

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.226.281,89	3,89%	1.035	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.286.424,88	5,61%	788	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.594.859,15	1,94%	636	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.511.672,52	1,06%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.412.638,30	0,60%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.639.747,00	0,69%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	32.416.888,83	13,68%	945	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.911.866,19	7,14%	1.060	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.935.747,49	4,62%	1.023	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.801.725,22	1,18%	1.241	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	22.137.634,68	9,34%	590	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	18.516.942,24	7,82%	803	0,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.035.713,03	2,13%	193	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	172.823,70	0,07%	531	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.590.176,87	2,78%	99	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.360.016,48	1,00%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.939.565,70	1,66%	247	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	4.106.494,45	1,73%	143	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	560.317,21	0,24%	2.206	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.156.403,45	0,91%	72	0,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

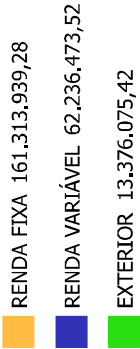
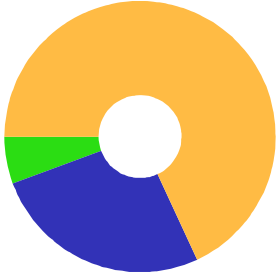
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	2.156.155,65	0,91%	48.889	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
BB AÇÕES VALOR FI AÇÕES	D+33	Não há	4.359.100,05	1,84%	2.580	0,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.852.569,96	1,20%	166	0,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.314.039,31	0,98%	4.972	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FI AÇÕES	D+25	Não há	3.214.283,72	1,36%	2.016	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÃO...	D+33	Não há	3.991.580,63	1,68%	177	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.827.029,85	0,77%	133	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.348.321,43	1,41%	4.798	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.340.542,98	0,99%	14.578	0,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.724.699,40	1,15%	34.166	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÃO...	D+24	Não há	2.423.275,76	1,02%	17	0,89%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.748.775,53	1,16%	106	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.738.823,96	1,16%	199	0,89%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	2.122.483,49	0,90%	43.922	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.455.444,38	2,30%	13.421	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	4.741.564,26	2,00%	131	0,44%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.356.561,95	0,99%	19.787	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.333.969,54	0,99%	12.762	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.457.612,28	1,46%	1.259	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	4.047.239,39	1,71%	18	5,53%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	682.400,00	0,29%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	2.266.607,11	0,96%	92	0,09%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	2.312.550,50	0,98%	82	0,18%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	1.091.261,58	0,46%	1.486	0,49%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	2.824.846,07	1,19%	143	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	2.043.581,85	0,86%	70	1,36%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.837.228,31	1,20%	529	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		7.479,13	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			236.926.488,22				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			7.479,13				Artigo 6º
PL Total			236.933.967,35				

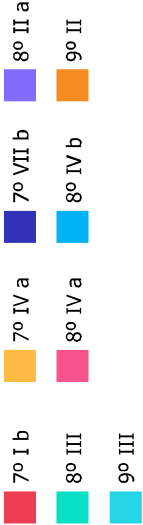
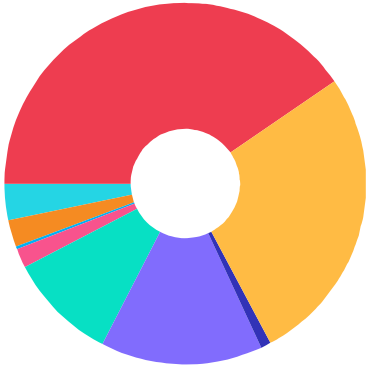
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	95.737.851,47	40,41%	10,97%	54,86%	68,57%	66.722.641,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	40,00%	63.419.684,36	26,77%	3,96%	13,80%	40,00%	31.350.910,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b '	5,00%	2.156.403,45	0,91%	0,00%	1,26%	1,26%	828.870,30
Total Renda Fixa	100,00%	161.313.939,28	68,09%	14,93%	69,92%	109,83%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '	20,00%	34.300.374,27	14,48%	3,58%	17,91%	20,00%	13.084.923,37
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	23.206.459,86	9,79%	3,14%	9,14%	10,00%	486.188,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a '	5,00%	4.047.239,39	1,71%	0,00%	1,45%	1,45%	-611.805,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b '	5,00%	682.400,00	0,29%	0,00%	0,72%	0,72%	1.023.470,72
Total Renda Variável	30,00%	62.236.473,52	26,27%	6,72%	29,22%	32,17%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	5.670.419,19	2,39%	0,00%	0,43%	5,00%	6.175.905,22
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	7.705.656,23	3,25%	0,00%	0,43%	5,00%	4.140.668,18
Total Exterior	10,00%	13.376.075,42	5,65%	0,00%	0,86%	10,00%	

