

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

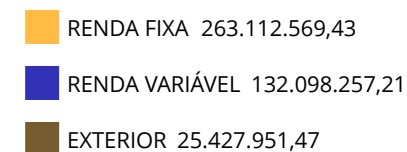
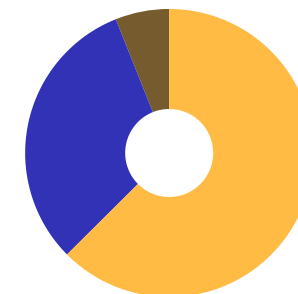
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	25.033.811,54	5,95%	1.035	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	17.450.574,95	4,15%	788	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	13.395.586,77	3,18%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	57.616.023,88	13,70%	945	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	72.933.649,93	17,34%	1.060	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.052.272,99	0,25%	840	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	140.009,44	0,03%	1.241	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.584.441,21	3,70%	244	1,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	14.697.173,63	3,49%	193	1,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.887.765,64	0,92%	42	6,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	32.141.867,24	7,64%	95	2,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.483.661,04	0,35%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.708.569,56	0,41%	31	1,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	Não há	3.472.813,56	0,83%	8	18,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.514.348,05	0,60%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.337.738,29	1,74%	749	3,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	6.718.985,40	1,60%	4.798	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	8.688.327,57	2,07%	776	5,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	13.198.474,39	3,14%	250	8,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	13.712.060,63	3,26%	236	5,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	10.655.080,32	2,53%	284	12,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.532.853,51	1,55%	2.273	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.375.655,38	0,80%	2.086	1,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	9.904.025,26	2,35%	14	2,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	17.496.697,08	4,16%	29	1,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	1.335.713,74	0,32%		0,00%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.041.010,45	1,67%	1.259	0,30%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	4.983.680,52	1,18%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	10.931.549,54	2,60%	28	8,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.249.768,26	1,72%		4,81%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.787.095,97	0,42%		1,80%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.149.540,90	0,27%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+5 du	Não há	11.360.418,45	2,70%	201	1,73%	Artigo 9º, Inciso II
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	5.049.920,65	1,20%	31.157	0,64%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	9.017.612,37	2,14%	529	0,23%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			420.638.778,11				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2021)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	187.621.929,50	44,60%	9,96%	49,81%	62,26%	74.267.773,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	69.503.478,32	16,52%	3,86%	9,29%	40,00%	98.752.032,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	5.987.161,61	1,42%	0,00%	2,28%	2,28%	3.603.402,53
Total Renda Fixa	100,00%	263.112.569,43	62,55%	13,82%	61,38%	104,54%	



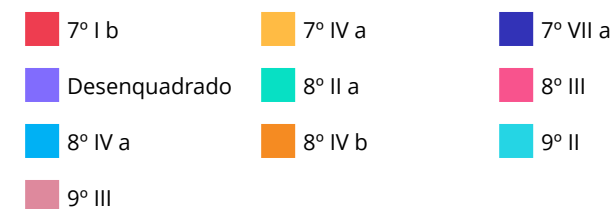
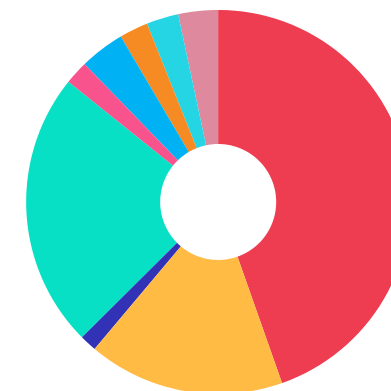
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	25,00%	97.619.897,83	23,21%	3,58%	17,91%	25,00%	7.539.796,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.376.724,19	1,99%	3,14%	3,14%	10,00%	33.687.153,62
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	15.915.230,06	3,78%	0,00%	3,91%	5,00%	5.116.708,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	10.186.405,13	2,42%	0,00%	2,80%	5,00%	10.845.533,78
Total Renda Variável	35,00%	132.098.257,21	31,40%	6,72%	27,76%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	11.360.418,45	2,70%	0,00%	0,43%	5,00%	9.671.520,46
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	14.067.533,02	3,34%	0,00%	0,43%	5,00%	6.964.405,89
Total Exterior	10,00%	25.427.951,47	6,05%	0,00%	0,86%	10,00%	



