

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
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 CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC...	D+2	22 meses	4.941.771,98	0,33%	668	4,43%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC ...	D+2 du	Não há	14.281.178,82	0,96%		0,00%	Artigo 10º, Inciso I
MAG FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.981.316,10	0,40%	32	5,15%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	10.017.411,96	0,68%	22	7,93%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	3.005.223,59	0,20%	22	2,38%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	40.373.354,40	2,72%	61.312	1,77%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTIESTRATÉ...	Não se ...	Não se aplica	480.129,99	0,03%	21	0,22%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	7.681.332,93	0,52%	99	0,70%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	Não se ...	Não se aplica	1.870.910,08	0,13%	39	0,40%	Artigo 10º, Inciso II
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIES...	Não se ...	Não se aplica	3.395.061,80	0,23%	39	2,66%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	4.983.873,47	0,34%		13,94%	Artigo 10º, Inciso II
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I F...	Não se ...	Não se aplica	19.916.013,98	1,34%		1,33%	Artigo 10º, Inciso II
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGI...	Não se ...	Não se aplica	6.079.979,27	0,41%	46	3,45%	Artigo 10º, Inciso II
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	4.589.311,16	0,31%		5,83%	Artigo 11º
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	Não se ...	Não se aplica	4.050.000,00	0,27%		4,09%	Artigo 11º
TÍTULOS PÚBLICOS			381.686.668,93	25,76%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.707.603,89	1,40%	549	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	38.446.655,66	2,59%	787	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	14.032.144,30	0,95%	532	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	28.255.756,49	1,91%	941	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	50.031.951,90	3,38%	1.021	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	11.955.913,25	0,81%	325	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	28.667.773,37	1,93%	30	3,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	20.357.424,24	1,37%	54	3,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	74.399.762,39	5,02%	169	6,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	36.942.179,78	2,49%	168	3,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	11.796.727,14	0,80%	22	1,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	14.386.433,48	0,97%	9.500	2,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	16.661.541,53	1,12%	7.028	2,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	6.821.836,51	0,46%	1.395	13,75%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	37.822.212,92	2,55%	583	0,90%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.695.395,27	0,92%	239	1,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	31.609.660,06	2,13%	163	2,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.301.233,71	1,30%	110	2,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	14.929.242,30	1,01%	285	0,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	9.506.163,31	0,64%	248	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI...	D+3	Não há	2.481.176,57	0,17%	1.549	1,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	18.030.614,90	1,22%	470	1,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	D+45 a ...	01/08/2016	8.976.774,42	0,61%		0,57%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	8.213,29	0,00%	28	4,29%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

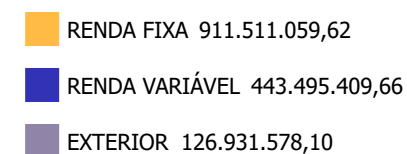
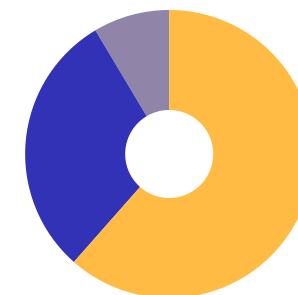
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%	11	100,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	36.550.201,74	2,47%	12	4,01%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.094.425,45	0,75%	7.004	2,61%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	44.891.378,45	3,03%	5.376	2,25%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	9.708.211,79	0,66%	34	0,49%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	11.538.357,75	0,78%	7.848	2,58%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.878.979,13	0,13%	4.834	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	14.722.455,42	0,99%	176	1,47%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	33.769.710,35	2,28%	132	4,63%	Artigo 8º, Inciso I
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.879.221,97	0,60%	5.243	0,83%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	14.129.598,07	0,95%	266	4,60%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	28.791.321,34	1,94%	33.381	0,89%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.599.263,99	0,45%	49	0,80%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	25.955.971,62	1,75%	105	3,16%	Artigo 8º, Inciso I
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	D+17	Não há	30.074.266,68	2,03%	10.179	0,81%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	13.643.406,87	0,92%	2.827	1,15%	Artigo 8º, Inciso I
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.546.326,38	0,10%	2.012	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	D+32	Não há	8.014.253,67	0,54%	33	0,95%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.160.735,52	0,28%	37	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.900.453,94	0,40%	1.793	5,06%	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
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	21.719.980,21	1,47%	90	1,15%	Artigo 9º, Inciso II
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVES...	D+5 du	Não há	14.994.244,62	1,01%	4.246	4,13%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	26.418.186,52	1,78%	12.913	2,45%	Artigo 9º, Inciso II
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR...	D+6 du	Não há	4.840.101,31	0,33%	4.730	2,18%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	17.297.193,44	1,17%	13.768	0,94%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	5.944.441,16	0,40%	557	1,79%	Artigo 9º, Inciso II
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR I...	D+5 du	Não há	5.194.530,68	0,35%	1.017	2,77%	Artigo 9º, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	30.522.900,16	2,06%	143.847	0,87%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		834.217,86	0,06%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.481.938.047,38				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			834.217,86				Artigo 6º
PL Total			1.482.772.265,24				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	381.686.668,93	25,76%	17,00%	30,00%	100,00%	1.100.251.378,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	366.641.867,42	24,74%	20,00%	27,00%	100,00%	1.115.296.179,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	154.197.535,55	10,41%	1,00%	2,00%	60,00%	734.965.292,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	296.387.609,48
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	296.387.609,48
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	8.984.987,72	0,61%	1,00%	1,00%	3,00%	35.473.153,70
Total Renda Fixa	100,00%	911.511.059,62	61,51%	39,00%	62,00%	303,00%	