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	93.410.122,65	39,43	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	90.500.940,45	38,20	0,00
ITAÚ UNIBANCO	26.487.657,92	11,18	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	12.054.348,33	5,09	0,00
AGBI REAL ASSETS	4.047.239,39	1,71	5,53
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.348.321,43	1,41	0,24
ITAÚ DTVM	2.423.275,76	1,02	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	2.340.542,98	0,99	0,03
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.314.039,31	0,98	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 - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	0,00	0,00	10,97	68,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	0,00	0,00	3,96	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b '	0,00	0,00	0,00	1,26
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a '	0,00	0,00	17,91	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a '	0,00	0,00	0,00	1,45
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	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 + 6,00% ao ano (Benchmark)								
	1,27%	16,64%	4,47%	9,25%	16,64%	29,19%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,31%	10,66%	4,63%	6,08%	10,66%	15,90%	0,18%	0,04%
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%	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	4,44%	1,53%	2,97%	4,44%	13,48%	1,02%	0,03%
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%
IMA-B (Benchmark)								
	0,22%	-1,26%	1,06%	-0,55%	-1,26%	5,06%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	-1,52%	0,97%	-0,70%	-1,52%	4,53%	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%	-	-

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,67%	3,27%	1,58%	2,49%	3,27%	4,96%	0,02%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	-0,01%	6,77%	1,82%	5,44%	6,77%	13,94%	0,90%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,46%	6,00%	2,19%	4,92%	6,00%	10,36%	0,21%	0,01%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,76%	4,34%	1,86%	3,14%	4,34%	6,92%	0,02%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	4,34%	1,90%	3,14%	4,34%	6,90%	0,04%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	6,59%	1,82%	4,30%	6,59%	14,86%	0,45%	0,02%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,85%	4,08%	2,32%	3,40%	4,08%	12,36%	1,15%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	0,54%	1,40%	0,93%	0,54%	-	0,79%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,86%	4,53%	2,16%	3,49%	4,53%	7,52%	0,23%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	-0,16%	1,52%	0,65%	-0,16%	4,50%	0,70%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	0,02%

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
S&P 500 (Benchmark)	4,36%	26,89%	10,65%	10,91%	26,89%	47,52%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,28%	30,30%	12,24%	12,99%	30,30%	-	7,90%	0,11%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5,55%	32,74%	13,02%	14,31%	32,74%	49,91%	7,93%	0,11%
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	35,38%	13,03%	23,91%	35,38%	103,09%	8,74%	0,13%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,44%	18,83%	4,96%	10,30%	18,83%	34,09%	-	-
BRASIL AGRO II FIP MULTIELSTRÉGIA	25,19%	29,26%	24,92%	25,91%	29,26%	-	0,01%	0,03%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,46%	29,01%	10,28%	19,49%	29,01%	89,71%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	4,00%	32,35%	10,14%	21,25%	32,35%	101,01%	7,32%	0,13%
IDIV (Benchmark)	1,60%	-6,41%	-1,83%	-8,30%	-6,41%	-7,35%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,32%	-10,50%	-3,49%	-13,76%	-10,50%	-7,77%	8,21%	0,14%
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,69%	-31,79%	-19,45%	-34,71%	-31,79%	-26,41%	10,40%	0,17%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,08%	-4,76%	-2,54%	-8,88%	-4,76%	0,93%	9,34%	0,16%

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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,97%	-8,51%	-7,99%	-18,47%	-8,51%	-12,97%	6,70%	0,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,39%	-17,09%	-13,89%	-24,60%	-17,09%	-34,69%	9,18%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	0,81%	-20,98%	-12,77%	-25,33%	-20,98%	-15,30%	7,14%	0,16%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2,00%	-17,61%	-8,61%	-22,08%	-17,61%	-20,64%	10,24%	0,16%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,14%	-5,60%	-4,45%	-15,53%	-5,60%	-11,48%	8,05%	0,17%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	0,06%	-15,22%	-6,16%	-19,71%	-15,22%	-13,20%	9,02%	0,15%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1,91%	-16,56%	-7,39%	-19,01%	-16,56%	-15,69%	8,35%	0,13%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2,19%	-15,47%	-10,34%	-21,61%	-15,47%	-14,48%	9,07%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,17%	3,54%	1,92%	2,25%	3,54%	5,62%	0,65%	0,01%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	5,48%	32,02%	12,86%	13,99%	32,02%	49,55%	7,88%	0,11%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,27%	-0,83%	-0,10%	-3,05%	-0,83%	1,68%	2,65%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	2,36%	0,91%	-0,98%	2,36%	5,50%	2,21%	0,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	1,44%	0,85%	-1,63%	1,44%	5,01%	1,69%	0,03%
MSCI ACWI (Benchmark)	3,17%	25,42%	9,15%	16,96%	25,42%	84,89%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5,56%	32,83%	13,07%	14,36%	32,83%	47,69%	7,98%	0,11%
IFIX (Benchmark)	8,78%	-2,28%	3,28%	1,81%	-2,28%	-12,28%	-	-



