

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)

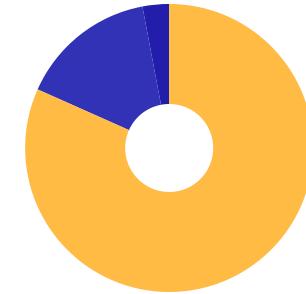
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.064.090,44	1,35%	553	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.842.119,67	16,30%	1.035	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	656.695,18	0,83%	1.127	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.143.232,59	9,06%	945	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	12.429.779,67	15,77%	1.060	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.305.686,45	8,00%	1.241	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.036.891,69	1,32%	854	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.152.609,77	2,73%	193	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	11.960.555,06	15,18%	305	1,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.453.279,26	6,92%	531	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	177.980,81	0,23%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	204.960,96	0,26%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	Não há	1.122.801,81	1,42%	8	5,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.080.125,83	1,37%	33	0,74%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	726.133,32	0,92%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	325.871,89	0,41%	838	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.536.880,73	1,95%	150	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.167.032,99	2,75%	52.735	0,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.038.847,33	2,59%	29	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.090.996,35	1,38%	13.421	0,03%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	17.973,02	0,02%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	1.090.681,59	1,38%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.469.494,29	3,13%	28	1,81%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	285.933,25	0,36%		0,10%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.077.939,88	1,37%		1,48%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.174.972,64	1,49%	25.475	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.169.592,07	1,48%	529	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		5.049,48	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução				78.803.158,54			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				5.049,48			Artigo 6º
				PL Total	78.808.208,02		

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

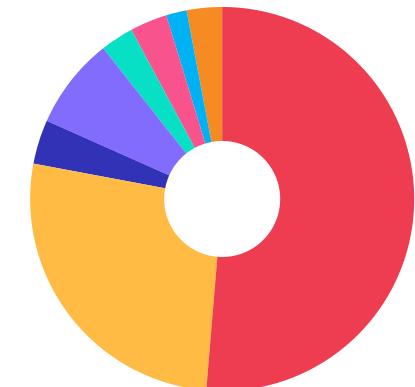
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	40.441.604,00	51,32%	9,80%	52,10%	80,00%	22.600.922,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.880.315,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	20.986.277,55	26,63%	3,56%	17,50%	40,00%	10.534.985,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2.929.060,96	3,72%	0,00%	5,00%	5,00%	1.011.096,97
Total Renda Fixa	100,00%	64.356.942,51	81,67%	13,36%	74,60%	135,00%	



- █ RENDA FIXA 64.356.942,51
- █ RENDA VARIÁVEL 12.101.651,32
- █ EXTERIOR 2.344.564,71

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 I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	7.880.315,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	6.068.632,94	7,70%	1,00%	14,00%	20,00%	9.691.998,77
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.199.650,96	2,79%	3,00%	5,00%	10,00%	5.680.664,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	2.469.494,29	3,13%	0,00%	3,70%	5,00%	1.470.663,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.363.873,13	1,73%	0,00%	2,25%	5,00%	2.576.284,80
Total Renda Variável	30,00%	12.101.651,32	15,36%	4,00%	24,95%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,20%	5,00%	3.940.157,93
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	2.344.564,71	2,98%	0,00%	0,25%	5,00%	1.595.593,22
Total Exterior	10,00%	2.344.564,71	2,98%	0,00%	0,45%	10,00%	

■ 7º I b	■ 7º IV a	■ 7º VII a	■ 8º II a
■ 8º III	■ 8º IV a	■ 8º IV b	■ 9º III

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	47.090.002,18	59,76	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.100.641,51	21,70	0,00
TRÍGONO CAPITAL	4.205.880,32	5,34	0,09
GRAPHEN INVESTIMENTOS	4.024.973,86	5,11	3,68
KPTL	2.469.494,29	3,13	0,71
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.152.609,77	2,73	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.090.681,59	1,38	0,22
ZION INVEST	285.933,25	0,36	0,04
PLURAL	204.960,96	0,26	0,00
RJI CORRETORA DE VALORES	177.980,81	0,23	0,03

