

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

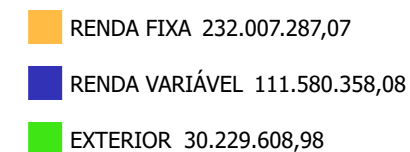
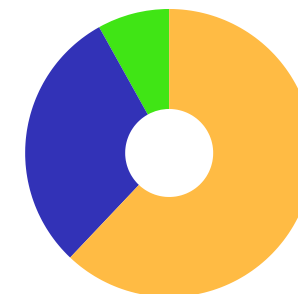
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.103.767,14	0,83%	306	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.356,73	0,00%	1.059	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	64.264.067,40	17,19%	1.237	1,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	15.717.944,69	4,20%	80	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.789.191,54	1,82%	7.028	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	97,37	0,00%	821	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	37.212.855,47	9,95%	868	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.954.820,09	1,06%	191	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	70.545.781,31	18,87%	881	0,71%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.275.176,48	2,75%	115	1,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	2.868.285,37	0,77%	98	1,32%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO P...	D+21	Não há	7.024.507,75	1,88%	1.567	0,63%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	10.242.435,73	2,74%	5.233	1,24%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.072.409,92	0,82%	7.004	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.547.006,35	0,68%	5.376	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.281.347,61	0,61%	889	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	13.592.553,68	3,64%	2.508	1,19%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.017.357,08	1,07%	918	1,76%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.318.058,33	1,16%	4.707	0,38%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du	Não há	2.238.424,94	0,60%	2	1,26%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.596.323,77	1,76%	15	0,73%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.199.426,02	1,12%	105	0,51%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.582.948,53	0,96%	2.827	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	14.349.889,13	3,84%	3.778	3,93%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.448.671,74	1,73%	33	0,76%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON WAHOO FI AÇÕES	D+32	Não há	4.323.554,78	1,16%	133	6,09%	Artigo 8º, Inciso I
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	2.711.533,71	0,73%	3.771	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	983.204,08	0,26%	80	0,11%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	2.472.602,86	0,66%	207	1,71%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	8.140.970,58	2,18%	12.913	0,75%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	10.675.690,01	2,86%	1.176	0,32%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.957.141,45	2,13%	143.847	0,23%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	7.539.906,57	2,02%	43.805	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	7.623.346,24	2,04%	5.026	1,84%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	12.228.097,68	3,27%	591	0,58%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	9.909.502,00	2,65%	61.312	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			373.817.254,13				