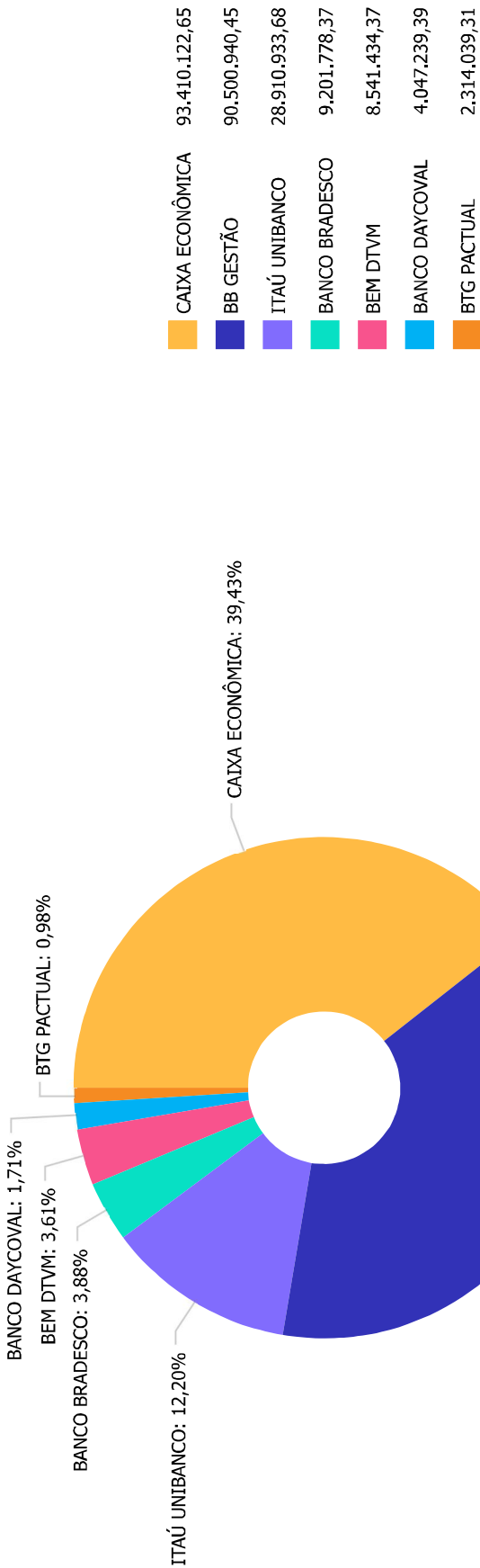
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,35%	-50,14%	-5,25%	-18,54%	-50,14%	-54,20%	8,41%	0,21%

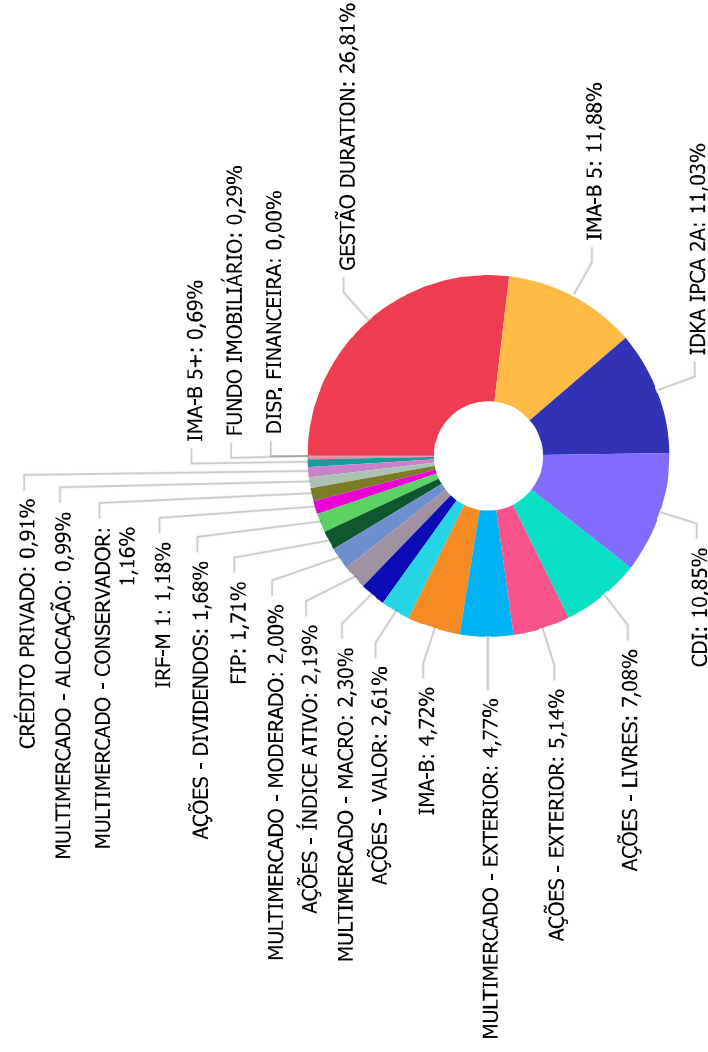
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,99%	33,49%	12,49%	23,02%	33,49%	99,34%	8,37%	0,13%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	35,38%	13,03%	23,91%	35,38%	103,09%	8,74%	0,13%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,70%	30,51%	11,81%	20,44%	30,51%	101,98%	8,95%	0,14%
MSCI WORLD (Benchmark)	3,46%	29,01%	10,28%	19,49%	29,01%	89,71%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	4,00%	32,35%	10,14%	21,25%	32,35%	101,01%	7,32%	0,13%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	1,25%	32,87%	11,07%	23,60%	32,87%	119,47%	7,03%	0,13%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-1,46%	11,65%	4,08%	8,37%	11,65%	-	7,16%	0,12%