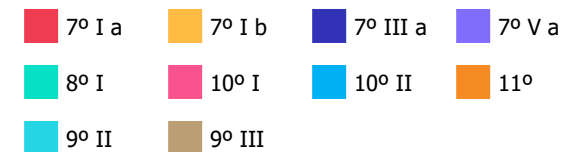
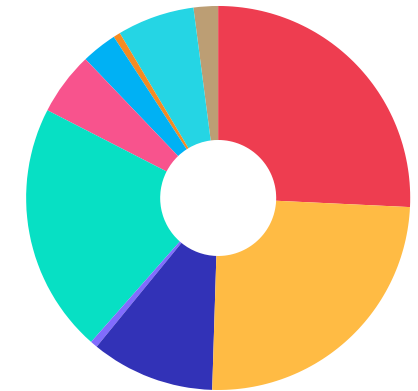
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	311.848.540,13	21,04%	6,00%	20,00%	35,00%	206.829.776,45
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	35,00%	518.678.316,58
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	78.600.256,85	5,30%	1,00%	3,00%	10,00%	69.593.547,89
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	44.407.301,52	3,00%	1,00%	3,00%	5,00%	29.689.600,85
Artigo 11º	5,00%	8.639.311,16	0,58%	1,00%	0,00%	1,00%	6.180.069,31
Total Renda Variável	35,00%	443.495.409,66	29,93%	9,00%	27,00%	86,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	96.408.677,94	6,51%	1,00%	7,00%	10,00%	51.785.126,80
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	30.522.900,16	2,06%	1,00%	3,00%	10,00%	117.670.904,58
Total Exterior	10,00%	126.931.578,10	8,57%	2,00%	10,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	381.686.668,93	25,76	-
CAIXA DTVM	172.887.980,51	11,67	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	158.466.477,65	10,69	0,04
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	157.962.350,00	10,66	0,01
WESTERN ASSET	107.746.571,39	7,27	0,21
ITAÚ UNIBANCO	78.383.054,34	5,29	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	72.515.852,20	4,89	0,24
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	50.910.893,77	3,44	0,01
ICATU VANGUARDA	37.546.995,34	2,53	0,08
ARX INVESTIMENTOS	36.550.201,74	2,47	0,07
XP ASSET MANAGEMENT	31.258.287,83	2,11	0,23
MOAT CAPITAL	30.074.266,68	2,03	0,28
KINEA INVESTIMENTOS	24.899.887,45	1,68	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	20.357.424,24	1,37	0,01
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	14.826.283,94	1,00	0,01
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	14.386.433,48	0,97	0,04
OCCAM BRASIL	13.643.406,87	0,92	0,05
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	13.022.635,55	0,88	3,80
VINCI PARTNERS	10.240.714,79	0,69	0,01
OLIVEIRA TRUST	8.976.774,42	0,61	0,07
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	8.462.492,67	0,57	0,09
TARPON INVESTIMENTOS	8.014.253,67	0,54	0,13
ITAÚ DTVM	6.599.263,99	0,45	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.944.441,16	0,40	0,08
XP GESTÃO DE RECURSOS	5.900.453,94	0,40	0,00
BV ASSET	4.589.311,16	0,31	0,01

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 '	381.686.668,93	25,76	17,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	366.641.867,42	24,74	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	154.197.535,55	10,41	1,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	8.984.987,72	0,61	1,00	3,00
Artigo 8º, Inciso I	311.848.540,13	21,04	6,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	96.408.677,94	6,51	1,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	30.522.900,16	2,06	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	75.595.033,26	5,10	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	44.407.301,52	3,00	1,00	5,00
Artigo 11º	8.639.311,16	0,58	1,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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
CDI + 1,20% ao ano (Benchmark)	0,83%	0,83%	2,41%	4,10%	6,26%	10,25%	-	-
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	0,94%	0,94%	2,74%	4,77%	7,63%	12,63%	-	-

IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,10%	0,10%	2,87%	1,16%	1,16%	5,07%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	0,04%	2,70%	0,57%	0,19%	4,21%	1,02%	0,03%

CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	1,02%	1,02%	2,99%	5,28%	8,68%	15,29%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-11,22%	-11,22%	-22,80%	-45,99%	-68,64%	-70,61%	-	0,15%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	0,09%	3,35%	3,20%	4,32%	11,89%	0,99%	0,03%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,10%	0,10%	3,37%	3,22%	4,37%	12,03%	0,98%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,08%	0,08%	3,33%	3,12%	4,25%	11,85%	1,00%	0,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	3,34%	3,06%	3,76%	11,27%	0,98%	0,03%
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%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	0,09%	0,09%	3,38%	3,16%	4,17%	11,58%	0,99%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	-0,73%	-0,73%	2,94%	-0,91%	-1,15%	4,02%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,76%	-0,76%	2,89%	-1,02%	-1,38%	3,29%	2,01%	0,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,74%	-0,74%	2,81%	-1,28%	-2,06%	2,77%	1,93%	0,05%

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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,76%	-0,76%	2,84%	-1,05%	-1,38%	3,43%	2,05%	0,05%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-1,03%	-1,03%	2,01%	-3,48%	-4,53%	0,32%	2,28%	0,06%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,65%	-0,65%	1,84%	-4,57%	-5,48%	-1,24%	1,97%	0,06%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	-0,76%	-0,76%	2,87%	-1,03%	-1,41%	3,20%	2,01%	0,05%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	-0,82%	-0,82%	2,98%	-1,19%	-1,69%	3,30%	2,13%	0,05%
IRF-M (Benchmark)	-0,08%	-0,08%	3,63%	-0,03%	-1,28%	3,58%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,13%	-0,13%	3,58%	-0,22%	-1,62%	2,96%	1,67%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	-0,07%	3,64%	-0,11%	-1,50%	3,17%	1,65%	0,04%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,05%	-0,05%	3,60%	-0,06%	-1,41%	3,08%	1,65%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,80%	0,80%	2,25%	3,87%	5,65%	7,66%	0,03%	0,01%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	0,00%	900,00%	0,00%	-	-	-	-
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	0,85%	0,85%	2,82%	1,83%	2,08%	4,27%	0,49%	0,02%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,52%	0,52%	3,06%	3,87%	4,94%	7,72%	0,38%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	0,19%	2,51%	1,24%	1,20%	-	0,76%	0,03%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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
IPCA + 15,00% ao ano (Benchmark)	1,72%	1,72%	5,93%	13,33%	26,94%	52,38%	-	-
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	-0,09%	-0,09%	-0,27%	-0,58%	-14,66%	-	0,00%	0,31%
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%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,19%	1,19%	4,25%	9,80%	19,21%	34,49%	-	-
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,07%	-0,07%	42,51%	39,16%	37,59%	-	0,34%	0,43%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,11%	1,11%	4,01%	9,29%	18,11%	32,03%	-	-
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	-9,80%	-9,80%	16,65%	6,33%	-91,16%	-93,47%	37,71%	0,43%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	1,03%	3,76%	8,77%	17,00%	29,59%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGI...	4,11%	4,11%	2,83%	-0,12%	28,25%	-	-	-
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTIESTRATÉGIA	-1,46%	-1,46%	-2,11%	-2,25%	12,15%	-	-	0,27%
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,54%	-0,54%	-1,61%	-	-	-	-	-
MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-8,96%	-8,96%	-6,08%	3,40%	14,87%	70,60%	9,85%	0,17%

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
IDIV (Benchmark)	7,47%	7,47%	10,17%	0,27%	5,96%	1,18%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	8,81%	8,81%	9,74%	-3,09%	1,20%	-1,16%	7,87%	0,16%

IBX (Benchmark)	6,87%	6,87%	8,36%	-9,14%	-2,11%	-0,51%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,64%	2,64%	0,83%	-14,35%	-5,47%	-15,82%	9,39%	0,15%

Ibovespa (Benchmark)	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-	-	-	-	-	-	0,00%	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6,43%	6,43%	6,34%	-12,24%	-9,03%	-9,86%	10,20%	0,17%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,40%	2,40%	-1,33%	-22,16%	-17,81%	-28,46%	12,43%	0,17%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,48%	9,48%	10,23%	-8,18%	-4,17%	-6,79%	8,76%	0,19%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,08%	6,08%	9,71%	-0,17%	3,01%	-2,03%	6,79%	0,15%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,00%	5,00%	-2,71%	-28,15%	-27,93%	-24,27%	14,57%	0,19%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	7,72%	7,72%	5,42%	-12,07%	-7,60%	-16,70%	8,08%	0,17%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,00%	7,00%	6,80%	-5,23%	-1,18%	-24,46%	10,28%	0,15%
OCCAM FIC AÇÕES	6,52%	6,52%	7,30%	-7,34%	-4,05%	-0,69%	8,11%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,16%	5,16%	2,66%	-20,19%	-10,21%	-32,32%	10,97%	0,20%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,87%	6,87%	5,50%	-11,03%	-9,08%	-21,38%	9,11%	0,16%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,34%	1,34%	0,85%	-14,76%	-5,90%	-11,63%	10,71%	0,14%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	7,32%	7,32%	11,23%	-7,28%	-3,54%	-4,85%	10,99%	0,17%

