

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

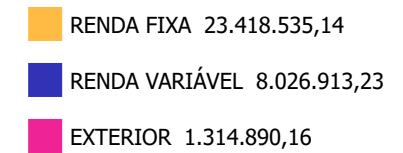
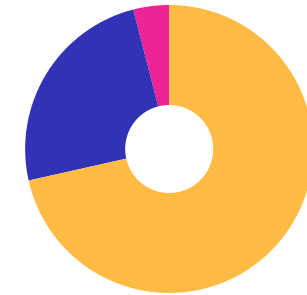
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.348.367,52	13,27%	1.034	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	868.984,14	2,65%	613	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	514.132,86	1,57%	181	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	463 dias	997.833,67	3,05%	142	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.019.032,73	3,11%	921	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.468.533,13	10,59%	1.024	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	680.742,00	2,08%	281	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.087.347,61	6,37%	1.220	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	43.014,59	0,13%	831	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	4.894.540,04	14,94%	934	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.261.034,92	3,85%	90	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	974.761,23	2,98%	265	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.114.180,23	3,40%	150	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	1.146.030,47	3,50%	43	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	938.932,67	2,87%	40.269	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	D+4	Não há	301.965,99	0,92%	10.247	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	800.975,14	2,44%	2.389	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	347.889,61	1,06%	14.601	0,19%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	38.143,22	0,12%	4.511	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	D+4	Não há	312.838,76	0,95%	6.535	0,22%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	628.214,57	1,92%	27.244	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	252.476,76	0,77%	45.862	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	269.697,02	0,82%	154	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	577.410,71	1,76%	8.980	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	183.593,67	0,56%	3.611	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	288.875,39	0,88%	17	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	625.325,13	1,91%	19.765	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	308.367,50	0,94%	38.634	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	505.842,03	1,54%	151	0,03%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	500.680,63	1,53%	528	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	263.494,49	0,80%	182.142	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	747.274,78	2,28%	133	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	130.119,11	0,40%	1.349	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.319.686,21	4,03%	1.118	0,06%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		5.575,53	0,02%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			32.760.338,53				
			5.575,53				Artigo 6º
PL Total			32.765.914,06				