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



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

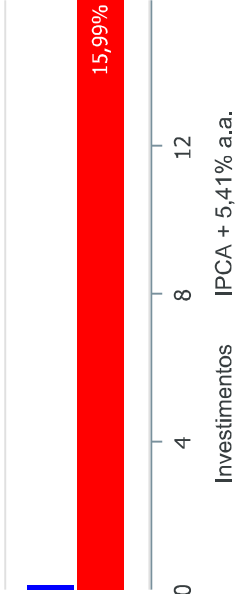


GESTÃO DURATION	63.529,802,24
IMA-B 5	28.146,483,19
IDKA IPCA 2A	26.138,148,08
CDI	25.716,594,08
AÇÕES - LIVRES	16.773,395,15
AÇÕES - EXTERIOR	12.174,362,38
MULTIMERCADO - EXTERIOR	11.294,526,41
IMA-B	11.185,036,02
AÇÕES - VALOR	6.186,129,90
MULTIMERCADO - MACRO	5.455,444,38
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.193,112,94
MULTIMERCADO - MODERADO	4.741,564,26
FIP	4.047,239,39
AÇÕES - DIVIDENDOS	3.991,580,63
IRF-M 1	2.801,725,22
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.738,823,96
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.333,969,54
CRÉDITO PRIVADO	2.156,403,45
IMA-B 5+	1.639,747,00

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

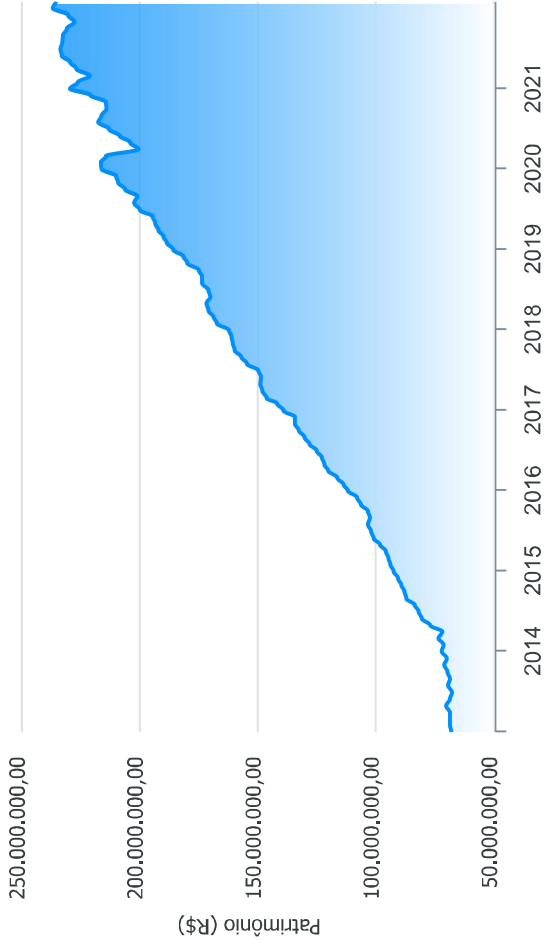
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	226.901.548,33	205.063,27	1.394.306,30	223.875.628,40	-1.836.676,90	-1.836.676,90	-0,81%	-0,81%	0,67%	0,67%	-120,80%	3,22%
Fevereiro	223.875.628,40	2.124.289,00	4.822.101,58	218.469.134,25	-2.708.681,57	-4.545.358,47	-1,21%	-2,01%	1,24%	1,92%	-104,74%	3,18%
Março	218.469.134,25	8.109.492,88	4.484.621,64	224.436.478,04	2.342.472,55	-2.202.885,92	1,05%	-0,98%	1,42%	3,36%	-29,03%	3,39%
Abril	224.436.478,04	7.141.885,48	7.112.710,49	226.958.805,29	2.493.152,26	290.266,34	1,11%	0,12%	0,73%	4,12%	3,01%	2,22%
Mai	226.958.805,29	12.562.129,02	12.428.721,17	230.540.820,42	3.448.607,28	3.738.873,62	1,52%	1,64%	1,27%	5,44%	30,21%	2,53%
Junho	230.540.820,42	1.843.375,41	1.204.654,47	231.030.304,28	-149.237,08	3.589.636,54	-0,06%	1,58%	0,97%	6,47%	24,40%	2,14%
Julho	231.030.304,28	5.867.640,35	6.856.491,49	228.449.153,85	-1.592.299,29	1.997.337,25	-0,69%	0,88%	1,43%	7,99%	11,00%	2,77%
Agosto	228.449.153,85	4.264.813,01	1.539.166,83	229.465.778,42	-1.709.021,61	288.315,64	-0,74%	0,13%	1,34%	9,43%	1,41%	2,85%
Setembro	229.465.778,42	1.905.555,62	1.231.334,71	228.411.960,11	-1.728.039,22	-1.439.723,58	-0,75%	-0,62%	1,61%	11,18%	-5,53%	3,04%
Outubro	228.411.960,11	19.021.211,64	18.636.904,43	225.068.759,95	-3.727.507,37	-5.167.230,95	-1,63%	-2,24%	1,67%	13,05%	-17,16%	3,97%
Novembro	225.068.759,95	9.532.330,39	8.856.752,54	227.811.047,50	2.066.709,70	-3.100.521,25	0,92%	-1,34%	1,37%	14,60%	-9,20%	3,16%
Dezembro	227.811.047,50	4.963.733,96	1.748.361,63	234.424.707,43	3.398.287,60	297.766,35	1,47%	0,11%	1,22%	15,99%	0,68%	2,61%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