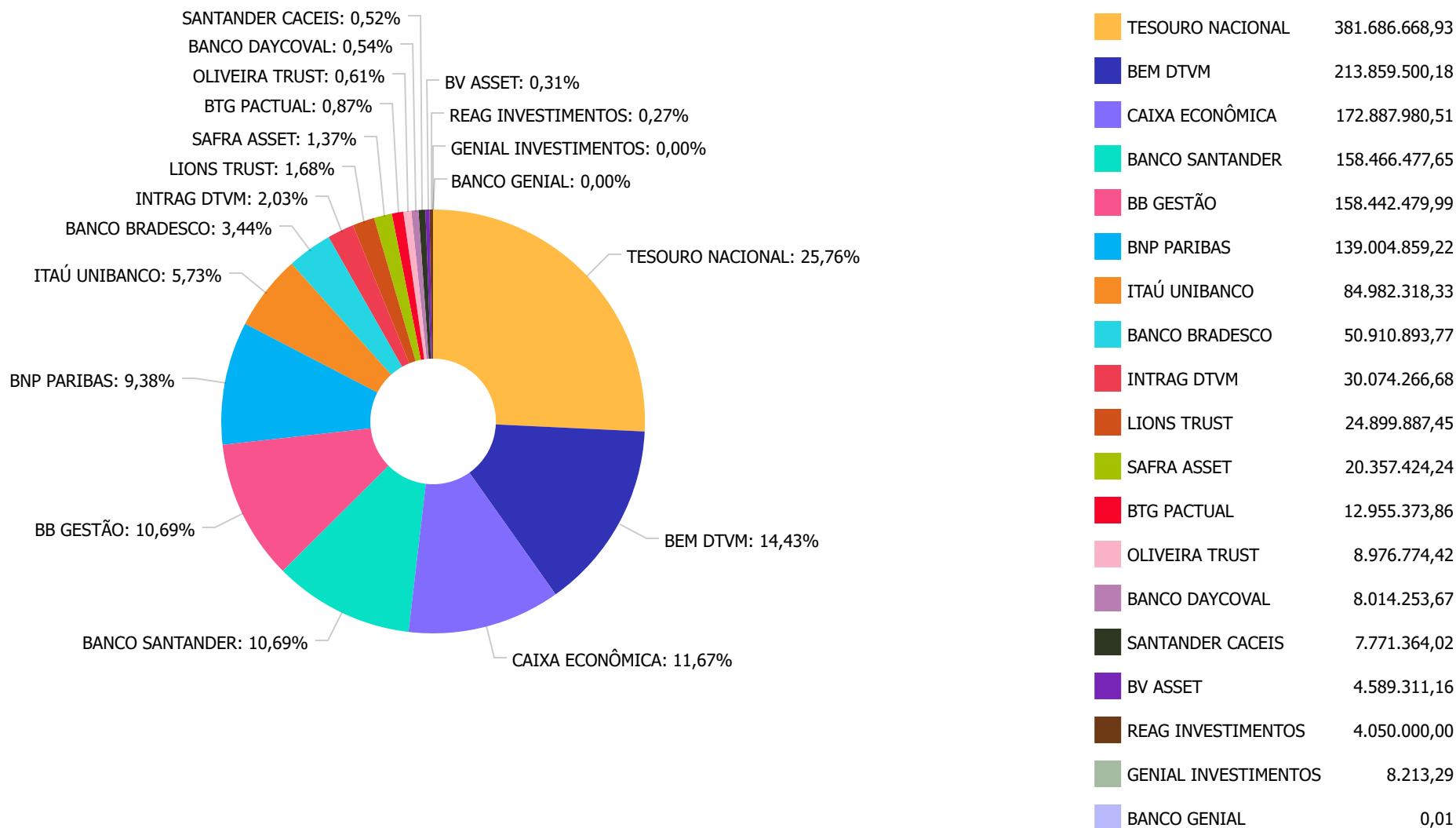
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,55%	2,55%	0,85%	-14,51%	-5,63%	-16,39%	8,85%	0,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC MULTIMERCADO	0,62%	0,62%	2,93%	3,43%	2,87%	-	0,61%	0,02%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	7,34%	7,34%	13,27%	-6,72%	-8,04%	-	12,33%	0,21%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,91%	6,91%	10,60%	-3,24%	3,16%	-	8,16%	0,17%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	1,34%	1,34%	2,99%	-5,01%	22,29%	44,02%	10,08%	0,19%
BB AGRO FIC AÇÕES	0,29%	0,29%	5,31%	-0,48%	-	-	7,97%	-
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
MAG FI MULTIMERCADO	0,64%	0,64%	2,69%	3,75%	3,77%	6,17%	0,44%	0,02%
IPCA + 9,50% ao ano (Benchmark)	1,30%	1,30%	4,62%	10,57%	20,87%	38,23%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉGIA	-0,06%	-0,06%	-0,20%	-0,33%	62,84%	-	0,01%	0,63%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,00%	0,00%	-0,08%	-1,00%	-1,10%	-	-	-
IFIX (Benchmark)	-0,99%	-0,99%	3,78%	-1,67%	-3,56%	-9,76%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	-1,98%	-1,98%	-19,45%	-24,77%	-42,54%	-59,66%	7,48%	0,37%