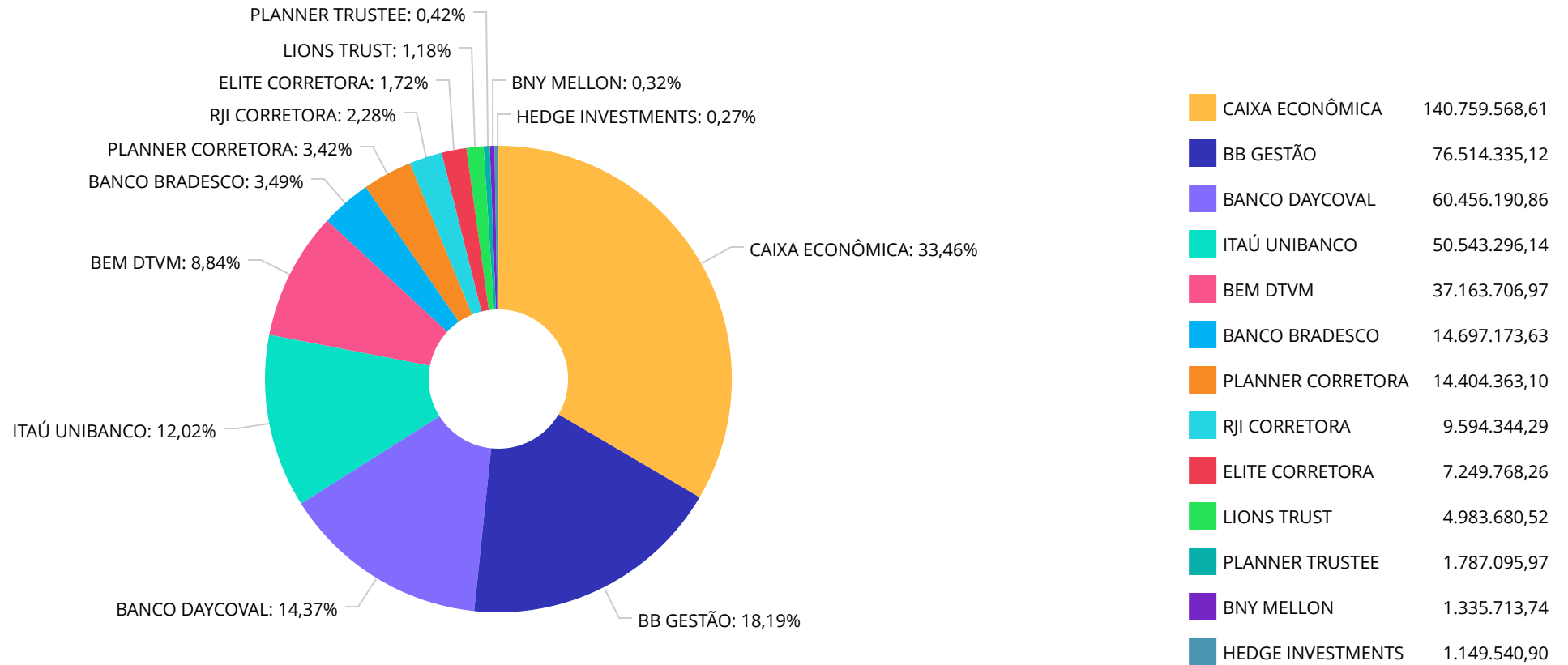
Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Dezembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	140.759.568,61	33,46	0,45
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	76.514.335,12	18,19	0,00
ITAÚ UNIBANCO	50.543.296,14	12,02	0,00
TRÍGONO CAPITAL	27.400.722,34	6,51	0,61
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	14.697.173,63	3,49	0,00
META ASSET MANAGEMENT	13.712.060,63	3,26	5,32
GRAPHEN INVESTIMENTOS	13.236.929,87	3,15	12,11
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	13.198.474,39	3,14	2,01
KPTL	10.931.549,54	2,60	3,16
MULTINVEST CAPITAL	10.655.080,32	2,53	1,06
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	8.688.327,57	2,07	0,11
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	7.337.738,29	1,74	0,25
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	6.718.985,40	1,60	0,48
NAVI CAPITAL	6.532.853,51	1,55	0,45
KINEA INVESTIMENTOS	4.983.680,52	1,18	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	3.887.765,64	0,92	1,23
PERFIN INVESTIMENTOS	3.375.655,38	0,80	0,02
ZION INVEST	1.787.095,97	0,42	0,22
PLURAL	1.708.569,56	0,41	0,02
RJI CORRETORA DE VALORES	1.483.661,04	0,35	0,27
CAPITÂNIA	1.335.713,74	0,32	-
HEDGE INVESTMENTS	1.149.540,90	0,27	0,11