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

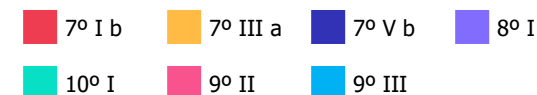
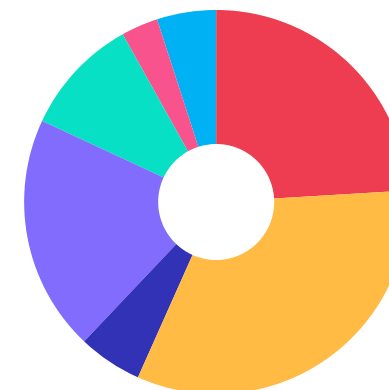
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	13,00%	50,00%	186.908.627,07
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	89.883.327,50	24,04%	20,00%	34,00%	80,00%	209.170.475,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	11.214.517,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	121.988.730,72	32,63%	10,00%	15,00%	60,00%	102.301.621,76
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	37.381.725,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	20.135.228,85	5,39%	0,00%	5,00%	5,00%	-1.444.366,14
Total Renda Fixa	100,00%	232.007.287,07	62,06%	30,00%	67,00%	208,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	74.279.505,59	19,87%	10,00%	18,00%	30,00%	37.865.670,65
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	37.300.852,49	9,98%	3,00%	9,00%	10,00%	80.872,92
Total Renda Variável	30,00%	111.580.358,08	29,85%	13,00%	27,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	11.596.777,52	3,10%	3,00%	3,00%	10,00%	25.784.947,89
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	18.632.831,46	4,98%	4,00%	6,00%	10,00%	18.748.893,95
Total Exterior	10,00%	30.229.608,98	8,09%	7,00%	9,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	140.790.257,95	37,66	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	51.788.710,60	13,85	0,00
WESTERN ASSET	24.655.834,99	6,60	0,05
BANCO J. SAFRA S/A	22.903.787,69	6,13	0,01
ITAÚ UNIBANCO	19.917.370,71	5,33	0,00
SOMMA INVESTIMENTOS	14.349.889,13	3,84	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	11.494.726,66	3,07	0,00
TARPON INVESTIMENTOS	10.772.226,52	2,88	0,17
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	10.275.176,48	2,75	0,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	10.242.435,73	2,74	0,11
XP ASSET MANAGEMENT	8.140.970,58	2,18	0,06
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	7.623.346,24	2,04	0,00
ICATU VANGUARDA	7.024.507,75	1,88	0,02
GUEPARDO INVESTIMENTOS	6.596.323,77	1,76	0,22
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.619.416,27	1,50	0,02
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.318.058,33	1,16	0,30
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	4.017.357,08	1,07	0,01
OCCAM BRASIL	3.582.948,53	0,96	0,01
TRUXT INVESTIMENTOS	2.711.533,71	0,73	0,01
GENIAL INVESTIMENTOS	2.472.602,86	0,66	0,03
BAHIA ASSET MANAGEMENT	2.281.347,61	0,61	0,01
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.238.424,94	0,60	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	89.883.327,50	24,04	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	121.988.730,72	32,63	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20.135.228,85	5,39	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	74.279.505,59	19,87	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	11.596.777,52	3,10	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	18.632.831,46	4,98	4,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	37.300.852,49	9,98	3,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	3,17%	3,14%	4,54%	12,58%	1,11%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	1,03%	3,76%	8,77%	17,00%	29,59%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,27%	0,27%	3,14%	1,62%	2,65%	9,55%	0,91%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	0,21%	0,21%	2,90%	1,13%	1,42%	5,98%	-	-
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	-0,15%	-0,15%	4,16%	2,15%	4,34%	11,59%	1,41%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	0,61%	2,25%	2,44%	3,30%	6,63%	0,37%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,17%	-0,17%	3,17%	1,50%	0,50%	9,02%	1,47%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	0,10%	0,10%	3,38%	3,23%	4,37%	12,02%	0,98%	0,03%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,13%	3,34%	2,85%	3,60%	11,29%	0,97%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	0,78%	2,23%	3,66%	5,27%	7,60%	0,02%	0,01%
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,78%	0,78%	2,33%	4,31%	6,85%	6,96%	0,07%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	0,79%	2,18%	3,74%	5,25%	7,57%	0,05%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,61%	0,61%	1,72%	2,77%	3,83%	5,57%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,24%	2,49%	1,09%	0,67%	4,30%	0,70%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-5,26%	-5,26%	-1,95%	2,74%	21,57%	39,99%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-5,21%	-5,21%	-0,51%	5,60%	25,75%	40,32%	8,55%	0,14%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	-5,21%	-5,21%	-0,43%	5,80%	26,90%	-	8,60%	0,14%
Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,89%	5,89%	16,59%	4,55%	18,82%	-	11,60%	0,24%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9,15%	9,15%	10,15%	-8,85%	-5,27%	-5,23%	8,85%	0,19%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	1,34%	1,34%	2,99%	-5,01%	22,29%	44,02%	10,08%	0,19%
TARPON WAHOO FI AÇÕES	6,48%	6,48%	16,36%	-1,37%	12,83%	9,85%	13,86%	0,21%
FINACAP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,02%	8,02%	14,79%	-	-	-	8,55%	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,88%	3,88%	6,64%	-8,47%	2,09%	-9,60%	9,05%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,16%	5,16%	2,66%	-20,19%	-10,21%	-32,32%	10,97%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,68%	3,68%	6,98%	-3,28%	4,59%	6,18%	6,86%	0,15%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,72%	4,72%	-0,70%	-17,38%	-10,48%	-1,96%	15,32%	0,18%
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	6,19%	6,19%	3,99%	-18,43%	-13,93%	-10,21%	11,25%	0,18%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,51%	7,51%	7,26%	-8,88%	-0,08%	-10,08%	9,32%	0,17%
OCCAM FIC AÇÕES	6,52%	6,52%	7,30%	-7,34%	-4,05%	-0,69%	8,11%	0,15%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,72%	7,72%	5,42%	-12,07%	-7,60%	-16,70%	8,08%	0,17%
SMLL (Benchmark)	3,42%	3,42%	4,89%	-17,43%	-10,25%	-14,29%	-	-

