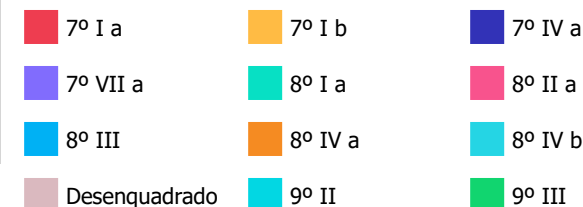


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	40,00%	21.464.228,30	3,69%	0,00%	5,00%	10,00%	36.755.923,36
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.110.075,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	116.047.780,94	19,93%	7,00%	25,00%	30,00%	58.612.674,05
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	58.220.151,66
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	54.556.905,16	9,37%	0,00%	3,00%	10,00%	3.663.246,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.259.490,44	1,08%	0,00%	2,00%	5,00%	22.850.585,39
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	2.289.320,38	0,39%	0,00%	1,00%	5,00%	26.820.755,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.110.075,83
Desenquadrado - RV	0,00%	889.083,22	0,15%	0,00%	0,00%	0,00%	-889.083,22
Total Renda Variável	40,00%	201.506.808,44	34,61%	7,00%	36,00%	80,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	41.435.816,47	7,12%	0,00%	8,00%	10,00%	16.784.335,19
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	13.080.433,60	2,25%	0,00%	2,00%	5,00%	16.029.642,23
Total Exterior	10,00%	54.516.250,07	9,36%	0,00%	10,00%	15,00%	



Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	207.199.488,89	35,59	0,66
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	70.621.942,02	12,13	0,00
ITAÚ UNIBANCO	69.471.000,71	11,93	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	65.939.293,54	11,33	-
WESTERN ASSET	37.481.059,92	6,44	0,07
XP ASSET MANAGEMENT	24.592.754,68	4,22	0,19
ITAÚ DTVM	17.802.398,71	3,06	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	17.309.979,34	2,97	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	16.843.061,79	2,89	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.836.589,43	2,38	0,00
NAVI CAPITAL	13.076.126,28	2,25	0,89
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	12.089.277,19	2,08	0,04
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.793.393,18	1,17	6,22
KPTL	4.741.662,03	0,81	1,37
SICREDI	1.996.577,28	0,34	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.517.828,41	0,26	0,30
CADENCE GESTORA	889.083,22	0,15	-
PLURAL	0,01	0,00	0,00

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 '	65.939.293,54	11,33	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	217.524.435,33	37,36	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	38.927.938,26	6,69	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	3.786.790,99	0,65	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	21.464.228,30	3,69	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	116.047.780,94	19,93	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	54.556.905,16	9,37	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.259.490,44	1,08	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.289.320,38	0,39	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	41.435.816,47	7,12	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	13.080.433,60	2,25	0,00	5,00

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%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	0,03%
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%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	17,73%	4,71%	9,78%	17,73%	31,63%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,13%	-0,81%	0,80%	1,32%	-0,81%	-5,49%	0,50%	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,21%	-7,00%	-3,16%	-6,69%	-7,00%	-28,49%	-	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-0,34%	-6,55%	0,09%	-4,11%	-6,55%	-1,41%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	-7,00%	-0,14%	-4,47%	-7,00%	-2,14%	3,55%	0,07%
120% do CDI (Benchmark)	0,92%	5,30%	2,21%	3,72%	5,30%	8,80%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-
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%	0,01%
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%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,76%	4,27%	1,94%	3,06%	4,27%	12,38%	1,04%	0,03%

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
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,81%	0,00%	1,46%	1,23%	0,00%	10,19%	1,50%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	0,22%	-1,26%	1,06%	-0,55%	-1,26%	5,06%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,16%	-2,34%	0,83%	-0,99%	-2,34%	3,82%	2,09%	0,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21%	-1,53%	1,00%	-0,70%	-1,53%	4,44%	2,16%	0,05%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,09%	-1,47%	0,38%	-0,61%	-1,47%	5,95%	2,27%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,75%	4,60%	1,89%	3,40%	4,60%	7,12%	0,04%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-1,16%	-4,08%	-2,25%	-3,94%	-4,08%	-6,22%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,65%	21,57%	5,56%	11,58%	21,57%	40,35%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,13%	1,83%	-0,37%	-0,73%	1,83%	-	-	0,04%