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	9,80	80,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	3,56	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	14,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,94%	0,61%	1,38%	0,96%	0,61%	5,49%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-0,40%	0,99%	0,29%	-0,40%	4,67%	1,00%	0,03%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,44%	18,83%	4,96%	10,30%	18,83%	34,09%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	1,50%	-31,97%	16,09%	-	-31,97%	-51,23%	-	0,34%

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%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,21%	-7,00%	-3,16%	-6,69%	-7,00%	-28,49%	-	0,05%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,13%	-0,81%	0,80%	1,32%	-0,81%	-5,49%	0,50%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,88%	2,93%	1,13%	2,10%	2,93%	6,88%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	2,64%	1,10%	1,97%	2,64%	6,20%	0,20%	0,01%
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%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,11%	-1,37%	-0,52%	-0,63%	-1,37%	-37,97%	0,48%	0,02%

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,21%	-27,40%	-0,37%	-5,02%	-27,40%	-78,36%	0,17%	0,18%

CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	4,62%	1,93%	3,26%	4,62%	7,13%	0,03%	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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,63%	3,29%	1,49%	2,41%	3,29%	5,25%	0,02%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
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
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%

Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	32,16%	12,22%	22,40%	32,16%	94,37%	8,37%	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%

IDIV (Benchmark)	1,60%	-6,41%	-1,83%	-8,30%	-6,41%	-7,35%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	9,14%	49,65%	-2,60%	-2,27%	49,65%	74,33%	10,33%	0,23%

Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,10%	-13,19%	-5,43%	-18,78%	-13,19%	-14,75%	9,14%	0,15%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	5,61%	-1,11%	-11,93%	5,61%	8,48%	8,04%	0,19%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,61%	42,30%	-6,04%	-7,90%	42,30%	-	11,29%	0,26%

CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	1,44%	0,85%	-1,63%	1,44%	5,01%	1,69%	0,03%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,44%	-4,82%	-1,29%	-2,48%	-4,82%	-1,18%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
------------------	-------	--------	-------	-------	--------	--------	---	---

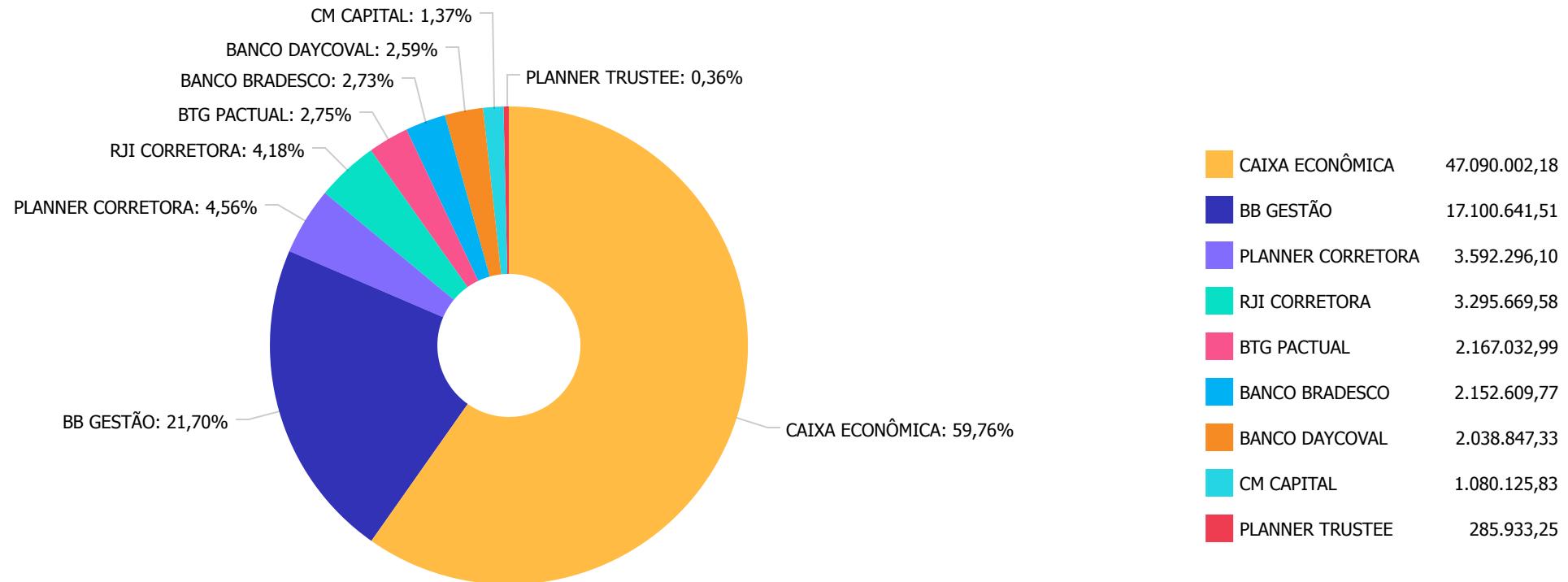
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-1,70%	-3,66%	-1,16%	-6,09%	-3,66%	-12,47%	2,68%	0,05%
IFIX (Benchmark)	8,78%	-2,28%	3,28%	1,81%	-2,28%	-12,28%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	58,29%	295,71%	-13,44%	241,98%	295,71%	114,73%	30,71%	0,87%
HAZ FII - ATCR11	0,08%	0,89%	-0,10%	-0,18%	0,89%	3,29%	-	-