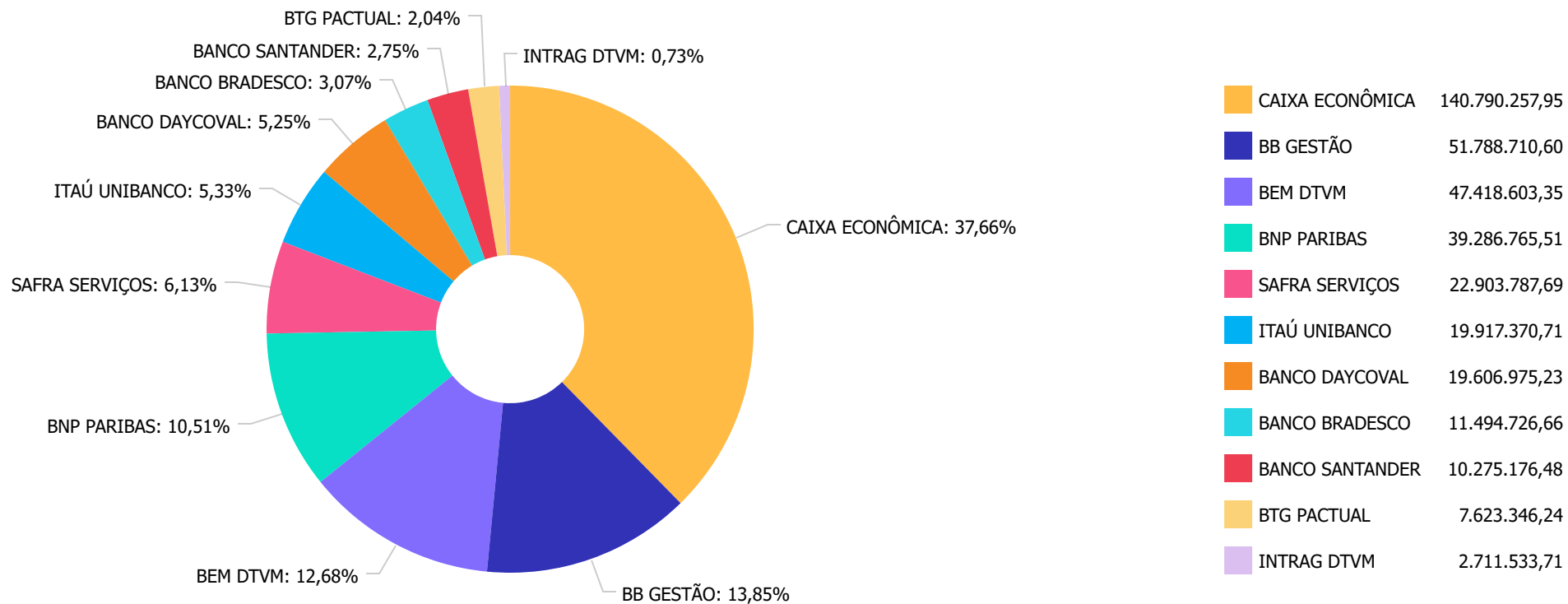
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,64%	2,64%	0,83%	-14,35%	-5,47%	-15,82%	9,39%	0,15%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BRADESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-5,33%	-5,33%	-0,69%	5,23%	25,27%	41,07%	8,59%	0,14%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-5,19%	-5,19%	-0,55%	5,46%	25,48%	40,50%	8,46%	0,13%