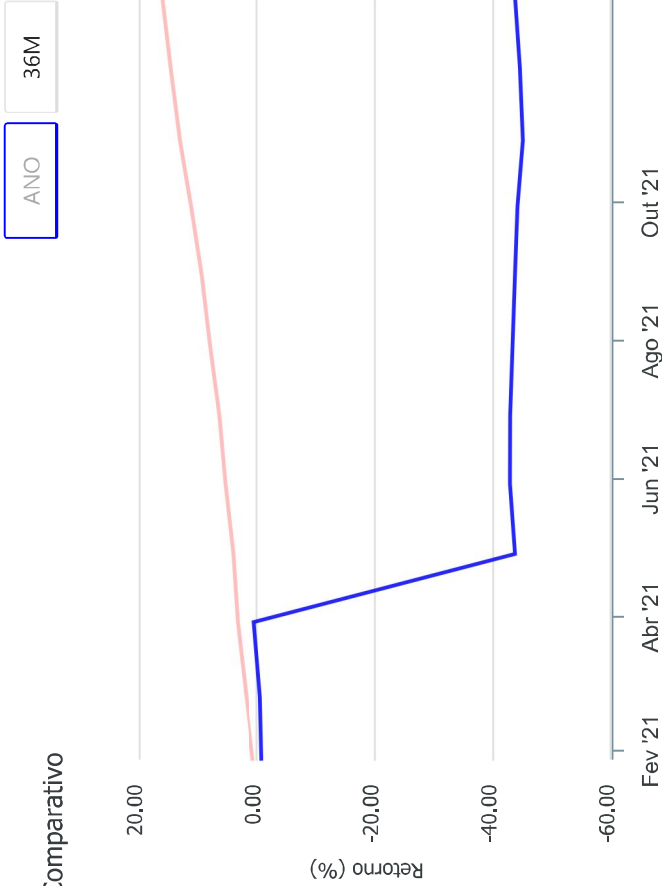


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- ☐ Investimentos
- ☐ IMA-B 5
- ☐ IMA-B 5+
- ☐ IRF-M 1+
- ☐ Meta de Rentabilidade
- ☐ IMA-B
- ☐ IMA Geral
- ☐ Ibovespa
- ☐ CDI
- ☐ IRF-M
- ☐ SMLL
- ☐ IDIV
- ☐ IRF-M 1