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

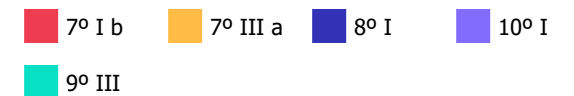
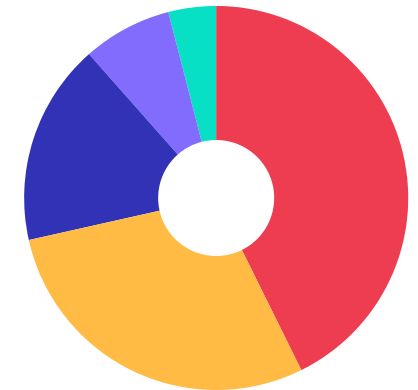
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	3.276.033,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	13.984.973,66	42,69%	0,00%	36,00%	100,00%	18.775.364,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	9.433.561,48	28,80%	0,00%	24,00%	60,00%	10.222.641,64
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	3.276.033,85
Total Renda Fixa	100,00%	23.418.535,14	71,48%	0,00%	65,00%	180,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5.566.338,64	16,99%	0,00%	15,00%	20,00%	985.729,07
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	3.276.033,85
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.460.574,59	7,51%	0,00%	9,00%	10,00%	815.459,26
Total Renda Variável	30,00%	8.026.913,23	24,50%	0,00%	25,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.314.890,16	4,01%	0,00%	10,00%	10,00%	1.961.143,69
Total Exterior	10,00%	1.314.890,16	4,01%	0,00%	10,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.368.179,89	46,91	0,00
CAIXA DTVM	10.662.265,06	32,55	-
ITAÚ UNIBANCO	6.441.018,19	19,66	0,00
ITAÚ DTVM	288.875,39	0,88	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	2,54%	3,88%	3,88%	5,80%	9,10%	18,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,62%	3,82%	3,82%	5,75%	8,64%	18,02%	1,43%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	3,56%	1,91%	1,91%	1,99%	0,35%	12,40%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,53%	1,88%	1,88%	1,73%	-0,11%	11,63%	4,23%	0,08%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,89%	2,28%	2,28%	3,43%	5,14%	7,77%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	2,22%	2,22%	3,33%	4,92%	7,31%	0,33%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,61%	3,81%	3,81%	5,92%	8,72%	17,96%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,59%	3,76%	3,76%	5,80%	8,48%	17,37%	1,34%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	3,07%	2,87%	2,87%	3,96%	4,50%	15,36%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,01%	2,76%	2,76%	3,77%	4,18%	14,69%	2,67%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,83%	2,18%	2,18%	3,79%	5,27%	6,45%	0,01%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,96%	2,57%	2,57%	4,55%	6,77%	9,24%	0,04%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,15%	2,48%	2,48%	4,35%	8,89%	12,01%	0,57%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,48%	2,84%	2,84%	5,09%	8,86%	11,63%	0,42%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	2,75%	2,75%	4,82%	7,41%	9,68%	0,05%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,43%	3,03%	3,03%	5,91%	-	-	0,54%	-
IPCA (Benchmark)	1,62%	3,20%	3,20%	6,25%	11,30%	18,09%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,82%	2,32%	2,32%	3,41%	2,39%	7,61%	0,34%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,41%	3,92%	3,92%	5,51%	8,74%	18,49%	1,03%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,40%	-	-	-	-	-	1,02%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	3,32%	-4,95%	-4,95%	5,17%	14,03%	75,29%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	4,72%	-3,48%	-3,48%	8,33%	18,36%	-	10,18%	0,14%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	4,58%	-3,11%	-3,11%	9,51%	20,44%	84,11%	10,49%	0,14%
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	0,19%
IDIV (Benchmark)	10,00%	15,48%	15,48%	13,37%	11,66%	55,59%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	9,76%	14,90%	14,90%	12,57%	10,05%	43,91%	9,24%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	6,06%	14,48%	14,48%	8,13%	2,89%	64,34%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	5,54%	4,83%	4,83%	-12,66%	-19,70%	19,01%	15,01%	0,18%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	4,00%	0,36%	0,36%	-3,17%	1,85%	94,23%	10,64%	0,15%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	5,60%	8,29%	8,29%	3,66%	-19,44%	1,12%	20,68%	0,26%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	6,68%	8,43%	8,43%	4,20%	5,07%	86,32%	11,16%	0,19%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,06%	11,50%	11,50%	8,04%	6,30%	87,48%	9,74%	0,14%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	5,51%	3,97%	3,97%	-6,58%	-11,61%	32,98%	9,45%	0,17%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,67%	7,76%	7,76%	6,56%	9,88%	76,28%	9,48%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	5,38%	10,79%	10,79%	-3,36%	-9,72%	44,56%	11,52%	0,18%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	8,06%	12,63%	12,63%	4,84%	8,67%	64,19%	8,70%	0,18%