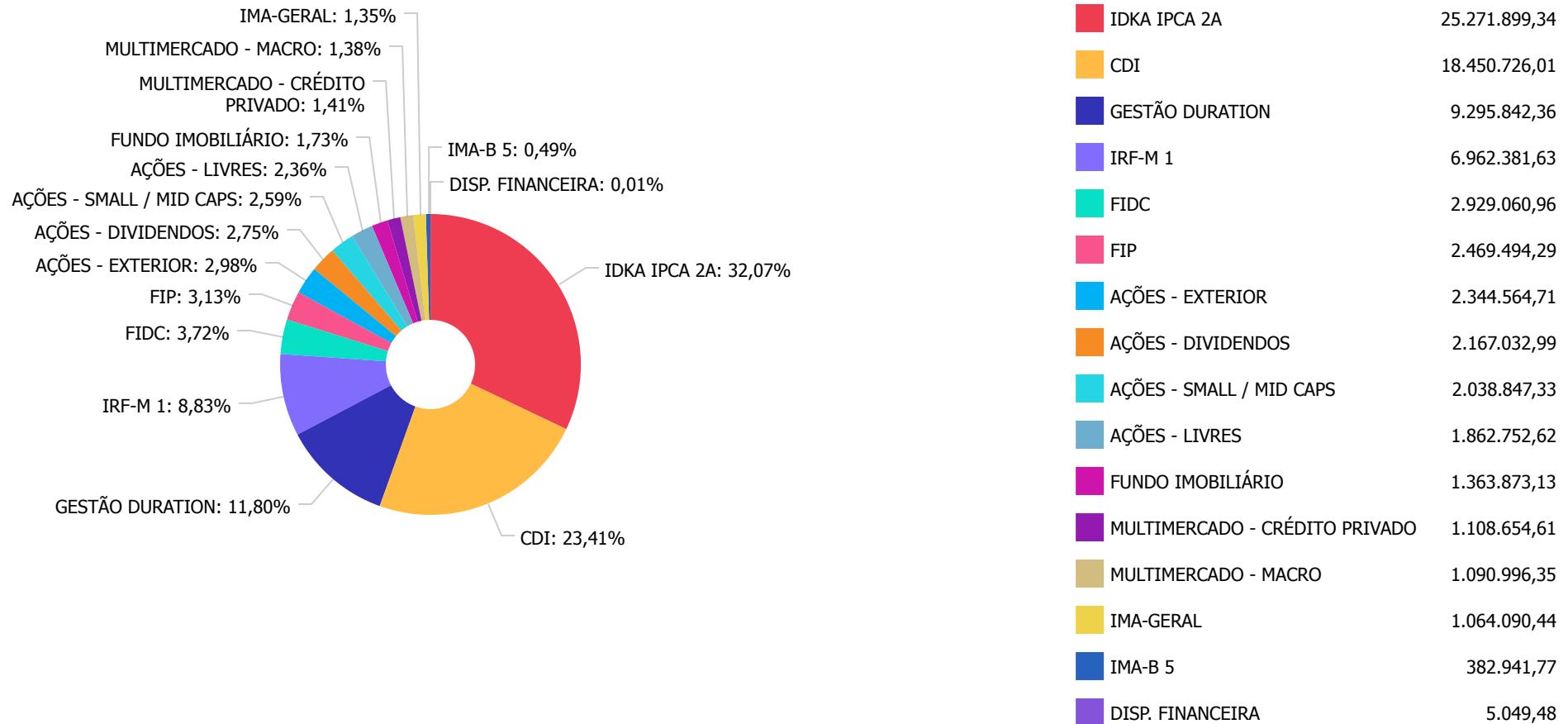
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,90%	32,16%	12,22%	22,40%	32,16%	94,37%	8,37%	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%