S&P 500 (Benchmark)	4,36%	26,89%	10,65%	10,91%	26,89%	47,52%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5,49%	32,45%	13,00%	14,27%	32,45%	48,57%	7,92%	0,11%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,51%	33,21%	13,08%	14,43%	33,21%	-	7,93%	0,11%

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,53%	19,93%	5,20%	10,81%	19,93%	36,58%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,09%	-1,05%	-0,28%	-0,52%	-1,05%	-	0,00%	0,00%

Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2,02%	-16,53%	-8,86%	-21,30%	-16,53%	-14,74%	7,56%	0,15%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	4,94%	-20,36%	-12,47%	-24,56%	-20,36%	-30,38%	9,87%	0,18%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	2,33%	-10,67%	-7,64%	-19,04%	-10,67%	-16,93%	9,64%	0,16%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,56%	-6,27%	-3,10%	-11,41%	-6,27%	6,89%	9,21%	0,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,39%	-17,09%	-13,89%	-24,60%	-17,09%	-34,69%	9,18%	0,19%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,22%	-4,70%	-5,31%	-14,24%	-4,70%	-1,48%	9,18%	0,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,97%	-8,51%	-7,99%	-18,47%	-8,51%	-12,97%	6,70%	0,14%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
----------------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---

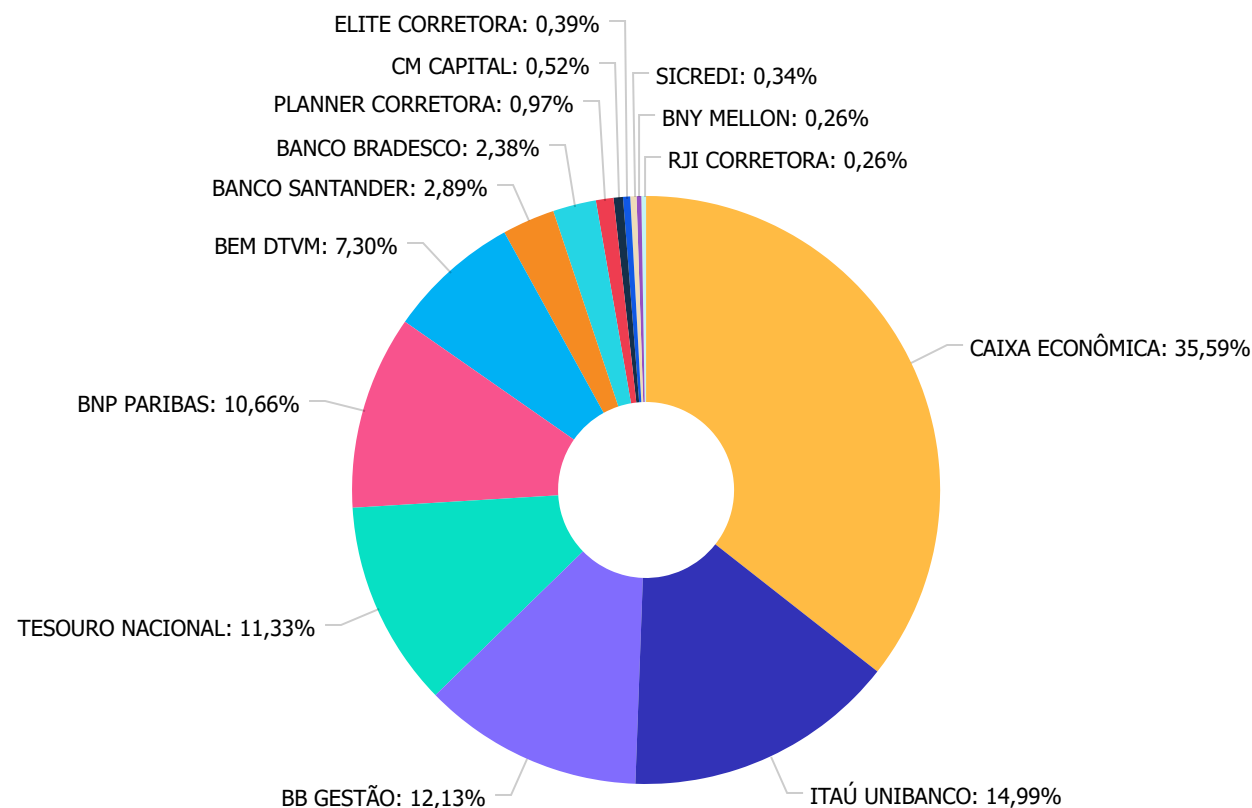
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-1,47%	-0,24%	-0,64%	-1,47%	-4,89%	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	2,36%	-1,09%	-0,95%	2,36%	-54,41%	-	-
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,11%	-1,31%	-0,34%	-0,65%	-1,31%	-	-	0,00%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56%	32,83%	13,07%	14,36%	32,83%	47,69%	7,98%	0,11%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	5,61%	-1,11%	-11,93%	5,61%	8,48%	8,04%	0,19%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3,44%	-11,53%	-6,39%	-19,00%	-11,53%	-9,52%	9,23%	0,16%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5,55%	32,74%	13,02%	14,31%	32,74%	49,91%	7,93%	0,11%