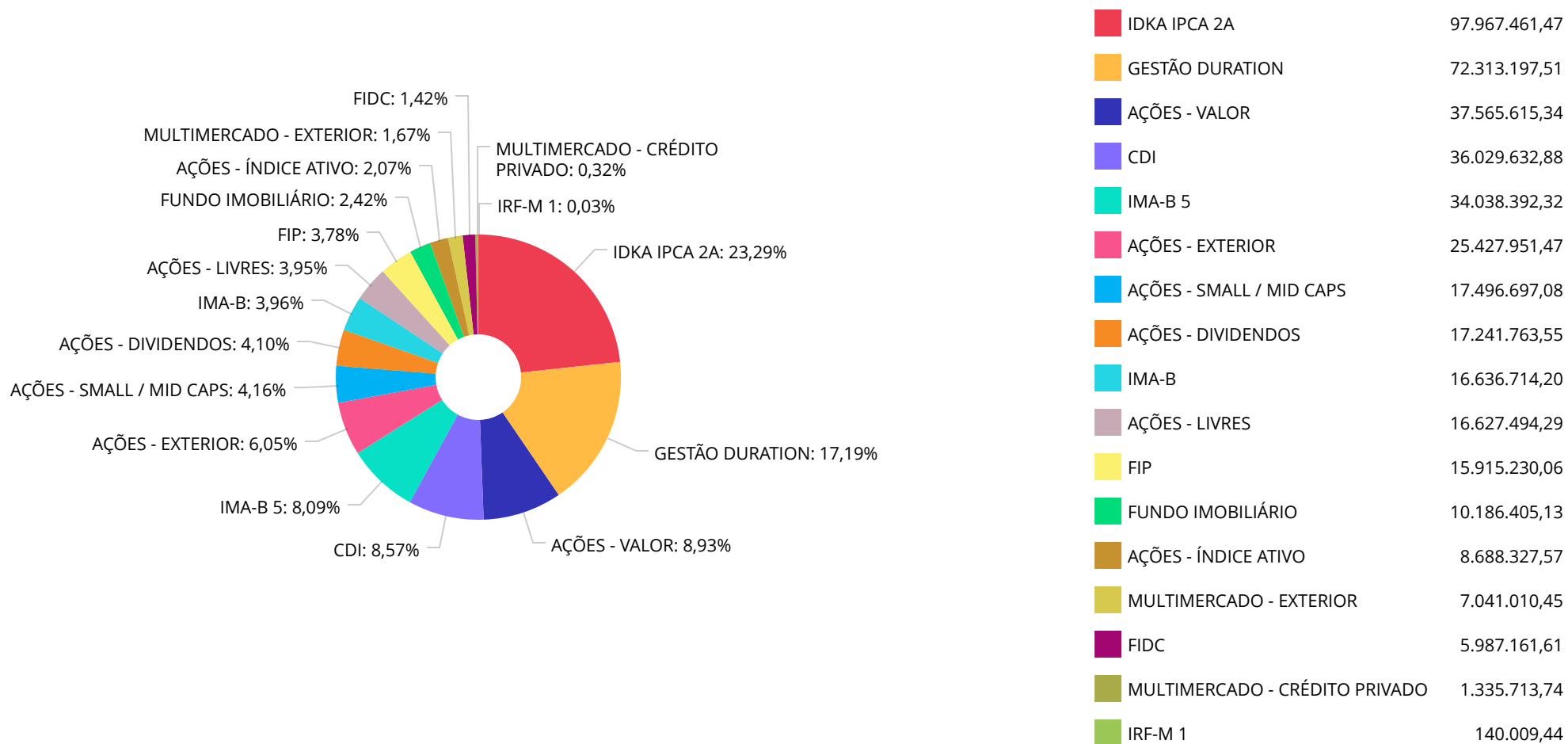
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	187.621.929,50	44,60	9,96	62,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	69.503.478,32	16,52	3,86	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5.987.161,61	1,42	0,00	2,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	97.619.897,83	23,21	3,58	25,00
Artigo 8º, Inciso III	8.376.724,19	1,99	3,14	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	15.915.230,06	3,78	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	10.186.405,13	2,42	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	11.360.418,45	2,70	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	14.067.533,02	3,34	0,00	5,00