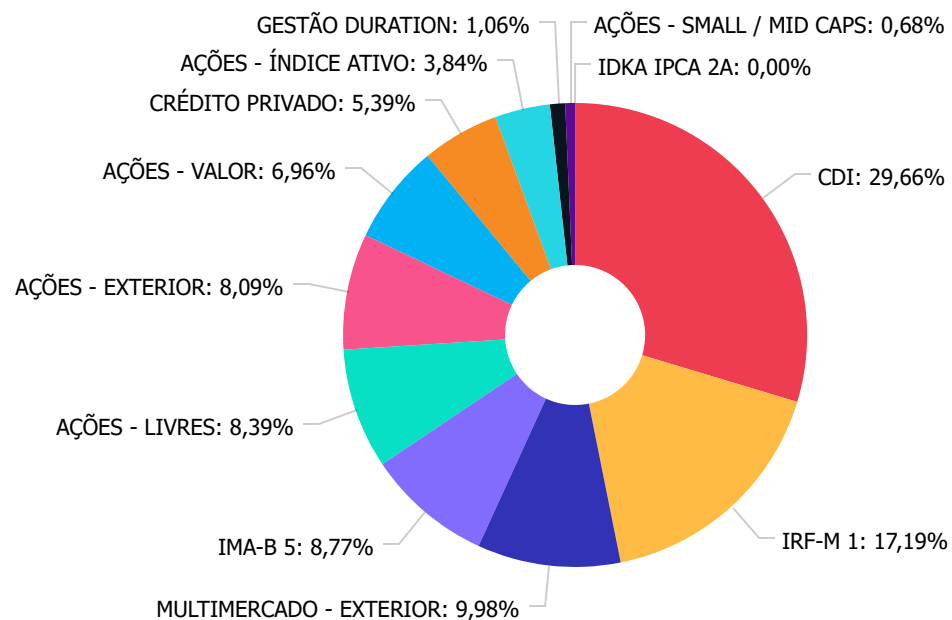
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-13,85%	-13,85%	-14,39%	-2,35%	8,01%	71,80%	10,99%	0,21%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-11,73%	-11,73%	-8,49%	0,72%	13,94%	59,64%	8,24%	0,18%
MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-15,52%	-15,52%	-12,90%	-3,21%	5,84%	73,67%	9,88%	0,22%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	-17,86%	-17,86%	-22,26%	-14,80%	-15,54%	54,88%	16,91%	0,22%
MSCI ACWI (Benchmark)	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-11,21%	-11,21%	-7,68%	2,13%	5,09%	-	7,98%	0,18%

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



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

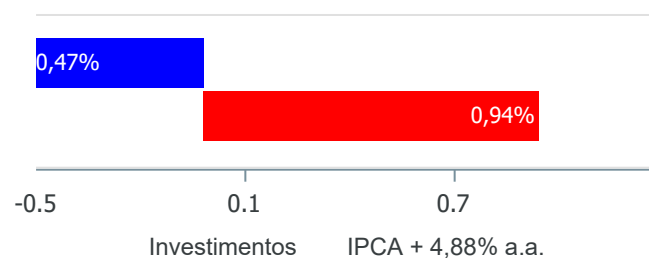


CDI	110.862.501,29
IRF-M 1	64.264.067,40
MULTIMERCADO - EXTERIOR	37.300.852,49
IMA-B 5	32.782.312,71
AÇÕES - LIVRES	31.372.359,19
AÇÕES - EXTERIOR	30.229.608,98
AÇÕES - VALOR	26.010.250,92
CRÉDITO PRIVADO	20.135.228,85
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.349.889,13
GESTÃO DURATION	3.954.820,09
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.547.006,35
IDKA IPCA 2A	8.356,73