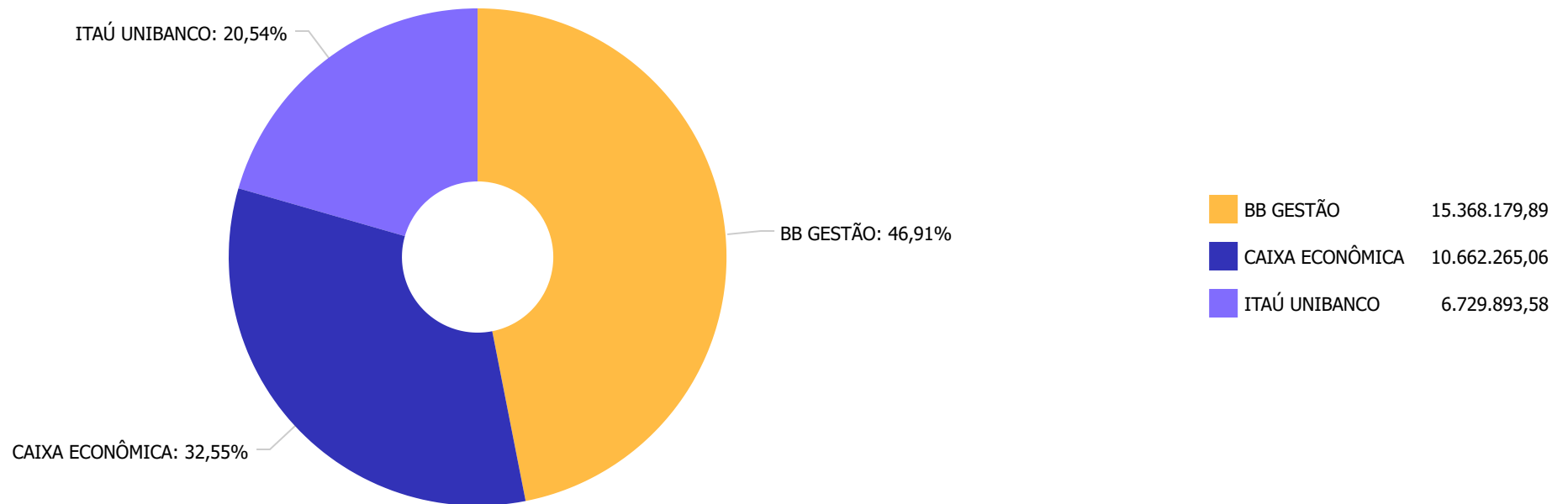
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,25%	8,72%	8,72%	5,96%	6,30%	67,64%	9,70%	0,12%
SMLL (Benchmark)	8,81%	6,69%	6,69%	-5,35%	-9,80%	48,46%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	7,11%	7,84%	7,84%	-2,95%	-4,41%	56,11%	12,11%	0,19%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,95%	2,39%	2,39%	4,25%	6,26%	10,94%	0,10%	0,01%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	-1,58%	-1,80%	-1,80%	0,93%	3,54%	-	2,07%	0,05%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,19%	4,61%	4,61%	5,56%	5,60%	22,32%	1,85%	0,04%

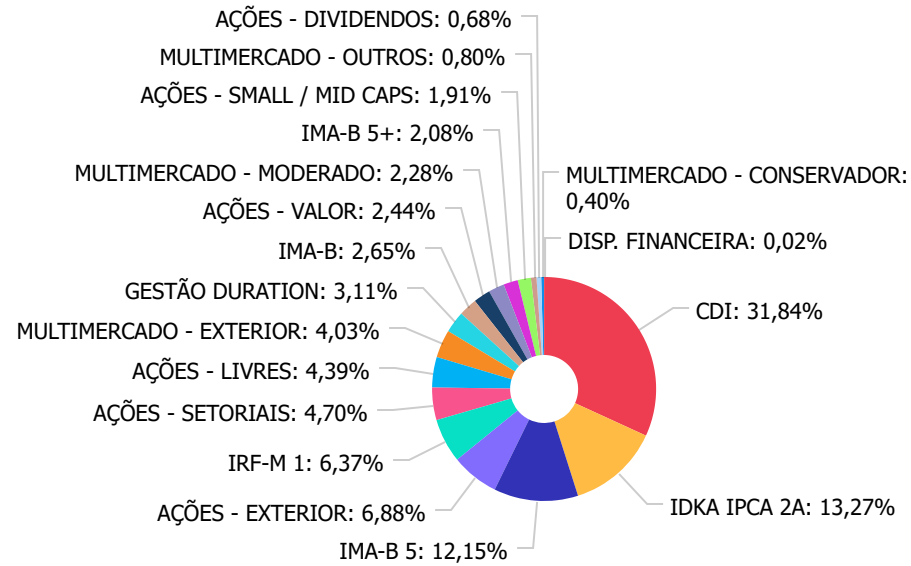
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2,79%	-3,26%	-3,26%	4,68%	10,71%	-	10,21%	0,11%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,24%	-19,26%	-19,26%	-9,18%	-5,10%	50,91%	11,07%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	0,19%