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 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.618.487,00	0,00	0,00	1.639.747,00	21.260,00	1,31%	1,31%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.905.944,12	0,00	0,00	3.939.565,70	33.621,58	0,86%	0,86%	0,23%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.138.158,52	0,00	0,00	2.156.403,45	18.244,93	0,85%	0,85%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.778.151,21	0,00	0,00	2.801.725,22	23.574,01	0,85%	0,85%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.151.419,20	0,00	0,00	32.416.888,83	265.469,63	0,83%	0,83%	0,23%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.996.599,01	0,00	0,00	5.035.713,03	39.114,02	0,78%	0,78%	0,70%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	171.491,24	0,00	0,00	172.823,70	1.332,46	0,78%	0,78%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.852.461,88	0,00	0,00	10.935.747,49	83.285,61	0,77%	0,77%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.185.919,57	0,00	0,00	13.286.424,88	100.505,31	0,76%	0,76%	1,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	21.970.410,50	0,00	0,00	22.137.634,68	167.224,18	0,76%	0,76%	0,79%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	560.024,77	0,00	3.919,68	560.317,21	4.212,12	0,75%	0,76%	0,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.791.019,33	0,00	0,00	16.911.866,19	120.846,86	0,72%	0,72%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.161.582,61	0,00	0,00	9.226.281,89	64.699,28	0,71%	0,71%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.404.436,43	0,00	0,00	1.412.638,30	8.201,87	0,58%	0,58%	0,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	15.218.519,34	5.178.489,72	1.996.401,19	18.516.942,24	116.334,37	0,57%	0,67%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.497.835,57	0,00	0,00	2.511.672,52	13.836,95	0,55%	0,55%	1,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	4.087.609,76	0,00	0,00	4.106.494,45	18.884,69	0,46%	0,46%	0,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.585.532,88	0,00	0,00	4.594.859,15	9.326,27	0,20%	0,20%	2,16%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.584.589,72	0,00	0,00	6.590.176,87	5.587,15	0,08%	0,08%	2,27%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.360.148,89	0,00	0,00	2.360.016,48	-132,41	-0,01%	-0,01%	0,90%

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
Total Renda Fixa	157.020.341,55	5.178.489,72	2.000.320,87	161.313.939,28	1.115.428,88	0,70%		0,73%

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
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	3.232.996,69	0,00	0,00	4.047.239,39	814.242,70	25,19%	-0,14%	0,01%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.232.406,42	0,00	0,00	2.356.561,95	124.155,53	5,56%	5,56%	7,98%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.275.962,67	0,00	0,00	3.457.612,28	181.649,61	5,54%	5,54%	7,93%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.012.289,88	0,00	0,00	2.122.483,49	110.193,61	5,48%	5,48%	7,88%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	2.048.104,77	0,00	0,00	2.156.155,65	108.050,88	5,28%	5,28%	7,90%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.188.351,47	0,00	0,00	4.359.100,05	170.748,58	4,08%	4,08%	9,34%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.246.459,37	0,00	0,00	3.348.321,43	101.862,06	3,14%	3,14%	8,05%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.145.391,93	0,00	0,00	3.214.283,72	68.891,79	2,19%	2,19%	9,07%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.796.519,37	0,00	0,00	2.852.569,96	56.050,59	2,00%	2,00%	10,24%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.296.732,80	0,00	0,00	2.340.542,98	43.810,18	1,91%	1,91%	8,35%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.378.309,57	0,00	0,00	5.455.444,38	77.134,81	1,43%	1,43%	1,69%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	4.674.773,99	0,00	0,00	4.741.564,26	66.790,27	1,43%	1,43%	2,21%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.304.632,68	0,00	0,00	2.333.969,54	29.336,86	1,27%	1,27%	2,65%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.707.146,69	0,00	0,00	2.738.823,96	31.677,27	1,17%	1,17%	0,65%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.698.496,66	0,00	0,00	2.724.699,40	26.202,74	0,97%	0,97%	6,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	2.403.689,64	0,00	0,00	2.423.275,76	19.586,12	0,81%	0,81%	7,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.738.029,80	0,00	0,00	2.748.775,53	10.745,73	0,39%	0,39%	9,18%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	680.000,00	0,00	0,00	682.400,00	2.400,00	0,35%	0,35%	8,41%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.825.970,12	0,00	0,00	1.827.029,85	1.059,73	0,06%	0,06%	9,02%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.004.560,41	0,00	0,00	3.991.580,63	-12.979,78	-0,32%	-0,32%	8,21%

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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.330.009,22	0,00	0,00	2.314.039,31	-15.969,91	-0,69%	-0,69%	10,40%
Total Renda Variável	60.220.834,15	0,00	0,00	62.236.473,52	2.015.639,37	3,35%		6,32%

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 GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.179.521,95	0,00	0,00	2.266.607,11	87.085,16	4,00%	4,00%	7,32%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.742.794,53	0,00	0,00	2.824.846,07	82.051,54	2,99%	2,99%	8,37%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.985.936,96	0,00	0,00	2.043.581,85	57.644,89	2,90%	2,90%	8,74%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.789.727,89	0,00	0,00	2.837.228,31	47.500,42	1,70%	1,70%	8,95%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	2.284.102,03	0,00	0,00	2.312.550,50	28.448,47	1,25%	1,25%	7,03%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	1.107.371,03	0,00	0,00	1.091.261,58	-16.109,45	-1,45%	-1,45%	7,16%
Total Exterior	13.089.454,39	0,00	0,00	13.376.075,42	286.621,03	2,19%		8,04%