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



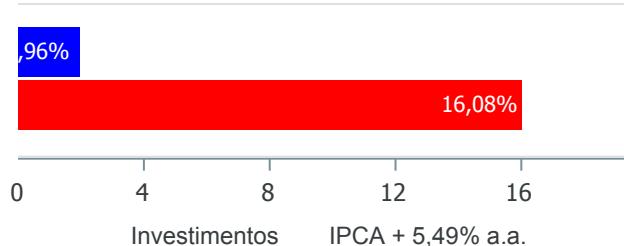
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2021)



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

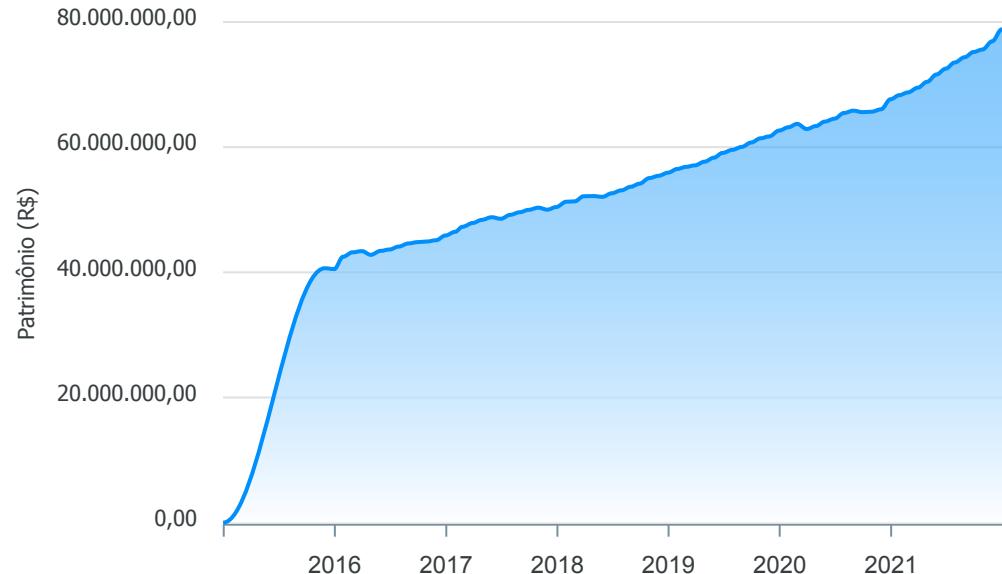
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	67.656.852,62	1.020.204,38	319.089,73	68.308.677,47	-49.289,80	-49.289,80	-0,07%	-0,07%	0,68%	0,68%	-10,66%	0,83%
Fevereiro	68.308.677,47	1.065.703,57	372.839,51	68.745.429,68	-256.111,85	-305.401,65	-0,37%	-0,44%	1,25%	1,93%	-22,95%	1,19%
Março	68.745.429,68	1.177.148,87	272.159,02	69.509.377,76	-141.041,77	-446.443,42	-0,20%	-0,64%	1,42%	3,38%	-19,06%	1,12%
Abril	69.509.377,76	1.099.850,75	356.501,08	70.442.385,96	189.658,53	-256.784,89	0,27%	-0,38%	0,74%	4,14%	-9,09%	0,99%
Maio	70.442.385,96	14.095.470,75	13.338.701,02	71.613.240,97	414.085,28	157.300,39	0,58%	0,20%	1,28%	5,48%	3,71%	1,98%
Junho	71.613.240,97	8.877.259,80	8.173.293,74	72.540.078,89	222.871,86	380.172,25	0,31%	0,51%	0,98%	6,51%	7,86%	1,86%
Julho	72.540.078,89	1.269.001,63	357.441,79	73.531.648,39	80.009,66	460.181,91	0,11%	0,62%	1,43%	8,03%	7,73%	1,71%
Agosto	73.531.648,39	1.231.617,24	355.355,85	74.356.700,98	-51.208,80	408.973,11	-0,07%	0,55%	1,34%	9,48%	5,82%	2,31%
Setembro	74.356.700,98	1.201.737,94	356.064,15	75.204.922,24	2.547,47	411.520,58	0,00%	0,56%	1,61%	11,25%	4,94%	1,89%
Outubro	75.204.922,24	1.228.251,30	397.301,83	75.597.552,01	-438.319,70	-26.799,12	-0,58%	-0,02%	1,68%	13,12%	-0,18%	2,49%
Novembro	75.597.552,01	1.255.257,53	378.500,50	76.917.211,69	442.902,65	416.103,53	0,58%	0,55%	1,38%	14,68%	3,78%	1,87%
Dezembro	76.917.211,69	1.481.320,41	679.833,18	78.803.158,54	1.084.459,62	1.500.563,15	1,40%	1,96%	1,22%	16,08%	12,18%	1,76%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