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



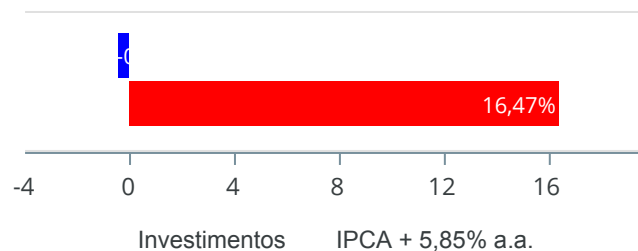
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2021)



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	437.049.080,79	413.240,53	8.625.466,75	425.617.909,15	-3.218.945,42	-3.218.945,42	-0,74%	-0,74%	0,70%	0,70%	-104,71%	3,83%
Fevereiro	425.617.909,15	21.458.736,18	18.714.783,26	423.897.098,89	-4.464.763,18	-7.683.708,60	-1,04%	-1,77%	1,27%	1,98%	-89,33%	3,59%
Março	423.897.098,89	5.504.014,17	6.606.144,52	428.837.352,85	6.042.384,31	-1.641.324,29	1,43%	-0,37%	1,46%	3,47%	-10,70%	4,02%
Abril	428.837.352,85	31.058.143,66	32.109.520,27	434.552.678,39	6.766.702,15	5.125.377,86	1,58%	1,20%	0,76%	4,26%	28,22%	2,61%
Mai	434.552.678,39	26.363.579,13	27.568.157,51	440.397.536,02	7.049.436,01	12.174.813,87	1,62%	2,84%	1,31%	5,62%	50,57%	3,44%
Junho	440.397.536,02	3.238.163,55	4.433.483,91	439.765.020,01	562.804,35	12.737.618,22	0,13%	2,97%	1,01%	6,69%	44,49%	3,11%
Julho	439.765.020,01	11.904.192,16	12.596.944,61	435.286.207,12	-3.786.060,44	8.951.557,78	-0,86%	2,09%	1,46%	8,25%	25,32%	3,45%
Agosto	435.286.207,12	9.910.739,64	12.741.424,63	427.887.402,81	-4.568.119,32	4.383.438,46	-1,05%	1,02%	1,37%	9,73%	10,45%	3,94%
Setembro	427.887.402,81	10.146.840,41	10.530.563,41	420.952.004,80	-6.551.675,01	-2.168.236,55	-1,53%	-0,53%	1,64%	11,53%	-4,60%	4,22%
Outubro	420.952.004,80	51.193.207,81	51.885.583,42	411.816.677,45	-8.442.951,74	-10.611.188,29	-2,01%	-2,53%	1,71%	13,44%	-18,80%	5,02%
Novembro	411.816.677,45	11.203.181,55	12.036.070,65	412.356.885,61	1.373.097,26	-9.238.091,03	0,33%	-2,20%	1,41%	15,03%	-14,64%	4,15%
Dezembro	412.356.885,61	15.423.034,56	14.648.781,24	420.638.778,11	7.507.639,18	-1.730.451,85	1,82%	-0,42%	1,25%	16,47%	-2,57%	3,80%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