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

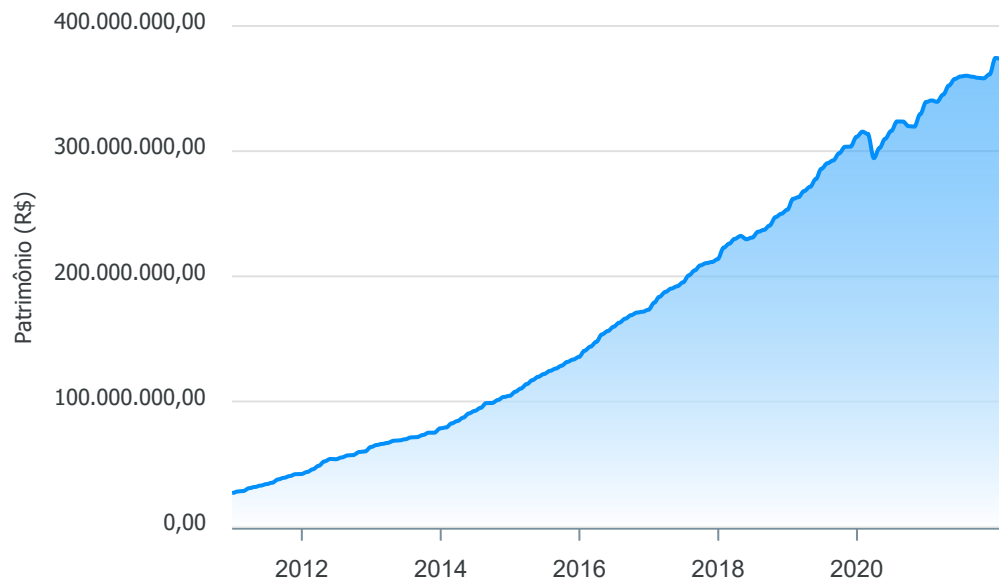
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	374.430.502,58	153.659.829,25	152.490.900,46	373.817.254,13	-1.782.177,24	-1.782.177,24	-0,47%	-0,47%	0,94%	0,94%	-50,48%	3,89%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