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

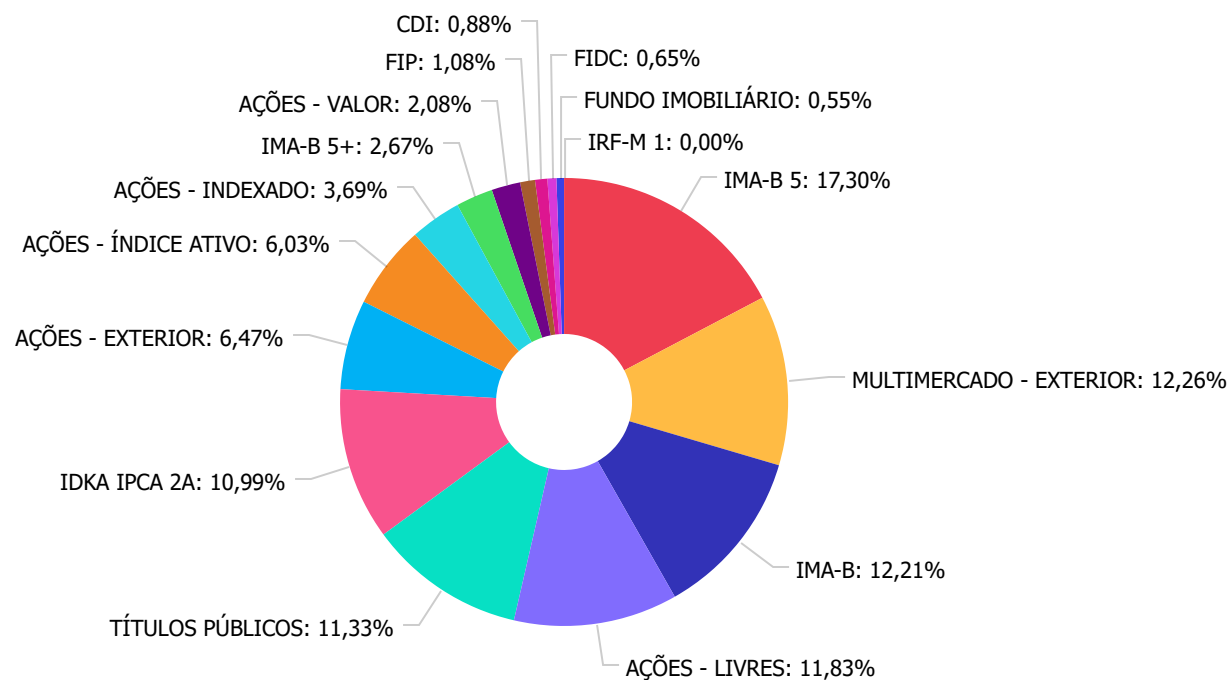
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	3,46%	29,01%	10,28%	19,49%	29,01%	89,71%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,89%	23,65%	6,63%	15,15%	23,65%	99,50%	6,65%	0,12%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	-2,60%	7,25%	1,63%	4,93%	7,25%	105,18%	9,82%	0,13%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	1,59%	14,71%	3,09%	2,29%	14,71%	63,78%	10,54%	0,14%