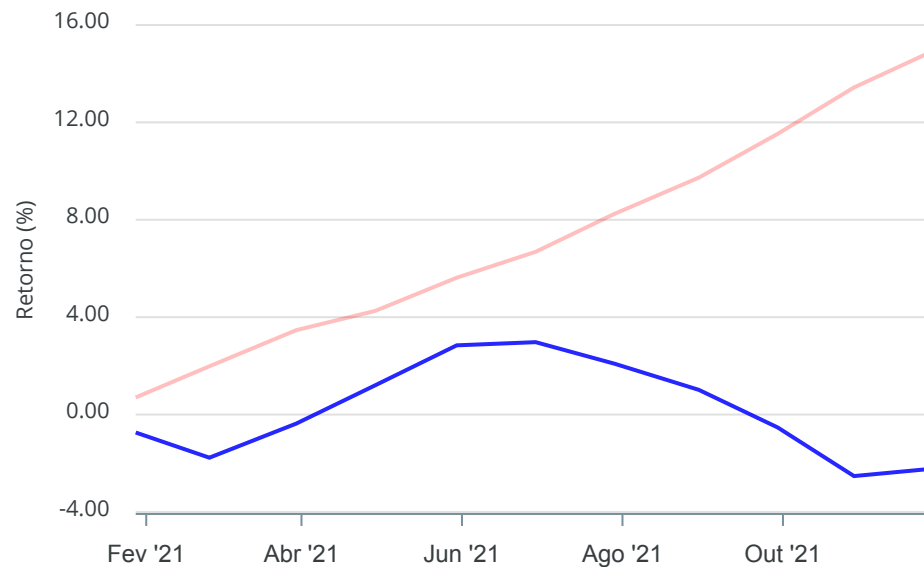


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 SMLL 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 SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.175.522,72	0,00	4.241.593,80	0,00	66.071,08	1,58%	1,88%	1,98%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.421.341,79	0,00	0,00	3.472.813,56	51.471,77	1,50%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	138.831,38	0,00	0,00	140.009,44	1.178,06	0,85%	0,85%	0,20%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	3.855.818,54	0,00	0,00	3.887.765,64	31.947,10	0,83%	0,83%	0,17%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	14.583.015,92	0,00	0,00	14.697.173,63	114.157,71	0,78%	0,78%	0,70%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	62.128.115,87	9.543,08	5.000.000,00	57.616.023,88	478.364,93	0,77%	0,83%	0,23%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.318.569,88	0,00	0,00	17.450.574,95	132.005,07	0,76%	0,76%	1,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	24.961.170,25	0,00	103.147,15	25.033.811,54	175.788,44	0,70%	0,71%	1,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	67.316.200,63	10.413.491,48	5.297.750,79	72.933.649,93	501.708,61	0,65%	0,72%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.321.789,68	0,00	0,00	13.395.586,77	73.797,09	0,55%	0,55%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.050.074,72	0,00	0,00	1.052.272,99	2.198,27	0,21%	0,21%	2,16%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.552.259,97	0,00	0,00	15.584.441,21	32.181,24	0,21%	0,21%	2,16%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.511.141,24	0,00	0,00	2.514.348,05	3.206,81	0,13%	0,16%	0,50%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.482.036,32	0,00	0,00	1.483.661,04	1.624,72	0,11%	0,11%	0,48%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	32.143.670,57	0,00	0,00	32.141.867,24	-1.803,33	-0,01%	-0,01%	0,90%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.712.116,23	0,00	0,00	1.708.569,56	-3.546,67	-0,21%	-0,21%	0,17%
Total Renda Fixa	265.671.675,71	10.423.034,56	14.642.491,74	263.112.569,43	1.660.350,90	0,62%		0,88%