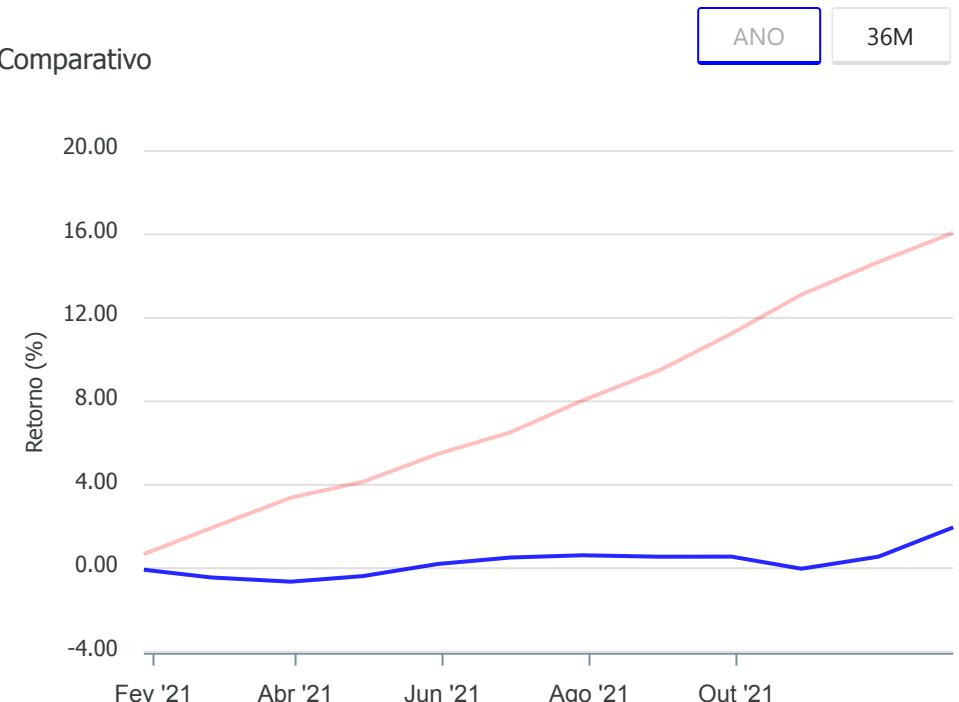


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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 SMILL IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+