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.074,851,31	0,00	0,00	32.416.888,83	342.037,52	1,07%	1,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	21.832.602,87	0,00	0,00	22.137.634,68	305.031,81	1,40%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.609.526,60	0,00	0,00	16.911.866,19	302.339,59	1,82%	1,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.033.825,04	0,00	0,00	13.286.424,88	252.599,84	1,94%	1,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.695.931,72	0,00	6.000.000,00	10.935.747,49	239.815,77	1,44%	1,97%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.901.075,40	17.517.303,55	7.117.250,15	18.516.942,24	215.813,44	0,85%	1,58%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.033.976,90	0,00	6.000.000,00	9.226.281,89	192.304,99	1,28%	1,86%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.856.433,67	0,00	0,00	3.939.565,70	83.132,03	2,16%	2,16%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.960.445,18	0,00	0,00	5.035.713,03	75.267,85	1,52%	1,52%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.567.237,00	0,00	0,00	1.639.747,00	72.510,00	4,63%	4,63%
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.038.981,70	3.000.000,00	0,00	4.106.494,45	67.512,75	1,67%	2,19%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.107.497,72	0,00	0,00	2.156.403,45	48.905,73	2,32%	2,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.550.525,40	0,00	0,00	4.594.859,15	44.333,75	0,97%	0,97%
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.317.775,04	0,00	0,00	2.360.016,48	42.241,44	1,82%	1,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.543.048,88	0,00	69.428,93	2.511.672,52	38.052,57	1,50%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.764.541,44	0,00	3.000.000,00	2.801.725,22	37.183,78	0,65%	1,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.387.326,92	0,00	0,00	1.412.638,30	25.311,38	1,82%	1,82%
ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.565.587,05	0,00	0,00	6.590.176,87	24.589,82	0,37%	0,37%
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	557.845,60	0,00	7.839,36	560.317,21	10.310,97	1,85%	1,86%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	169.595,82	0,00	0,00	172.823,70	3.227,88	1,90%	1,90%

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	142.722,27	20.051,20	155.294,34	7.479,13	0,00	0,00%	-
			Total Renda Fixa		2.422.522,91	1,34%	

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
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	3.239.901,18	0,00	0,00	4.047.239,39	807.338,21	24,92%	24,92%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.182.022,35	2.000.000,00	0,00	3.457.612,28	275.589,93	8,66%	13,02%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.156.155,65	156.155,65	7,81%	12,24%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	714.294,79	1.500.000,00	0,00	2.356.561,95	142.267,16	6,42%	13,07%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.122.483,49	122.483,49	6,12%	12,86%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.687.223,79	0,00	0,00	2.738.823,96	51.600,17	1,92%	1,92%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.409.685,63	0,00	0,00	5.455.444,38	45.758,75	0,85%	0,85%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.208.969,93	0,00	1.500.000,00	4.741.564,26	32.594,33	0,52%	0,91%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.336.329,51	0,00	0,00	2.333.969,54	-2.359,97	-0,10%	-0,10%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	720.200,00	0,00	0,00	682.400,00	-37.800,00	-5,25%	-5,25%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.946.985,56	0,00	0,00	1.827.029,85	-119.955,71	-6,16%	-6,16%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.135.895,27	0,00	0,00	3.991.580,63	-144.314,64	-3,49%	-3,49%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.504.185,42	0,00	0,00	3.348.321,43	-155.863,99	-4,45%	-4,45%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.527.278,96	0,00	0,00	2.340.542,98	-186.735,98	-7,39%	-7,39%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.961.208,75	0,00	0,00	2.724.699,40	-236.509,35	-7,99%	-7,99%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	3.121.448,89	0,00	0,00	2.852.569,96	-268.878,93	-8,61%	-8,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	2.777.795,61	0,00	0,00	2.423.275,76	-354.519,85	-12,76%	-12,77%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.717.169,87	0,00	6.000.000,00	4.359.100,05	-358.069,82	-3,34%	-2,54%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.584.913,23	0,00	0,00	3.214.283,72	-370.629,51	-10,34%	-10,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.191.966,82	0,00	0,00	2.748.775,53	-443.191,29	-13,88%	-13,88%

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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.872.659,08	0,00	0,00	2.314.039,31	-558.619,77	-19,45%	-19,45%
			Total Renda Variável		-1.603.661,12	-2,25%	