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 - ...	1.129.032,10	0,00	0,00	1.787.095,97	658.063,87	58,29%	58,29%	30,71%
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	951.751,10	0,00	6.289,50	1.149.540,90	204.079,30	21,44%	20,78%	13,12%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	15.962.764,58	0,00	0,00	17.496.697,08	1.533.932,50	9,61%	9,61%	11,29%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.158.386,57	5.000.000,00	0,00	9.904.025,26	745.638,69	8,14%	8,90%	10,17%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	6.671.102,92	0,00	0,00	7.041.010,45	369.907,53	5,54%	5,54%	7,93%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	12.628.944,05	0,00	0,00	13.198.474,39	569.530,34	4,51%	4,51%	8,77%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.338.618,60	0,00	0,00	8.688.327,57	349.708,97	4,19%	4,19%	9,49%
META VALOR FI AÇÕES	13.248.248,97	0,00	0,00	13.712.060,63	463.811,66	3,50%	3,50%	10,93%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.329.272,75	0,00	0,00	6.532.853,51	203.580,76	3,22%	3,22%	9,18%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6.514.581,57	0,00	0,00	6.718.985,40	204.403,83	3,14%	3,14%	8,05%
MULTINVEST FI AÇÕES	10.414.026,30	0,00	0,00	10.655.080,32	241.054,02	2,31%	2,31%	8,32%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.262.526,00	0,00	0,00	7.337.738,29	75.212,29	1,04%	1,04%	7,09%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	4.987.118,04	0,00	0,00	4.983.680,52	-3.437,52	-0,07%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	10.946.221,06	0,00	0,00	10.931.549,54	-14.671,52	-0,13%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.344.111,86	0,00	0,00	1.335.713,74	-8.398,12	-0,62%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.424.504,14	0,00	0,00	3.375.655,38	-48.848,76	-1,43%	-1,43%	10,52%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.404.953,54	0,00	0,00	7.249.768,26	-155.185,28	-2,10%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	121.716.164,15	5.000.000,00	6.289,50	132.098.257,21	5.388.382,56	4,25%		9,25%

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
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	11.046.057,53	0,00	0,00	11.360.418,45	314.360,92	2,85%	2,85%	8,80%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.866.640,96	0,00	0,00	9.017.612,37	150.971,41	1,70%	1,70%	8,95%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.056.347,26	0,00	0,00	5.049.920,65	-6.426,61	-0,13%	-0,13%	9,64%
Total Exterior	24.969.045,75	0,00	0,00	25.427.951,47	458.905,72	1,84%		9,02%