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



CAIXA ECONÔMICA	207.199.488,89
ITAÚ UNIBANCO	87.273.399,42
BB GESTÃO	70.621.942,02
TESOURO NACIONAL	65.939.293,54
BNP PARIBAS	62.073.814,60
BEM DTVM	42.475.382,81
BANCO SANTANDER	16.843.061,79
BANCO BRADESCO	13.836.589,43
PLANNER CORRETORA	5.630.745,25
CM CAPITAL	3.000.907,80
ELITE CORRETORA	2.289.320,38
SICREDI	1.996.577,28
BNY MELLON	1.517.828,41
RJI CORRETORA	1.503.165,01

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



IMA-B 5	100.701.723,21
MULTIMERCADO - EXTERIOR	71.399.966,95
IMA-B	71.088.763,30
AÇÕES - LIVRES	68.846.125,70
TÍTULOS PÚBLICOS	65.939.293,54
IDKA IPCA 2A	63.992.925,40
AÇÕES - EXTERIOR	37.673.188,28
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	35.112.378,05
AÇÕES - INDEXADO	21.464.228,30
IMA-B 5+	15.535.166,18
AÇÕES - VALOR	12.089.277,19
FIP	6.259.490,44
CDI	5.133.558,36
FIDC	3.786.790,99
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.178.403,60
IRF-M 1	237,14

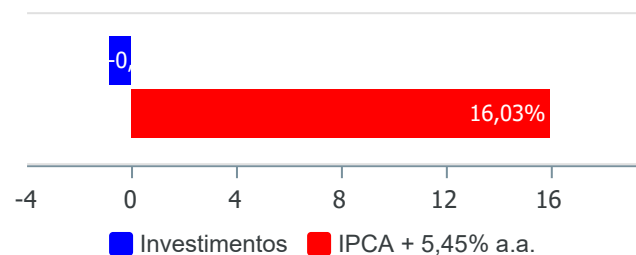
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2021)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	28/10/2021	1.449	3977,478261	4.128,008718	5.763.366,00	5.981.484,63	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	30/11/2021	1.387	4169,633376	4.128,008718	5.783.281,49	5.725.548,09	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.128,008718	1.251.083,77	1.250.786,64	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/12/2021	1.452	4200,155373	4.128,008718	6.098.625,60	5.993.868,66	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512198	4.136,597017	1.997.348,05	1.712.551,17	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	4.136,597017	34.966,87	28.956,18	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	03/08/2021	1.293	4563,054091	4.136,597017	5.900.028,94	5.348.619,94	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	13/09/2021	9.500	4428,231791	4.136,597017	42.068.202,01	39.297.671,66	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	14/09/2021	145	4428,231791	4.136,597017	642.093,61	599.806,57	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	512.952.614,29	4.945.695,25	0,00	513.893.154,64	-4.005.154,90	-4.005.154,90	-0,77%	-0,77%	0,67%	0,67%	-114,89%	4,38%
Fevereiro	513.893.154,64	6.448.247,79	1.003.800,52	513.031.226,96	-6.306.374,95	-10.311.529,85	-1,21%	-1,98%	1,24%	1,92%	-102,79%	4,20%
Março	513.031.226,96	116.168.816,36	112.295.101,39	523.370.005,29	6.465.063,36	-3.846.466,49	1,25%	-0,75%	1,42%	3,37%	-22,31%	4,86%
Abril	523.370.005,29	66.412.997,51	60.037.378,76	536.928.524,22	7.182.900,18	3.336.433,69	1,36%	0,59%	0,73%	4,13%	14,37%	3,62%
Mai	536.928.524,22	7.921.199,17	2.562.230,39	552.663.619,47	10.376.126,47	13.712.560,16	1,91%	2,52%	1,28%	5,46%	46,12%	4,22%
Junho	552.663.619,47	1.059.601,75	482.323,30	554.943.073,91	1.702.175,99	15.414.736,15	0,31%	2,83%	0,98%	6,49%	43,67%	3,31%
Julho	554.943.073,91	12.844.816,18	987.327,50	562.576.164,83	-4.224.397,76	11.190.338,39	-0,75%	2,07%	1,43%	8,01%	25,81%	4,27%
Agosto	562.576.164,83	12.180.164,49	6.448.943,08	564.403.650,41	-3.903.735,83	7.286.602,56	-0,69%	1,37%	1,34%	9,46%	14,45%	4,40%
Setembro	564.403.650,41	89.391.887,53	85.013.586,47	558.704.107,53	-10.077.843,94	-2.791.241,38	-1,77%	-0,43%	1,61%	11,22%	-3,83%	5,57%
Outubro	558.704.107,53	8.549.804,59	578.600,34	557.887.395,92	-8.787.915,86	-11.579.157,24	-1,55%	-1,97%	1,68%	13,08%	-15,09%	6,29%
Novembro	557.887.395,92	7.583.472,36	1.658.181,25	563.294.463,61	-518.223,42	-12.097.380,66	-0,09%	-2,06%	1,38%	14,64%	-14,10%	5,84%
Dezembro	563.294.463,61	16.318.861,44	4.574.376,97	582.201.516,63	7.162.568,55	-4.934.812,11	1,25%	-0,84%	1,22%	16,03%	-5,27%	4,94%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