Ibovespa IBX SMILL IDIV

Retorno dos Investimentos apóas 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
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	1.106.160,38	0,00	0,00	1.122.801,81	16.641,43	1,50%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.054.451,69	0,00	0,00	1.064.090,44	9.638,75	0,91%	0,91%	1,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.252.629,74	0,00	0,00	6.305.686,45	53.056,71	0,85%	0,85%	0,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	651.196,50	0,00	0,00	656.695,18	5.498,68	0,84%	0,84%	0,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.084.734,95	0,00	0,00	7.143.232,59	58.497,64	0,83%	0,83%	0,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.028.673,86	0,00	0,00	1.036.891,69	8.217,83	0,80%	0,80%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.135.889,76	0,00	0,00	2.152.609,77	16.720,01	0,78%	0,78%	0,70%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.411.234,80	0,00	0,00	5.453.279,26	42.044,46	0,78%	0,78%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.340.960,39	0,00	0,00	12.429.779,67	88.819,28	0,72%	0,72%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.752.064,33	0,00	0,00	12.842.119,67	90.055,34	0,71%	0,71%	1,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	11.068.141,86	1.481.320,41	661.198,80	11.960.555,06	72.291,59	0,58%	0,63%	0,02%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	725.207,20	0,00	0,00	726.133,32	926,12	0,13%	0,16%	0,50%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	177.785,91	0,00	0,00	177.980,81	194,90	0,11%	0,11%	0,48%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	205.386,42	0,00	0,00	204.960,96	-425,46	-0,21%	-0,21%	0,17%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.082.397,70	0,00	0,00	1.080.125,83	-2.271,87	-0,21%	-	-
Total Renda Fixa	63.076.915,49	1.481.320,41	661.198,80	64.356.942,51	459.905,41	0,72%		0,54%

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	180.645,15	0,00	0,00	285.933,25	105.288,10	58,28%	58,29%	30,71%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.860.101,93	0,00	0,00	2.038.847,33	178.745,40	9,61%	9,61%	11,29%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	1.985.611,57	0,00	0,00	2.167.032,99	181.421,42	9,14%	9,14%	10,33%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.452.888,97	0,00	0,00	1.536.880,73	83.991,76	5,78%	5,78%	8,04%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	316.082,68	0,00	0,00	325.871,89	9.789,21	3,10%	3,10%	9,14%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.075.570,69	0,00	0,00	1.090.996,35	15.425,66	1,43%	1,43%	1,69%
HAZ FII - ATCR11	1.077.088,59	0,00	0,00	1.077.939,88	851,29	0,08%	0,08%	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.109.548,28	0,00	18.634,38	1.090.681,59	-232,31	-0,02%	-1,70%	2,68%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.472.808,66	0,00	0,00	2.469.494,29	-3.314,37	-0,13%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.051,80	0,00	0,00	17.973,02	-78,78	-0,44%	-0,44%	0,00%
Total Renda Variável	11.548.398,32	0,00	18.634,38	12.101.651,32	571.887,38	4,95%		8,68%

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 AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.141.886,93	0,00	0,00	1.174.972,64	33.085,71	2,90%	2,90%	8,37%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.150.010,95	0,00	0,00	1.169.592,07	19.581,12	1,70%	1,70%	8,95%
Total Exterior	2.291.897,88	0,00	0,00	2.344.564,71	52.666,83	2,30%		8,66%

Retorno dos Investimentos apóas 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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.607.582,67	0,00	0,00	12.842.119,67	234.537,00	1,86%	1,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	12.207.567,97	0,00	0,00	12.429.779,67	222.211,70	1,82%	1,82%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	9.226.369,00	3.964.829,24	1.389.273,76	11.960.555,06	158.630,58	1,20%	1,49%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	967.212,33	0,00	0,00	1.122.801,81	155.589,48	16,09%	16,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.351.426,56	0,00	0,00	5.453.279,26	101.852,70	1,90%	1,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.067.862,82	0,00	0,00	7.143.232,59	75.369,77	1,07%	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.237.645,55	0,00	0,00	6.305.686,45	68.040,90	1,09%	1,09%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.120.435,12	0,00	0,00	2.152.609,77	32.174,65	1,52%	1,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.017.254,45	0,00	0,00	1.036.891,69	19.637,24	1,93%	1,93%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.053.614,69	0,00	0,00	1.064.090,44	10.475,75	0,99%	0,99%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.115.326,74	0,00	44.722,03	1.080.125,83	9.521,12	0,85%	-3,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	649.572,04	0,00	0,00	656.695,18	7.123,14	1,10%	1,10%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	720.368,02	0,00	0,00	726.133,32	5.765,30	0,80%	0,80%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	205.721,60	0,00	0,00	204.960,96	-760,64	-0,37%	-0,37%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	178.908,70	0,00	0,00	177.980,81	-927,89	-0,52%	-0,52%
				Total Renda Fixa	1.099.240,80	1,74%	