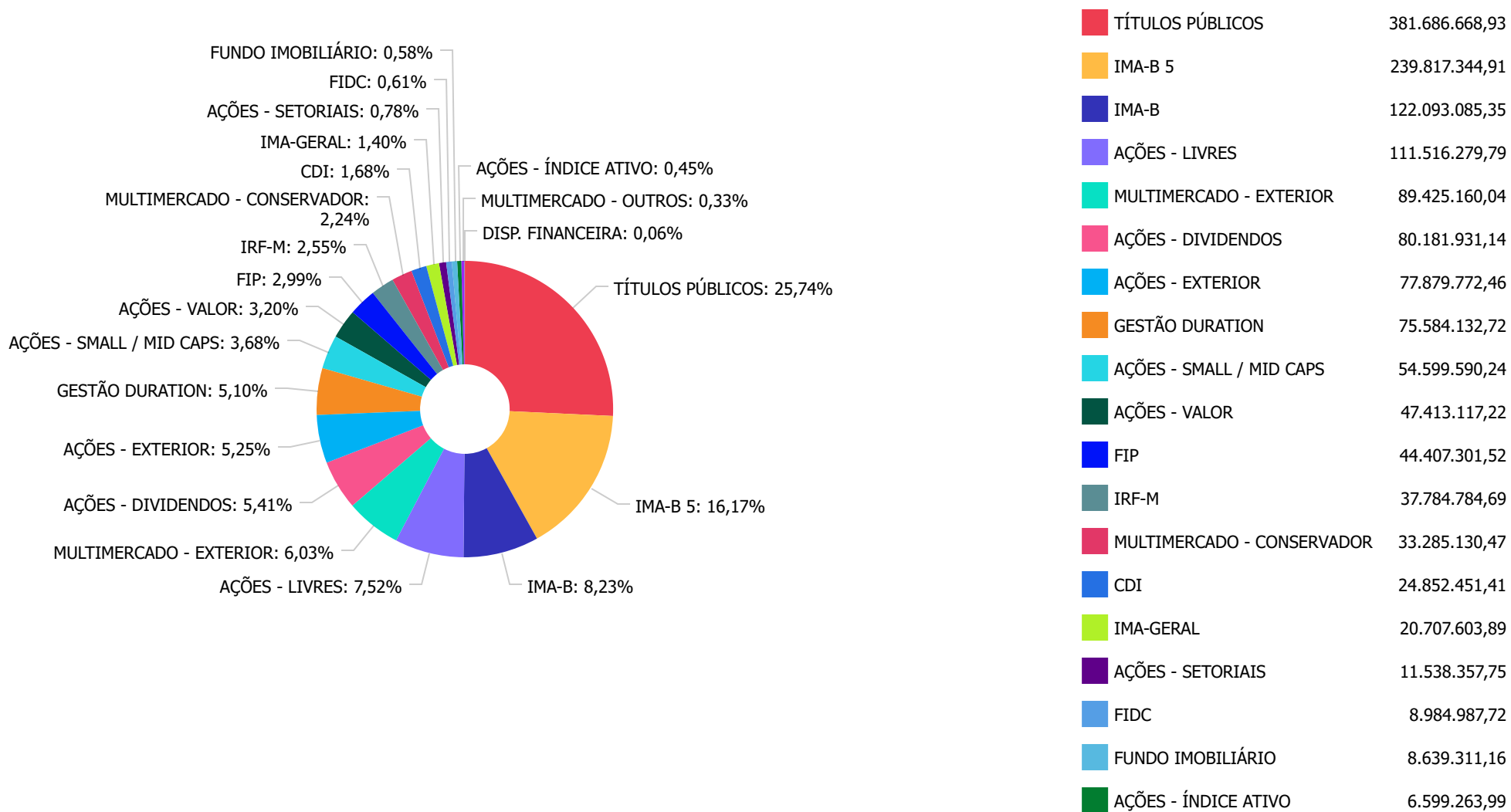
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%
MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
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%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-12,56%	-12,56%	-13,55%	-4,28%	2,36%	63,87%	6,78%	0,18%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-8,96%	-8,96%	-6,08%	3,40%	14,87%	70,60%	9,85%	0,17%
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERI...	-8,21%	-8,21%	-5,99%	0,56%	16,04%	43,64%	12,43%	0,15%
MSCI ACWI (Benchmark)	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	-11,14%	-11,14%	-11,79%	-1,79%	7,43%	-	8,16%	0,17%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTI...	-9,91%	-9,91%	-8,23%	3,95%	15,60%	61,33%	8,95%	0,19%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INVESTIMENTO NO EX...	-8,29%	-8,29%	-8,84%	-1,40%	-5,17%	23,75%	5,24%	0,12%