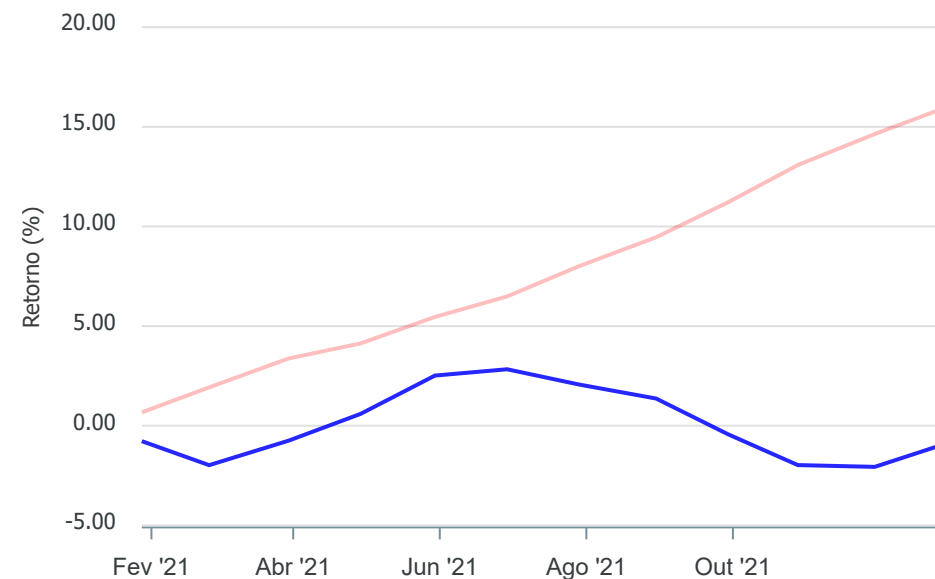
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	235,15	0,00	0,00	237,14	1,99	0,85%	0,85%	0,20%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	20.203.069,39	0,00	0,00	20.366.521,45	163.452,06	0,81%	0,81%	1,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	65.041.048,54	0,00	0,00	65.540.196,47	499.147,93	0,77%	0,77%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.683.088,31	0,00	0,00	14.795.005,29	111.916,98	0,76%	0,76%	1,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	50.341.259,63	0,00	0,00	50.703.571,34	362.311,71	0,72%	0,72%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.196.162,50	0,00	0,00	13.289.354,06	93.191,56	0,71%	0,71%	1,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.464.675,99	8.220.235,84	4.574.376,97	5.133.558,36	23.023,50	0,24%	0,75%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	37.216.473,10	0,00	0,00	37.294.383,40	77.910,30	0,21%	0,21%	2,16%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.813.884,20	0,00	0,00	13.836.589,43	22.705,23	0,16%	0,16%	2,09%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	784.880,87	0,00	0,00	785.883,18	1.002,31	0,13%	0,16%	0,50%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.224.196,54	0,00	0,00	19.240.508,65	16.312,11	0,08%	0,08%	2,27%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.007.219,70	0,00	0,00	3.000.907,80	-6.311,90	-0,21%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.588.456,73	0,00	0,00	15.535.166,18	-53.290,55	-0,34%	-0,34%	3,55%
TÍTULOS PÚBLICOS	60.362.317,82	6.098.625,60	0,00	65.939.293,54	-521.649,88	-0,78%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	725.720,72	0,00	0,00	717.281,82	-8.438,90	-1,16%	-	-
Total Renda Fixa	315.652.689,20	14.318.861,44	4.574.376,97	326.178.458,12	781.284,45	0,24%		1,53%