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
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	2.082.119,86	0,00	0,00	2.312.550,50	230.430,64	11,07%	11,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	613.096,95	2.000.000,00	0,00	2.837.228,31	224.131,36	8,58%	11,81%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.057.893,46	0,00	0,00	2.266.607,11	208.713,65	10,14%	10,14%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	620.390,90	2.000.000,00	0,00	2.824.846,07	204.455,17	7,80%	12,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.000.000,00	0,00	2.043.581,85	43.581,85	2,18%	13,03%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	1.048.458,03	0,00	0,00	1.091.261,58	42.803,55	4,08%	4,08%
			Total Exterior		954.116,22	7,68%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.158.528,14	0,00	0,00	16.911.866,19	753.338,05	4,66%	4,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.618.853,20	0,00	6.300.000,00	10.935.747,49	616.894,29	3,71%	4,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.633.811,85	0,00	6.000.000,00	9.226.281,89	592.470,04	4,05%	4,65%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.742.489,44	0,00	0,00	13.286.424,88	543.935,44	4,27%	4,27%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	4.767.007,86	45.360.118,70	31.937.460,92	18.516.942,24	327.276,60	0,65%	3,27%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.481.842,00	0,00	87.253,35	1.639.747,00	245.158,35	16,54%	10,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	10.777.947,78	11.133.714,14	0,00	22.137.634,68	225.972,76	1,03%	0,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	6.763.052,07	0,00	3.000.000,00	3.939.565,70	176.513,63	2,61%	4,53%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	2.210.394,40	0,00	0,00	2.360.016,48	149.622,08	6,77%	6,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.674.174,34	0,00	3.000.000,00	2.801.725,22	127.550,88	2,25%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.537.250,62	0,00	135.250,42	2.511.672,52	109.672,32	4,32%	4,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.001.616,82	3.000.000,00	0,00	4.106.494,45	104.877,63	2,62%	6,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.397.047,20	0,00	73.071,87	1.412.638,30	88.662,97	6,35%	6,59%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.071.963,25	0,00	0,00	2.156.403,45	84.440,20	4,08%	4,08%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	40.654,14	3.619.945,21	3.695.739,83	7.479,13	42.619,61	1,16%	-
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	569.942,09	2.672,69	36.047,29	560.317,21	23.749,72	4,15%	4,34%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	165.637,37	0,00	0,00	172.823,70	7.186,33	4,34%	4,34%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	749.952,80	0,00	755.604,80	0,00	5.652,00	0,75%	2,37%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.043.544,36	0,00	0,00	5.035.713,03	-7.831,33	-0,16%	-0,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	32.452.247,64	0,00	0,00	32.416.888,83	-35.358,81	-0,11%	-0,11%

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 ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.625.014,68	0,00	6.533.578,07	0,00	-91.436,61	-1,38%	-0,40%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	6.688.472,68	0,00	0,00	6.590.176,87	-98.295,81	-1,47%	-1,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.738.385,81	0,00	4.000.000,00	4.594.859,15	-143.526,66	-1,64%	-1,51%
			Total Renda Fixa		3.849.143,68	1,73%	

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
BRASIL AGRO II FIP MULTISTRATÉGIA	3.231.206,39	0,00	0,00	4.047.239,39	816.033,00	25,25%	29,26%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	3.200.000,00	0,00	3.457.612,28	257.612,28	8,05%	32,74%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,00	2.200.000,00	0,00	2.356.561,95	156.561,95	7,12%	32,83%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.156.155,65	156.155,65	7,81%	30,30%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	6.102.065,95	0,00	3.500.000,00	2.738.823,96	136.758,01	2,24%	3,54%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.019.149,02	0,00	1.700.000,00	5.455.444,38	136.295,36	1,94%	1,44%
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.122.483,49	122.483,49	6,12%	32,02%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.121.094,16	0,00	1.500.000,00	4.741.564,26	120.470,10	1,97%	2,36%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.353.380,98	0,00	0,00	2.333.969,54	-19.411,44	-0,82%	-0,82%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.059.365,98	500.000,00	0,00	3.348.321,43	-211.044,55	-5,93%	-5,60%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.978.066,40	0,00	0,00	2.724.699,40	-253.367,00	-8,51%	-8,51%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.154.910,75	0,00	0,00	1.827.029,85	-327.880,90	-15,22%	-15,22%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.804.973,65	0,00	0,00	2.340.542,98	-464.430,67	-16,56%	-16,56%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.459.850,93	0,00	0,00	3.991.580,63	-468.270,30	-10,50%	-10,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.315.461,93	0,00	0,00	2.748.775,53	-566.686,40	-17,09%	-17,09%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.802.549,53	0,00	0,00	3.214.283,72	-588.265,81	-15,47%	-15,47%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.966.773,51	0,00	6.000.000,00	4.359.100,05	-607.673,46	-5,54%	-4,76%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	3.462.251,29	0,00	0,00	2.852.569,96	-609.681,33	-17,61%	-17,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	3.066.318,24	0,00	0,00	2.423.275,76	-643.042,48	-20,97%	-20,97%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.368.500,00	0,00	0,00	682.400,00	-686.100,00	-50,14%	-50,14%

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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.392.367,47	0,00	0,00	2.314.039,31	-1.078.328,16	-31,79%	-31,79%
			Total Renda Variável		-4.621.812,66	-5,81%	

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 NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.312.550,50	312.550,50	15,63%	32,87%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.266.607,11	266.607,11	13,33%	32,35%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.600.000,00	0,00	2.837.228,31	237.228,31	9,12%	30,51%
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.600.000,00	0,00	2.824.846,07	224.846,07	8,65%	33,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	2.000.000,00	0,00	2.043.581,85	43.581,85	2,18%	35,38%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	0,00	1.055.604,80	0,00	1.091.261,58	35.656,78	3,38%	11,65%
			Total Exterior		1.120.470,62	9,14%	

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 aliquotas 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.