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



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

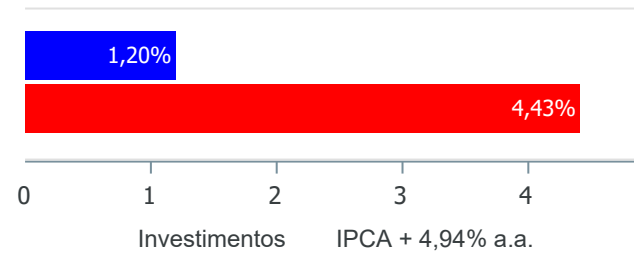


■ CDI	10.431.395,15	■ IDKA IPCA 2A	4.348.367,52	■ IMA-B 5	3.982.665,99
■ AÇÕES - EXTERIOR	2.253.822,83	■ IRF-M 1	2.087.347,61	■ AÇÕES - SETORIAIS	1.540.105,07
■ AÇÕES - LIVRES	1.439.263,74	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.319.686,21	■ GESTÃO DURATION	1.019.032,73
■ IMA-B	868.984,14	■ AÇÕES - VALOR	800.975,14	■ MULTIMERCADO - MODERADO	747.274,78
■ IMA-B 5+	680.742,00	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	625.325,13	■ MULTIMERCADO - OUTROS	263.494,49
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	221.736,89	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	130.119,11	■ DISP. FINANCEIRA	5.575,53

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

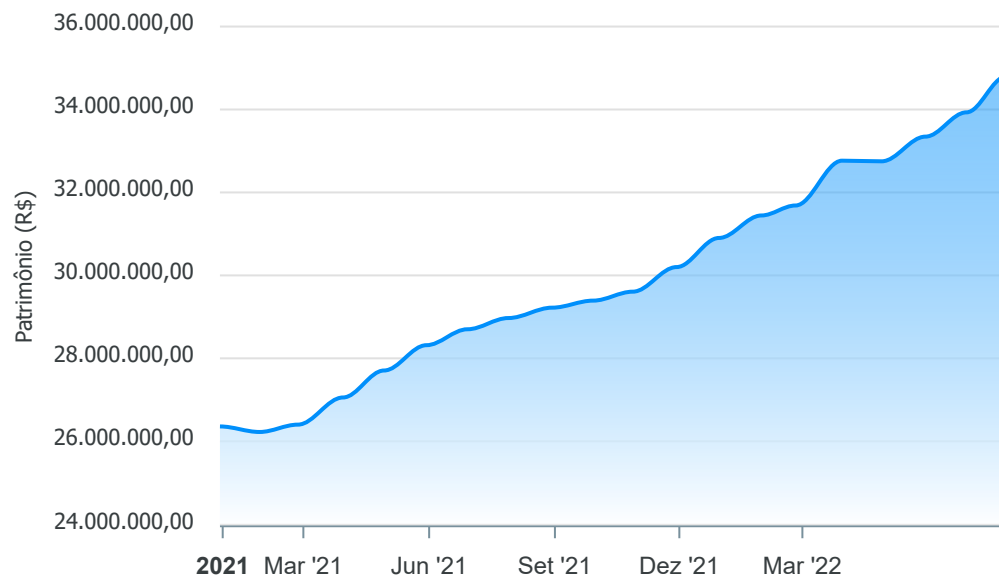
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	30.898.189,95	857.173,16	170.236,29	31.434.748,43	-150.378,39	-150.378,39	-0,48%	-0,48%	0,94%	0,94%	-50,39%	3,42%
Fevereiro	31.434.748,43	2.900.344,67	3.070.447,00	31.129.823,97	-134.822,13	-285.200,52	-0,43%	-0,90%	1,38%	2,34%	-38,66%	3,03%
Março	31.129.823,97	6.257.996,97	5.309.562,28	32.760.338,53	682.079,87	396.879,35	2,13%	1,20%	2,05%	4,43%	27,17%	3,51%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