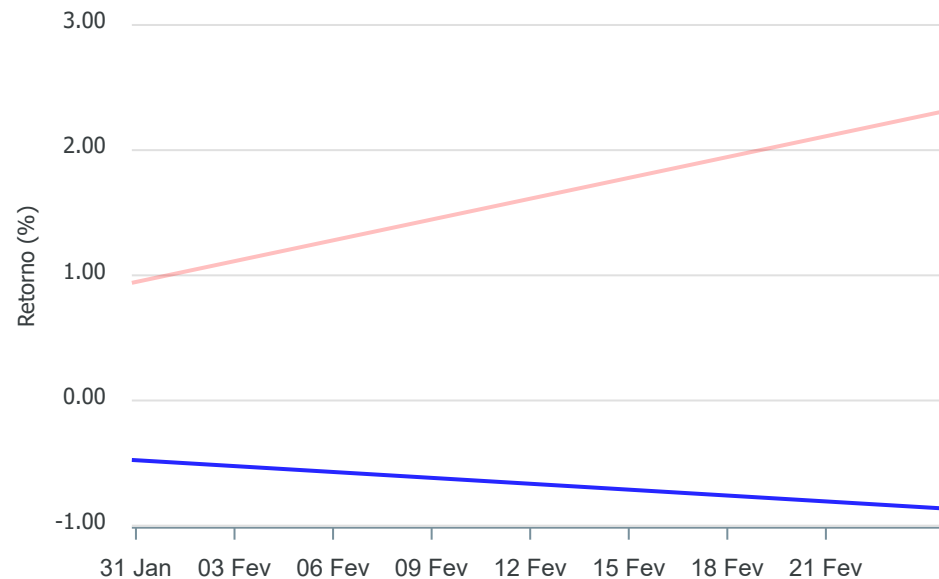
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.994.965,63	0,00	0,00	70.545.781,31	550.815,68	0,79%	0,79%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	36.923.611,47	0,00	0,00	37.212.855,47	289.244,00	0,78%	0,78%	0,02%
MONGERAL AEGON FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	7.178.462,37	3.000.000,00	0,00	10.242.435,73	63.973,36	0,63%	0,78%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	64.000.000,00	64.269.139,81	0,00	269.139,81	0,42%	-0,54%	2,56%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.945.441,48	0,00	0,00	3.954.820,09	9.378,61	0,24%	0,24%	0,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.880.515,15	0,00	1.875.382,24	8.356,73	3.223,82	0,17%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	8.636.714,99	17.606.307,20	23.181.454,37	3.103.767,14	42.199,32	0,16%	0,61%	0,00%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	10.261.902,45	0,00	0,00	10.275.176,48	13.274,03	0,13%	0,13%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	15.702.520,95	0,00	0,00	15.717.944,69	15.423,74	0,10%	0,10%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	61.504.290,27	0,00	61.563.528,70	0,00	59.238,43	0,10%	0,09%	0,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.491,65	0,00	1.395,34	97,37	1,06	0,07%	0,65%	0,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.082.176,37	1.784.382,24	0,00	2.868.285,37	1.726,76	0,06%	0,27%	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	64.269.139,81	0,00	64.264.067,40	-5.072,41	-0,01%	0,61%	0,37%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	6.800.422,37	0,00	0,00	6.789.191,54	-11.230,83	-0,17%	-0,17%	1,47%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	4.037.279,59	3.000.000,00	0,00	7.024.507,75	-12.771,84	-0,18%	-0,15%	1,41%
Total Renda Fixa	227.949.794,74	153.659.829,25	150.890.900,46	232.007.287,07	1.288.563,54	0,56%		0,34%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.680.533,51	0,00	0,00	4.017.357,08	336.823,57	9,15%	9,15%	8,85%
FINACAP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.072.157,19	0,00	0,00	2.238.424,94	166.267,75	8,02%	8,02%	8,55%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.337.434,64	0,00	1.600.000,00	3.072.409,92	334.975,28	7,72%	7,72%	8,08%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	13.347.829,21	0,00	0,00	14.349.889,13	1.002.059,92	7,51%	7,51%	9,32%
OCCAM FIC AÇÕES	3.363.583,95	0,00	0,00	3.582.948,53	219.364,58	6,52%	6,52%	8,11%
TARPON WAHOO FI AÇÕES	4.060.295,00	0,00	0,00	4.323.554,78	263.259,78	6,48%	6,48%	13,86%
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	2.148.443,83	0,00	0,00	2.281.347,61	132.903,78	6,19%	6,19%	11,25%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.229.369,44	0,00	0,00	6.596.323,77	366.954,33	5,89%	5,89%	11,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.993.404,49	0,00	0,00	4.199.426,02	206.021,53	5,16%	5,16%	10,97%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.589.443,21	0,00	0,00	2.711.533,71	122.090,50	4,71%	4,71%	15,32%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.156.862,59	0,00	0,00	4.318.058,33	161.195,74	3,88%	3,88%	9,05%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	13.109.569,86	0,00	0,00	13.592.553,68	482.983,82	3,68%	3,68%	6,86%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.481.511,13	0,00	0,00	2.547.006,35	65.495,22	2,64%	2,64%	9,39%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	6.363.222,13	0,00	0,00	6.448.671,74	85.449,61	1,34%	1,34%	10,08%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	12.896.761,26	0,00	0,00	12.228.097,68	-668.663,58	-5,18%	-5,18%	8,46%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.041.904,38	0,00	0,00	7.623.346,24	-418.558,14	-5,20%	-5,20%	8,60%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.453.853,57	0,00	0,00	9.909.502,00	-544.351,57	-5,21%	-5,21%	8,55%
BRDESCO H BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	7.964.451,00	0,00	0,00	7.539.906,57	-424.544,43	-5,33%	-5,33%	8,59%
Total Renda Variável	111.290.630,39	0,00	1.600.000,00	111.580.358,08	1.889.727,69	1,70%		9,25%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2022)**FUNDOS EXTERIOR**

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.784.853,57	0,00	0,00	2.472.602,86	-312.250,71	-11,21%	-11,21%	7,98%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.093.779,68	0,00	0,00	10.675.690,01	-1.418.089,67	-11,73%	-11,73%	8,24%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.236.368,43	0,00	0,00	7.957.141,45	-1.279.226,98	-13,85%	-13,85%	10,99%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.163.880,17	0,00	0,00	983.204,08	-180.676,09	-15,52%	-15,52%	9,88%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	9.911.195,60	0,00	0,00	8.140.970,58	-1.770.225,02	-17,86%	-17,86%	16,91%
Total Exterior	35.190.077,45	0,00	0,00	30.229.608,98	-4.960.468,47	-14,10%		11,33%

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.