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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.517.701,32	0,00	0,00	2.663.250,08	145.548,76	5,78%	5,78%	8,04%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	16.339.944,49	0,00	0,00	17.248.692,32	908.747,83	5,56%	5,56%	7,98%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	17.241.091,81	0,00	0,00	18.197.097,09	956.005,28	5,54%	5,54%	7,93%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	16.223.919,81	0,00	0,00	17.114.538,47	890.618,66	5,49%	5,49%	7,92%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.520.691,01	0,00	0,00	12.089.277,19	568.586,18	4,94%	4,94%	9,87%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	20.348.303,69	0,00	0,00	21.073.354,37	725.050,68	3,56%	3,56%	9,21%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	20.750.641,34	0,00	0,00	21.464.228,30	713.586,96	3,44%	3,44%	9,23%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.668.640,06	0,00	0,00	13.076.126,28	407.486,22	3,22%	3,22%	9,18%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	16.916.304,83	0,00	0,00	17.309.979,34	393.674,51	2,33%	2,33%	9,64%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	17.473.976,88	0,00	0,00	17.802.398,71	328.421,83	1,88%	2,01%	7,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.007.593,08	0,00	0,00	20.201.869,28	194.276,20	0,97%	0,97%	6,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.785.272,97	0,00	0,00	11.831.525,69	46.252,72	0,39%	0,39%	9,18%
OSASCO PROPERTIES FII	889.083,22	0,00	0,00	889.083,22	0,00	0,00%	0,00%	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	762.961,55	0,00	0,00	762.315,40	-646,15	-0,08%	-0,08%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	756.307,23	0,00	0,00	755.513,01	-794,22	-0,11%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.748.025,94	0,00	0,00	4.741.662,03	-6.363,91	-0,13%	-	-
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.996.577,28	-3.422,72	-0,17%	5,51%	7,93%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.338.324,53	0,00	0,00	2.289.320,38	-49.004,15	-2,10%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	193.288.783,76	2.000.000,00	0,00	201.506.808,44	6.218.024,68	3,18%		8,36%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.861.443,10	0,00	0,00	13.080.433,60	218.990,50	1,70%	1,70%	8,95%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	10.515.511,92	0,00	0,00	10.682.514,44	167.002,52	1,59%	1,59%	10,54%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	16.695.009,78	0,00	0,00	16.843.061,79	148.052,01	0,89%	0,89%	6,65%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	14.281.025,85	0,00	0,00	13.910.240,24	-370.785,61	-2,60%	-2,60%	9,82%
Total Exterior	54.352.990,65	0,00	0,00	54.516.250,07	163.259,42	0,30%		8,77%