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	61.235.829,04	35.429.902,95	24.888.117,12	72.933.649,93	1.156.035,06	1,20%	1,82%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.991.577,00	0,00	0,00	3.472.813,56	481.236,56	16,09%	16,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	24.440.764,48	370.287,60	234.487,19	25.033.811,54	457.246,65	1,84%	1,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	87.183.948,07	19.233,37	30.000.000,00	57.616.023,88	412.842,44	0,47%	1,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	17.118.806,81	0,00	0,00	17.450.574,95	331.768,14	1,94%	1,94%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	21.492.957,57	0,00	7.000.000,00	14.697.173,63	204.216,06	0,95%	1,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.562.927,33	0,00	370.287,60	13.395.586,77	202.947,04	1,50%	1,53%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.431.820,08	0,00	0,00	15.584.441,21	152.621,13	0,99%	0,99%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	32.000.000,00	0,00	32.141.867,24	141.867,24	0,44%	1,82%
INFINITY LÔTUS FI RENDA FIXA LP	3.820.831,58	0,00	0,00	3.887.765,64	66.934,06	1,75%	1,75%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.176.348,23	0,00	4.241.593,80	0,00	65.245,57	1,56%	1,86%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.494.384,82	0,00	0,00	2.514.348,05	19.963,23	0,80%	0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.041.848,95	0,00	0,00	1.052.272,99	10.424,04	1,00%	1,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	138.498,68	0,00	0,00	140.009,44	1.510,76	1,09%	1,09%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.787.279,28	0,00	5.786.722,23	0,00	-557,05	-0,01%	1,31%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.714.910,35	0,00	0,00	1.708.569,56	-6.340,79	-0,37%	-0,37%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.491.395,98	0,00	0,00	1.483.661,04	-7.734,94	-0,52%	-0,52%
				Total Renda Fixa	3.690.225,20	1,11%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	6.229.822,56	0,00	0,00	7.041.010,45	811.187,89	13,02%	13,02%
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.082.213,30	0,00	16.772,00	1.149.540,90	84.099,60	7,77%	5,39%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.354.465,24	0,00	32.455,37	1.335.713,74	13.703,87	1,01%	-
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.193.108,30	0,00	0,00	13.198.474,39	5.366,09	0,04%	0,04%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	10.971.791,30	0,00	0,00	10.931.549,54	-40.241,76	-0,37%	-0,37%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.034.278,94	0,00	0,00	4.983.680,52	-50.598,42	-1,01%	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	9.904.025,26	-95.974,74	-0,96%	-2,74%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.422.616,82	0,00	0,00	7.249.768,26	-172.848,56	-2,33%	-0,24%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.064.515,84	0,00	0,00	1.787.095,97	-277.419,87	-13,44%	-13,44%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.618.299,20	0,00	0,00	7.337.738,29	-280.560,91	-3,68%	-3,68%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.057.823,29	0,00	3.000.000,00	6.718.985,40	-338.837,89	-3,37%	-4,45%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.898.875,99	0,00	0,00	6.532.853,51	-366.022,48	-5,31%	-5,31%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.752.621,66	0,00	3.000.000,00	3.375.655,38	-376.966,28	-5,58%	-11,46%
META VALOR FI AÇÕES	14.289.250,25	0,00	0,00	13.712.060,63	-577.189,62	-4,04%	-4,04%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	9.520.565,36	0,00	0,00	8.688.327,57	-832.237,79	-8,74%	-8,74%
MULTINVEST FI AÇÕES	11.726.051,87	0,00	0,00	10.655.080,32	-1.070.971,55	-9,13%	-9,13%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	18.621.008,46	0,00	0,00	17.496.697,08	-1.124.311,38	-6,04%	-6,04%
Total Renda Variável					-4.689.823,80	-3,43%	

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
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	10.363.622,00	0,00	0,00	11.360.418,45	996.796,45	9,62%	9,62%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.065.034,08	0,00	0,00	9.017.612,37	952.578,29	11,81%	11,81%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.561.912,09	0,00	0,00	5.049.920,65	-511.991,44	-9,21%	-9,21%
				Total Exterior	1.437.383,30	5,99%	