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



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



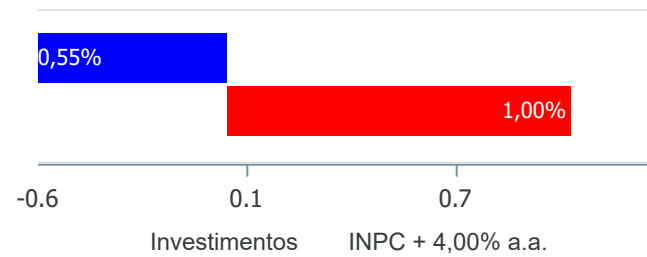
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/03/2015	2.000	2.593,340767	3.826,654562	5.186.681,53	7.653.309,12	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	31/05/2021	7.600	3825,999376	3.826,654562	29.077.595,26	29.082.574,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	06/12/2016	3.400	2.955,347610	3.992,917830	10.048.181,87	13.575.920,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	3.450	4246,781118	3.985,723856	14.651.394,86	13.750.747,30	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/03/2015	3.200	2.350,172187	3.985,723856	7.520.551,00	12.754.316,34	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/07/2018	4.000	3.271,849021	3.985,723856	13.087.396,08	15.942.895,42	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	6.000	4246,781118	3.985,723856	25.480.686,71	23.914.343,14	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	8.500	4246,781118	3.985,723856	36.097.639,50	33.878.652,78	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	31/05/2021	13.000	4246,781118	3.985,723856	55.208.154,53	51.814.410,13	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	10/09/2021	6.000	4116,569942	4.056,721121	24.699.419,65	24.340.326,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/10/2021	4.925	4060,982942	4.056,721121	20.000.340,99	19.979.351,52	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/10/2021	5.075	4060,982942	4.056,721121	20.609.488,43	20.587.859,69	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	12/01/2022	6.200	4033,623381	4.056,721121	25.008.464,96	25.151.670,95	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/09/2021	6.000	4224,624582	4.002,703611	25.347.747,49	24.016.221,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	21/10/2021	10.000	4151,227991	4.002,703611	41.512.279,91	40.027.036,11	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	12/01/2022	6.300	3974,360020	4.002,703611	25.038.468,13	25.217.032,75	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

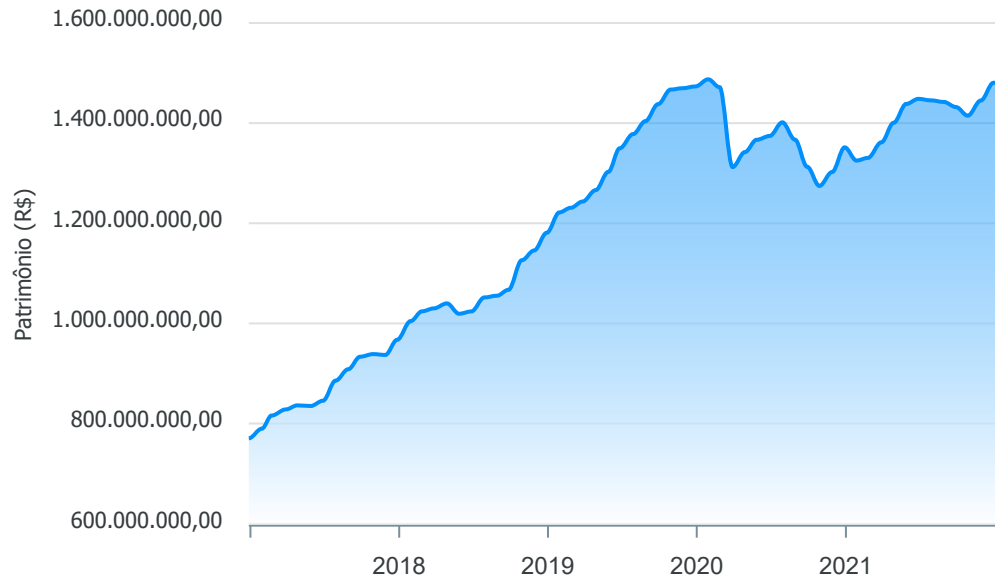
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.480.445.742,30	93.754.754,50	84.025.627,49	1.481.938.047,38	-8.236.821,93	-8.236.821,93	-0,55%	-0,55%	1,00%	1,00%	-55,30%	5,25%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