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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.047.060,66	0,00	0,00	1.174.972,64	127.911,98	12,22%	12,22%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.046.041,85	0,00	0,00	1.169.592,07	123.550,22	11,81%	11,81%
CAIXA alocação MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.081.845,37	0,00	0,00	1.090.996,35	9.150,98	0,85%	0,85%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.103.486,21	0,00	18.634,38	1.090.681,59	5.829,76	0,53%	-1,16%
HAZ FII - ATCR11	1.078.998,95	0,00	3.005,34	1.077.939,88	1.946,27	0,18%	-0,10%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.207,07	0,00	0,00	17.973,02	-234,05	-1,29%	-1,29%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.478.585,11	0,00	0,00	2.469.494,29	-9.090,82	-0,37%	-0,37%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.554.170,86	0,00	0,00	1.536.880,73	-17.290,13	-1,11%	-1,11%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	344.576,66	0,00	0,00	325.871,89	-18.704,77	-5,43%	-5,43%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	330.322,56	0,00	0,00	285.933,25	-44.389,31	-13,44%	-13,44%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.224.898,09	0,00	0,00	2.167.032,99	-57.865,10	-2,60%	-2,60%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.169.860,59	0,00	0,00	2.038.847,33	-131.013,26	-6,04%	-6,04%
				Total Renda Variável	-10.198,23	-0,07%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.272.001,87	0,00	0,00	12.842.119,67	570.117,80	4,65%	4,65%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.470.726,10	413.321,72	0,00	12.429.779,67	545.731,85	4,59%	4,66%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	7.314.126,37	21.589.502,45	17.245.131,96	11.960.555,06	302.058,20	1,05%	3,29%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.226.521,69	0,00	0,00	5.453.279,26	226.757,57	4,34%	4,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.110.002,27	0,00	7.000.000,00	6.305.686,45	195.684,18	1,49%	2,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.036.891,69	36.891,69	3,69%	4,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.635.854,81	0,00	1.000.000,00	656.695,18	20.840,37	1,27%	2,64%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	180.454,40	0,00	0,00	177.980,81	-2.473,59	-1,37%	-1,37%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.155.957,42	0,00	0,00	2.152.609,77	-3.347,65	-0,16%	-0,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.068.347,14	0,00	0,00	1.064.090,44	-4.256,70	-0,40%	-0,40%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	732.086,88	0,00	0,00	726.133,32	-5.953,56	-0,81%	-0,81%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.167.845,64	5.000.000,00	0,00	7.143.232,59	-24.613,05	-0,34%	-0,11%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.206.415,37	0,00	89.444,06	1.080.125,83	-36.845,48	-3,05%	-7,00%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	282.308,68	0,00	0,00	204.960,96	-77.347,72	-27,40%	-27,40%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	1.650.545,30	0,00	0,00	1.122.801,81	-527.743,49	-31,97%	-31,97%
				Total Renda Fixa	1.215.500,42	1,93%	

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
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	1.000.000,00	0,00	1.174.972,64	174.972,64	17,50%	32,16%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	1.000.000,00	0,00	1.169.592,07	169.592,07	16,96%	30,51%
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.167.032,99	167.032,99	8,35%	49,65%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.038.847,33	38.847,33	1,94%	42,30%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.075.480,73	0,00	0,00	1.090.996,35	15.515,62	1,44%	1,44%
HAZ FII - ATCR11	1.068.481,06	0,00	3.005,34	1.077.939,88	12.464,16	1,17%	0,89%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.882,81	0,00	0,00	17.973,02	-909,79	-4,82%	-4,82%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.132.138,80	0,00	18.634,38	1.090.681,59	-22.822,83	-2,02%	-3,66%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	375.365,04	0,00	0,00	325.871,89	-49.493,15	-13,19%	-13,19%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.538.570,67	0,00	0,00	2.469.494,29	-69.076,38	-2,72%	1,83%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	361.290,30	0,00	865,66	285.933,25	-74.491,39	-20,62%	295,71%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	613.449,27	1.000.000,00	0,00	1.536.880,73	-76.568,54	-4,75%	5,61%
				Total Renda Variável	285.062,73	2,01%	

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.