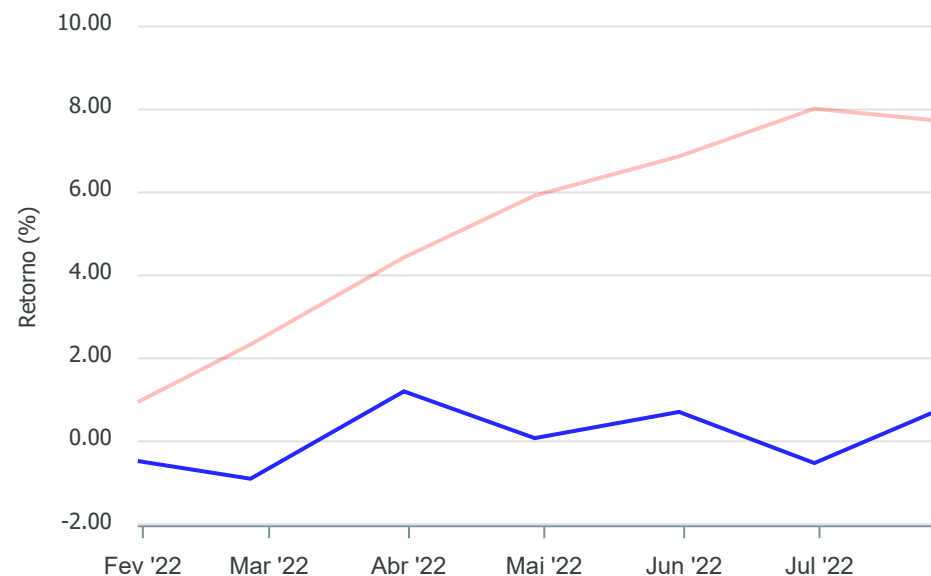
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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 Março/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	657.530,38	0,00	0,00	680.742,00	23.211,62	3,53%	3,53%	4,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	843.593,46	0,00	0,00	868.984,14	25.390,68	3,01%	3,01%	2,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.381.086,83	0,00	0,00	3.468.533,13	87.446,30	2,59%	2,59%	1,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	502.024,36	0,00	0,00	514.132,86	12.108,50	2,41%	2,41%	1,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.876.817,28	0,00	640.000,00	4.348.367,52	111.550,24	2,29%	2,62%	1,43%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.246.673,77	0,00	0,00	1.261.034,92	14.361,15	1,15%	1,15%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.904.705,33	30.000,00	87.513,23	4.894.540,04	47.347,94	0,96%	0,96%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.069.430,83	0,00	0,00	2.087.347,61	17.916,78	0,87%	0,87%	0,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	305.427,59	800.000,00	0,00	1.114.180,23	8.752,64	0,79%	1,48%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	1.137.665,09	0,00	1.146.030,47	8.365,38	0,74%	1,43%	0,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	967.912,29	0,00	974.761,23	6.848,94	0,71%	0,91%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.005.109,66	0,00	1.000.000,00	1.019.032,73	13.923,07	0,69%	0,82%	0,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	185.568,99	2.072.419,59	2.217.249,10	43.014,59	2.275,11	0,10%	0,83%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	864.781,63	0,00	864.799,95	0,00	18,32	0,00%	1,36%	0,92%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	997.833,67	-2.166,33	-0,22%	2,40%	1,02%
Total Renda Fixa	21.842.750,11	6.007.996,97	4.809.562,28	23.418.535,14	377.350,34	1,64%		0,88%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	167.268,05	0,00	0,00	183.593,67	16.325,62	9,76%	9,76%	9,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	35.296,74	0,00	0,00	38.143,22	2.846,48	8,06%	8,06%	8,70%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	583.841,04	0,00	0,00	625.325,13	41.484,09	7,11%	7,11%	12,11%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	293.255,18	0,00	0,00	312.838,76	19.583,58	6,68%	6,68%	11,16%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	252.825,64	0,00	0,00	269.697,02	16.871,38	6,67%	6,67%	9,48%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	344.851,12	250.000,00	0,00	628.214,57	33.363,45	5,61%	5,06%	9,74%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	329.442,38	0,00	0,00	347.889,61	18.447,23	5,60%	5,60%	20,68%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	547.092,95	0,00	0,00	577.410,71	30.317,76	5,54%	5,54%	15,01%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	239.290,65	0,00	0,00	252.476,76	13.186,11	5,51%	5,51%	9,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	274.139,30	0,00	0,00	288.875,39	14.736,09	5,38%	5,38%	11,52%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	761.058,13	0,00	0,00	800.975,14	39.917,01	5,24%	5,24%	9,70%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	896.579,53	0,00	0,00	938.932,67	42.353,14	4,72%	4,72%	10,18%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	1.261.871,89	0,00	0,00	1.319.686,21	57.814,32	4,58%	4,58%	10,49%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	290.347,91	0,00	0,00	301.965,99	11.618,08	4,00%	4,00%	10,64%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	731.291,48	0,00	0,00	747.274,78	15.983,30	2,19%	2,19%	1,85%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	261.014,93	0,00	0,00	263.494,49	2.479,56	0,95%	0,95%	0,10%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	132.206,24	0,00	0,00	130.119,11	-2.087,13	-1,58%	-1,58%	2,07%
Total Renda Variável	7.401.673,16	250.000,00	0,00	8.026.913,23	375.240,07	4,90%		9,89%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	300.000,00	0,00	0,00	308.367,50	8.367,50	2,79%	2,79%	10,21%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	528.251,25	0,00	0,00	505.842,03	-22.409,22	-4,24%	-4,24%	11,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.057.149,45	0,00	500.000,00	500.680,63	-56.468,82	-5,34%	-4,11%	12,22%