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	64.274.219,92	0,00	0,00	65.540.196,47	1.265.976,55	1,97%	1,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	49.672.923,77	124.250,95	0,00	50.703.571,34	906.396,62	1,82%	1,82%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	36.924.937,57	0,00	0,00	37.294.383,40	369.445,83	1,00%	1,00%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	20.073.016,48	0,00	0,00	20.366.521,45	293.504,97	1,46%	1,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.513.724,51	0,00	0,00	14.795.005,29	281.280,78	1,94%	1,94%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.046.649,17	0,00	0,00	13.289.354,06	242.704,89	1,86%	1,86%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.723.035,17	0,00	0,00	13.836.589,43	113.554,26	0,83%	0,83%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.168.716,84	0,00	0,00	19.240.508,65	71.791,81	0,37%	0,37%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.041.966,56	9.487.060,66	5.435.186,99	5.133.558,36	39.718,13	0,38%	1,89%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.098.706,28	0,00	124.250,95	3.000.907,80	26.452,47	0,85%	-3,16%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	779.643,49	0,00	0,00	785.883,18	6.239,69	0,80%	0,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	234,58	0,00	0,00	237,14	2,56	1,09%	1,09%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	733.810,55	0,00	0,00	717.281,82	-16.528,73	-2,25%	-2,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.557.337,91	0,00	0,00	15.535.166,18	-22.171,73	-0,14%	-0,14%
TÍTULOS PÚBLICOS	51.476.646,42	18.896.357,28	1.251.720,62	65.939.293,54	-3.181.989,54	-4,52%	-
				Total Renda Fixa	396.378,56	0,12%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	16.100.627,45	0,00	0,00	18.197.097,09	2.096.469,64	13,02%	13,02%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15.254.572,34	0,00	0,00	17.248.692,32	1.994.119,98	13,07%	13,07%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15.146.139,77	0,00	0,00	17.114.538,47	1.968.398,70	13,00%	13,00%
OSASCO PROPERTIES FII	889.083,22	0,00	0,00	889.083,22	0,00	0,00%	-1,09%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	764.420,72	0,00	0,00	762.315,40	-2.105,32	-0,28%	-0,28%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	758.118,35	0,00	0,00	755.513,01	-2.605,34	-0,34%	-0,34%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.996.577,28	-3.422,72	-0,17%	13,08%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.759.117,27	0,00	0,00	4.741.662,03	-17.455,24	-0,37%	-0,37%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.693.212,03	0,00	0,00	2.663.250,08	-29.961,95	-1,11%	-1,11%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.343.902,22	0,00	0,00	2.289.320,38	-54.581,84	-2,33%	-0,24%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	21.748.488,53	0,00	0,00	21.073.354,37	-675.134,16	-3,10%	-3,10%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.808.755,01	0,00	0,00	13.076.126,28	-732.628,73	-5,31%	-5,31%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	18.741.356,06	0,00	0,00	17.309.979,34	-1.431.376,72	-7,64%	-7,64%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	22.929.065,76	0,00	0,00	21.464.228,30	-1.464.837,46	-6,39%	-6,39%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	13.811.039,13	0,00	0,00	12.089.277,19	-1.721.761,94	-12,47%	-12,47%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	21.955.431,88	0,00	0,00	20.201.869,28	-1.753.562,60	-7,99%	-7,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	19.559.820,47	0,00	0,00	17.802.398,71	-1.757.421,76	-8,98%	-8,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	13.739.149,32	0,00	0,00	11.831.525,69	-1.907.623,63	-13,88%	-13,88%
				Total Renda Variável	-5.495.491,09	-2,65%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	11.698.677,93	0,00	0,00	13.080.433,60	1.381.755,67	11,81%	11,81%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	15.795.997,00	0,00	0,00	16.843.061,79	1.047.064,79	6,63%	6,63%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	8.434.151,43	1.944.469,50	0,00	10.682.514,44	303.893,51	2,93%	3,09%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	13.687.412,41	0,00	0,00	13.910.240,24	222.827,83	1,63%	1,63%
			Total Exterior		2.955.541,80	5,73%	