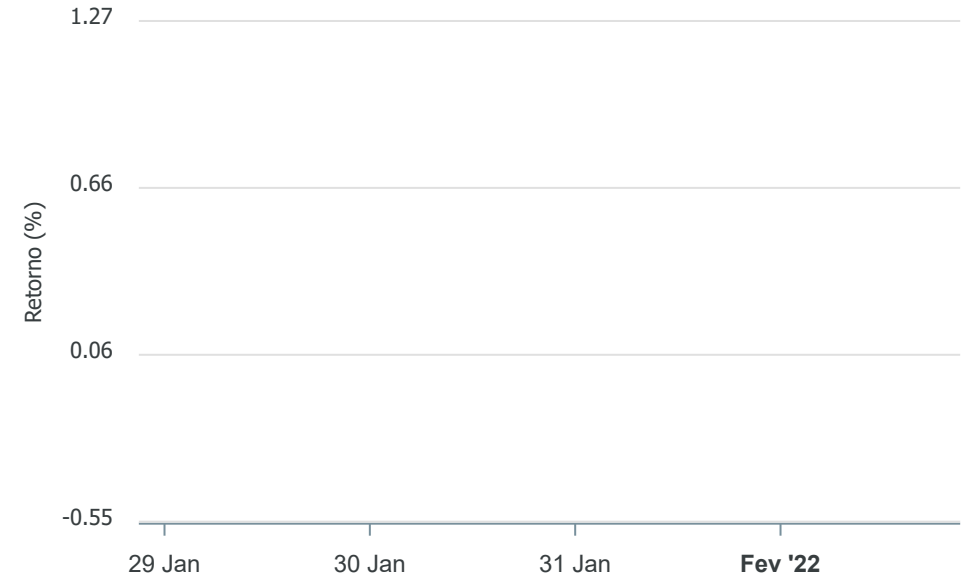


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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
CARTÃO DE COMPRA SUPPLIER FIDC SÊNIOR	8.893.199,02	0,00	0,00	8.976.774,42	83.575,40	0,94%	-	-
AZ QUEST YIELD FIC RENDA FIXA LP	6.764.114,04	0,00	0,00	6.821.836,51	57.722,47	0,85%	0,85%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	28.068.370,17	0,00	0,00	28.255.756,49	187.386,32	0,67%	0,67%	0,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	9.456.764,52	0,00	0,00	9.506.163,31	49.398,79	0,52%	0,52%	0,38%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	41.896.065,60	12.751.137,09	36.793.300,24	18.030.614,90	176.712,45	0,32%	0,80%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	37.750.189,13	0,00	0,00	37.822.212,92	72.023,79	0,19%	0,19%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	58.784.977,42	4.167.176,60	13.000.000,00	50.031.951,90	79.797,88	0,13%	0,09%	0,99%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	74.327.549,27	0,00	0,00	74.399.762,39	72.213,12	0,10%	0,10%	0,98%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RENDA FIXA LP	28.642.160,56	0,00	0,00	28.667.773,37	25.612,81	0,09%	0,09%	0,99%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	31.585.901,10	0,00	0,00	31.609.660,06	23.758,96	0,08%	0,08%	0,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	68.402.763,00	0,00	30.000.000,00	38.446.655,66	43.892,66	0,06%	0,08%	1,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.699.740,49	0,00	0,00	20.707.603,89	7.863,40	0,04%	0,04%	1,02%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.802.548,23	0,00	0,00	11.796.727,14	-5.821,09	-0,05%	-0,05%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.964.503,41	0,00	0,00	11.955.913,25	-8.590,16	-0,07%	-0,07%	1,65%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	14.050.026,72	0,00	0,00	14.032.144,30	-17.882,42	-0,13%	-0,13%	1,67%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.689.103,43	0,00	0,00	16.661.541,53	-27.561,90	-0,17%	-0,17%	1,47%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	14.480.439,16	0,00	0,00	14.386.433,48	-94.005,68	-0,65%	-0,65%	1,97%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	19.444.222,35	0,00	0,00	19.301.233,71	-142.988,64	-0,74%	-0,74%	1,93%
SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP	37.223.892,11	0,00	0,00	36.942.179,78	-281.712,33	-0,76%	-0,76%	2,01%

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
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.799.893,87	0,00	0,00	13.695.395,27	-104.498,60	-0,76%	-0,76%	2,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	15.044.091,78	0,00	0,00	14.929.242,30	-114.849,48	-0,76%	-0,76%	2,05%
MAG INFLAÇÃO IMA-B FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI L...	2.501.682,18	0,00	0,00	2.481.176,57	-20.505,61	-0,82%	-0,82%	2,13%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	20.568.822,36	0,00	0,00	20.357.424,24	-211.398,12	-1,03%	-1,03%	2,28%
TÍTULOS PÚBLICOS	336.594.427,97	50.046.933,09	0,00	381.686.668,93	-4.954.692,13	-1,28%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9.250,76	0,00	0,00	8.213,29	-1.037,47	-11,21%	-	-
Total Renda Fixa	929.444.698,66	66.965.246,78	79.793.300,24	911.511.059,62	-5.105.585,58	-0,55%		1,20%