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...	32.638.133,89	113.905.504,39	76.305.488,37	72.933.649,93	2.695.500,02	1,84%	4,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	32.152.038,24	721.335,53	9.035.980,00	25.033.811,54	1.196.417,77	3,64%	4,65%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	17.345.922,03	0,00	14.303.907,60	3.887.765,64	845.751,21	4,88%	11,79%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.736.162,61	0,00	0,00	17.450.574,95	714.412,34	4,27%	4,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.532.003,27	0,00	721.335,53	13.395.586,77	584.919,03	4,32%	4,44%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	10.398.069,91	0,00	10.698.085,37	0,00	300.015,46	2,89%	12,47%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,00	32.000.000,00	0,00	32.141.867,24	141.867,24	0,44%	6,77%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2.255.564,51	0,00	2.299.491,34	0,00	43.926,83	1,95%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.374.618,31	0,00	3.390.343,15	0,00	15.724,84	0,47%	4,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	136.327,52	0,00	0,00	140.009,44	3.681,92	2,70%	2,70%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.534.963,18	0,00	0,00	2.514.348,05	-20.615,13	-0,81%	-0,81%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.504.281,11	0,00	0,00	1.483.661,04	-20.620,07	-1,37%	-1,37%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.879.677,65	0,00	5.786.722,23	0,00	-92.955,42	-1,58%	-0,29%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.336.908,86	0,00	4.241.593,80	0,00	-95.315,06	-2,20%	-1,91%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.595.170,21	0,00	9.433.490,14	0,00	-161.680,07	-1,69%	-1,47%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	25.884.925,62	0,00	11.000.000,00	14.697.173,63	-187.751,99	-0,73%	-0,16%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.817.903,28	0,00	0,00	15.584.441,21	-233.462,07	-1,48%	-1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.815.337,53	0,00	13.466.701,11	1.052.272,99	-296.363,43	-2,00%	-1,53%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.353.345,81	0,00	196.833,60	1.708.569,56	-447.942,65	-19,03%	-27,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	82.657.100,96	11.083.094,21	35.505.127,85	57.616.023,88	-619.043,44	-0,66%	-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
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	5.105.118,29	0,00	0,00	3.472.813,56	-1.632.304,73	-31,97%	-31,97%
				Total Renda Fixa	2.734.162,60	0,60%	

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
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.295.775,72	0,00	0,00	17.496.697,08	5.200.921,36	42,30%	42,30%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,00	6.000.000,00	0,00	7.041.010,45	1.041.010,45	17,35%	32,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.840.491,66	0,00	3.856.472,50	0,00	15.980,84	0,42%	4,47%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	10.412.081,55	0,00	3.000.000,00	7.337.738,29	-74.343,26	-0,71%	-2,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.279.644,53	0,00	0,00	13.198.474,39	-81.170,14	-0,61%	-0,61%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	9.904.025,26	-95.974,74	-0,96%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	4.982.385,10	101.911,77	0,00	4.983.680,52	-100.616,35	-1,98%	-
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.299.470,60	0,00	48.579,50	1.149.540,90	-101.350,20	-7,80%	-11,21%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.489.844,20	0,00	51.928,59	1.335.713,74	-102.201,87	-6,86%	-
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	11.237.325,46	0,00	144.024,16	10.931.549,54	-161.751,76	-1,44%	1,83%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.515.471,54	0,00	0,00	7.249.768,26	-265.703,28	-3,54%	-1,47%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.854.952,86	0,00	0,00	6.532.853,51	-322.099,35	-4,70%	-4,70%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.258.064,20	0,00	10.819,34	1.787.095,97	-460.148,89	-20,38%	295,71%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	10.180.707,48	0,00	3.000.000,00	6.718.985,40	-461.722,08	-4,54%	-5,60%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.728.770,78	0,00	3.000.000,00	3.375.655,38	-1.353.115,40	-17,51%	-22,64%
MULTINVEST FI AÇÕES	12.338.276,31	0,00	0,00	10.655.080,32	-1.683.195,99	-13,64%	-13,64%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	10.642.848,84	0,00	0,00	8.688.327,57	-1.954.521,27	-18,36%	-18,36%
META VALOR FI AÇÕES	21.639.397,17	0,00	3.000.000,00	13.712.060,63	-4.927.336,54	-22,77%	-23,92%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Variável	-5.887.338,47	-3,82%	

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
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	0,00	10.005.227,45	0,00	11.360.418,45	1.355.191,00	13,54%	30,95%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	8.000.000,00	0,00	9.017.612,37	1.017.612,37	12,72%	30,51%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	6.000.000,00	0,00	5.049.920,65	-950.079,35	-15,83%	-5,09%
				Total Exterior	1.422.724,02	5,93%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma **OPINIÃO** que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.