Total Exterior	1.885.400,70	0,00	500.000,00	1.314.890,16	-70.510,54	-3,74%		11,31%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.365.452,15	458.761,64	640.000,00	4.348.367,52	164.153,73	3,40%	3,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.942.246,91	488.761,64	662.513,23	4.894.540,04	126.044,72	2,32%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.342.902,44	0,00	0,00	3.468.533,13	125.630,69	3,76%	3,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.977.728,09	65.210,08	0,00	2.087.347,61	44.409,44	2,17%	2,22%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.975.891,55	0,00	1.000.000,00	1.019.032,73	43.141,18	2,18%	2,32%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.230.547,21	0,00	0,00	1.261.034,92	30.487,71	2,48%	2,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	845.609,50	0,00	0,00	868.984,14	23.374,64	2,76%	2,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	500.000,00	0,00	514.132,86	14.132,86	2,83%	3,92%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	249.861,13	4.047.204,06	4.267.722,31	43.014,59	13.671,71	0,32%	2,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	301.381,01	800.000,00	0,00	1.114.180,23	12.799,22	1,16%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	668.205,92	0,00	0,00	680.742,00	12.536,08	1,88%	1,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	1.137.665,09	0,00	1.146.030,47	8.365,38	0,74%	3,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	857.399,13	0,00	864.799,95	0,00	7.400,82	0,86%	2,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	967.912,29	0,00	974.761,23	6.848,94	0,71%	2,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	65.296,99	0,00	65.210,08	0,00	-86,91	-0,13%	0,73%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	997.833,67	-2.166,33	-0,22%	-
Total Renda Fixa	20.822.522,03	9.465.514,80	7.500.245,57	23.418.535,14	630.743,88	2,77%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	736.714,87	0,00	0,00	800.975,14	64.260,27	8,72%	8,72%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	324.941,72	250.000,00	0,00	628.214,57	53.272,85	9,27%	11,50%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	579.840,13	0,00	0,00	625.325,13	45.485,00	7,84%	7,84%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	714.356,08	0,00	0,00	747.274,78	32.918,70	4,61%	4,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	260.761,40	0,00	0,00	288.875,39	28.113,99	10,78%	10,79%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	550.789,38	0,00	0,00	577.410,71	26.621,33	4,83%	4,83%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	321.271,87	0,00	0,00	347.889,61	26.617,74	8,29%	8,29%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	288.511,78	0,00	0,00	312.838,76	24.326,98	8,43%	8,43%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	159.783,11	0,00	0,00	183.593,67	23.810,56	14,90%	14,90%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	250.283,14	0,00	0,00	269.697,02	19.413,88	7,76%	7,76%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	242.835,09	0,00	0,00	252.476,76	9.641,67	3,97%	3,97%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	257.351,96	0,00	0,00	263.494,49	6.142,53	2,39%	2,39%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	33.865,13	0,00	0,00	38.143,22	4.278,09	12,63%	12,63%
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	300.899,07	0,00	0,00	301.965,99	1.066,92	0,35%	0,35%
CAIXA HEDGE FIC MULTIMERCADO LP	132.499,62	0,00	0,00	130.119,11	-2.380,51	-1,80%	-1,80%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	972.765,74	0,00	0,00	938.932,67	-33.833,07	-3,48%	-3,48%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.362.051,12	0,00	0,00	1.319.686,21	-42.364,91	-3,11%	-3,11%
Total Renda Variável	7.489.521,21	250.000,00	0,00	8.026.913,23	287.392,02	3,71%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	0,00	300.000,00	0,00	308.367,50	8.367,50	2,79%	-3,26%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	626.532,24	0,00	0,00	505.842,03	-120.690,21	-19,26%	-19,26%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.959.614,47	0,00	1.050.000,00	500.680,63	-408.933,84	-20,87%	-19,62%
Total Exterior	2.586.146,71	300.000,00	1.050.000,00	1.314.890,16	-521.256,55	-18,06%	

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.