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	82.633.413,60	336.401,70	20.001.288,74	65.540.196,47	2.571.669,91	3,10%	4,31%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	33.628.167,87	15.054.240,07	185.955,35	50.703.571,34	2.207.118,75	4,53%	4,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.189.309,80	0,00	0,00	14.795.005,29	605.695,49	4,27%	4,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.699.381,58	0,00	0,00	13.289.354,06	589.972,48	4,65%	4,65%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	20.000.000,00	0,00	20.366.521,45	366.521,45	1,83%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	138,64	137.853.612,48	132.918.184,07	5.133.558,36	197.991,31	0,14%	4,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	150.054,62	1.587.358,38	1.737.517,39	237,14	341,53	0,02%	2,70%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	792.326,64	0,00	0,00	785.883,18	-6.443,46	-0,81%	-0,81%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.017.487,91	0,00	1.009.508,28	0,00	-7.979,63	-0,78%	0,53%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	747.807,26	0,00	0,00	717.281,82	-30.525,44	-4,08%	-4,08%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.351.777,31	0,00	248.501,91	3.000.907,80	-102.367,60	-3,05%	-7,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.454.325,12	0,00	15.258.873,18	0,00	-195.451,94	-1,26%	-0,40%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.527.490,53	0,00	0,00	19.240.508,65	-286.981,88	-1,47%	-1,47%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	14.167.705,73	0,00	0,00	13.836.589,43	-331.116,30	-2,34%	-2,34%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	43.362.301,18	0,00	42.692.768,40	0,00	-669.532,78	-1,54%	-0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.704.866,76	0,00	0,00	15.535.166,18	-1.169.700,58	-7,00%	-7,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	89.311.184,24	0,00	50.000.000,00	37.294.383,40	-2.016.800,84	-2,26%	-1,53%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.129.220,50	67.507.066,49	1.295.598,83	65.939.293,54	-2.401.394,62	-3,45%	-
			Total Renda Fixa		-678.984,15	-0,11%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	15.231.181,99	0,00	18.197.097,09	2.965.915,10	19,47%	32,74%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	15.000.000,00	0,00	17.248.692,32	2.248.692,32	14,99%	32,83%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	14.885.576,56	0,00	17.114.538,47	2.228.961,91	14,97%	32,45%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	4.646.501,97	0,00	62.471,83	4.741.662,03	157.631,89	3,39%	1,83%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	10.125.456,28	0,00	10.231.181,99	0,00	105.725,71	1,04%	1,44%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	21.009.539,63	0,00	21.073.354,37	63.814,74	0,30%	-6,26%
OSASCO PROPERTIES FII	860.373,70	0,00	0,00	889.083,22	28.709,52	3,34%	2,36%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.996.577,28	-3.422,72	-0,17%	33,21%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	770.362,76	0,00	0,00	762.315,40	-8.047,36	-1,04%	-1,04%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	765.525,67	0,00	0,00	755.513,01	-10.012,66	-1,31%	-1,31%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.373.223,74	0,00	0,00	2.289.320,38	-83.903,36	-3,54%	-1,47%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	2.663.250,08	-336.749,92	-11,22%	5,61%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.720.838,71	0,00	0,00	13.076.126,28	-644.712,43	-4,70%	-4,70%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	22.080.420,28	0,00	0,00	20.201.869,28	-1.878.551,00	-8,51%	-8,51%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.542.226,95	2.000.000,00	0,00	17.309.979,34	-2.232.247,61	-11,42%	-10,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	14.270.708,05	0,00	0,00	11.831.525,69	-2.439.182,36	-17,09%	-17,09%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	24.262.667,96	0,00	0,00	21.464.228,30	-2.798.439,66	-11,53%	-11,53%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	15.180.347,69	0,00	0,00	12.089.277,19	-3.091.070,50	-20,36%	-20,36%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	21.355.519,89	0,00	0,00	17.802.398,71	-3.553.121,18	-16,64%	-16,53%

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
				Total Renda Variável	-9.280.009,57	-4,40%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.591.810,40	7.320.184,47	0,00	13.080.433,60	2.168.438,73	19,87%	30,51%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	6.277.397,45	8.400.000,00	0,00	16.843.061,79	2.165.664,34	14,76%	23,65%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	0,00	10.240.402,65	0,00	10.682.514,44	442.111,79	4,32%	14,71%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	5.262.273,49	8.400.000,00	0,00	13.910.240,24	247.966,75	1,81%	7,25%
			Total Exterior		5.024.181,61	10,15%	

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 3.922/2010, 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 3.922 de 25 de novembro de 2010 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.