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
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES IV FIC MU...	0,00	13.000.000,00	0,00	14.281.178,82	1.281.178,82	9,86%	0,00%	0,00%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	30.846.482,96	0,00	0,00	33.769.710,35	2.923.227,39	9,48%	9,48%	8,76%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	13.530.186,19	0,00	0,00	14.722.455,42	1.192.269,23	8,81%	8,81%	7,87%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.299.041,84	0,00	0,00	11.094.425,45	795.383,61	7,72%	7,72%	8,08%
MOAT CAPITAL ADVISORY FIC AÇÕES	28.018.927,98	0,00	0,00	30.074.266,68	2.055.338,70	7,34%	7,34%	12,33%
VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.876.934,58	0,00	0,00	4.160.735,52	283.800,94	7,32%	7,32%	10,99%
XP INVESTOR DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.514.485,84	0,00	0,00	5.900.453,94	385.968,10	7,00%	7,00%	10,28%
ARX INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	34.189.552,48	0,00	0,00	36.550.201,74	2.360.649,26	6,90%	6,90%	8,16%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.308.425,35	0,00	0,00	8.879.221,97	570.796,62	6,87%	6,87%	9,11%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.192.096,07	0,00	0,00	6.599.263,99	407.167,92	6,58%	6,43%	10,20%
OCCAM FIC AÇÕES	12.808.094,80	0,00	0,00	13.643.406,87	835.312,07	6,52%	6,52%	8,11%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.319.360,56	0,00	0,00	14.129.598,07	810.237,51	6,08%	6,08%	6,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	24.682.586,03	0,00	0,00	25.955.971,62	1.273.385,59	5,16%	5,16%	10,97%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.789.442,85	0,00	0,00	1.878.979,13	89.536,28	5,00%	5,00%	14,57%
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP...	19.129.373,94	0,00	0,00	19.916.013,98	786.640,04	4,11%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	43.737.015,19	0,00	0,00	44.891.378,45	1.154.363,26	2,64%	2,64%	9,39%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.466.439,59	0,00	0,00	9.708.211,79	241.772,20	2,55%	2,55%	8,85%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.510.047,71	0,00	0,00	1.546.326,38	36.278,67	2,40%	2,40%	12,43%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	7.908.058,95	0,00	0,00	8.014.253,67	106.194,72	1,34%	1,34%	10,08%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	28.410.100,85	0,00	0,00	28.791.321,34	381.220,49	1,34%	1,34%	10,71%

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
MAG FI MULTIMERCADO	5.943.316,71	0,00	0,00	5.981.316,10	37.999,39	0,64%	0,64%	0,44%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES III FIC M...	4.911.447,24	0,00	0,00	4.941.771,98	30.324,74	0,62%	0,62%	0,61%
BB AGRO FIC AÇÕES	11.504.945,61	0,00	0,00	11.538.357,75	33.412,14	0,29%	0,29%	7,97%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,00	10.000.000,00	0,00	10.017.411,96	17.411,96	0,17%	0,00%	0,00%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	4.983.680,50	0,00	0,00	4.983.873,47	192,97	0,00%	-	-
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP MULTISTRATÉ...	480.431,67	0,00	0,00	480.129,99	-301,68	-0,06%	-0,06%	0,01%
VINCI CAPITAL PARTNERS III II FIP MULTISTRATÉGIA	6.084.065,82	0,00	0,00	6.079.979,27	-4.086,55	-0,07%	-0,07%	0,34%
BTG PACTUAL II FICFIP INFRAESTRUTURA	1.872.516,34	0,00	0,00	1.870.910,08	-1.606,26	-0,09%	-0,09%	0,00%
BTG PACTUAL ECONOMIA REAL FIP MULTISTRATÉGIA	6.914.054,08	789.507,72	0,00	7.681.332,93	-22.228,87	-0,29%	-	-
BTG PACTUAL INVESTIMENTOS DE IMPACTO FIP MULTISTR...	3.413.446,79	0,00	0,00	3.395.061,80	-18.384,99	-0,54%	-	-
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	4.682.133,54	0,00	19.427,94	4.589.311,16	-73.394,44	-1,57%	-1,98%	7,48%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	4.302.068,88	0,00	4.169.899,31	0,00	-132.169,57	-3,07%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	42.591.154,96	0,00	0,00	40.373.354,40	-2.217.800,56	-5,21%	-5,21%	8,55%
REAG MULTI ATIVOS IMOBILIÁRIOS FII - RMAI11	4.490.000,00	0,00	43.000,00	4.050.000,00	-397.000,00	-8,84%	-9,80%	37,71%
Total Renda Variável	405.709.915,90	23.789.507,72	4.232.327,25	440.490.186,07	15.223.089,70	3,58%		8,63%

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
LEGG MASON CLEARBRIDGE US LARGE CAP GROWTH INVESTI...	16.334.442,18	0,00	0,00	14.994.244,62	-1.340.197,56	-8,20%	-8,20%	12,43%
WESTERN ASSET MACRO OPPORTUNITIES CLASSE DÓLAR INV...	5.664.063,54	0,00	0,00	5.194.530,68	-469.532,86	-8,29%	-8,29%	5,24%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	23.857.067,40	0,00	0,00	21.719.980,21	-2.137.087,19	-8,96%	-8,96%	9,85%
NEUBERGER BERMAN US MULTICAP OPPORTUNITIES DÓLAR A...	5.372.286,60	0,00	0,00	4.840.101,31	-532.185,29	-9,91%	-9,91%	8,95%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	6.689.685,90	0,00	0,00	5.944.441,16	-745.244,74	-11,14%	-11,14%	8,16%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	19.780.951,98	0,00	0,00	17.297.193,44	-2.483.758,54	-12,56%	-12,56%	6,78%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	35.429.903,21	0,00	0,00	30.522.900,16	-4.907.003,05	-13,85%	-13,85%	10,99%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	32.162.726,93	0,00	0,00	26.418.186,52	-5.744.540,41	-17,86%	-17,86%	16,91%
Total Exterior	145.291.127,74	0,00	0,00	126.931.578,10	-18.359.549,64	-12,64%		11,18%

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.