

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

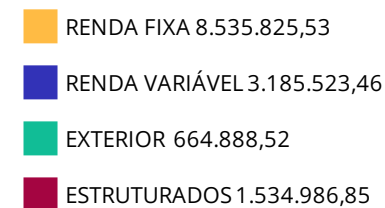
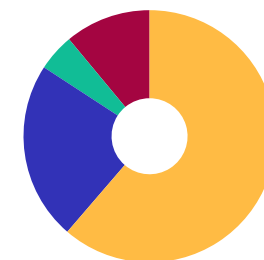
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.287.044,33	9,25%	1.034	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	161.586,71	1,16%	793	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	300.692,49	2,16%	142	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	220.944,72	1,59%	921	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	65.056,99	0,47%	1.024	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	0,01	0,00%	815	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	0,01	0,00%	1.220	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	631.502,66	4,54%	831	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	488.685,11	3,51%	238	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.328.955,08	16,73%	934	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	315.788,10	2,27%	204	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.701.347,10	19,40%	247	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	635.121,86	4,56%	2.389	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	610.391,56	4,38%	4.511	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	571.816,88	4,11%	34	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	427.053,83	3,07%	1.789	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	662.352,87	4,76%	9.187	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	278.786,46	2,00%	103	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	664.888,52	4,78%	528	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	674.712,02	4,85%	201	0,22%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	777.173,93	5,58%	133	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	83.100,90	0,60%	14.591	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIO...	Não se ...	Não se aplica	34.222,22	0,25%	2.024	0,02%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			13.921.224,36				

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

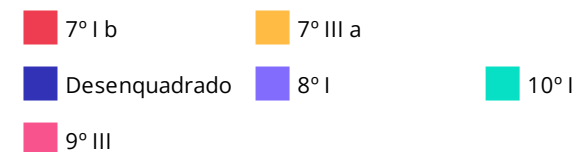
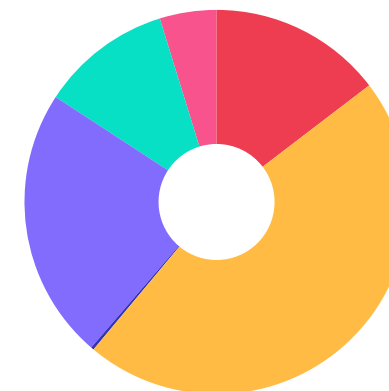
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	33,00%	59,24%	8.246.933,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	2.035.325,26	14,62%	24,38%	32,00%	59,24%	6.211.608,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	6.466.278,05	46,45%	1,13%	1,50%	50,00%	494.334,13
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	20,00%	2.784.244,87
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	696.061,22
Desenquadrado - RF	0,00%	34.222,22	0,25%	0,00%	0,00%	0,00%	-34.222,22
Total Renda Fixa	100,00%	8.535.825,53	61,32%	25,51%	73,00%	193,48%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.185.523,46	22,88%	15,00%	18,70%	20,00%	-401.278,59
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,30%	20,00%	2.784.244,87
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.534.986,85	11,03%	3,75%	5,00%	10,00%	-142.864,41
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.720.510,31	33,91%	18,75%	27,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	664.888,52	4,78%	0,00%	0,00%	10,00%	727.233,92
Total Exterior	10,00%	664.888,52	4,78%	0,00%	0,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.817.999,33	48,98	0,00
CAIXA DTVM	3.517.052,37	25,26	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.980.133,56	21,41	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	571.816,88	4,11	0,00
BV ASSET	34.222,22	0,25	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
IPCA + 5,50% ao ano (Benchmark)	2,10%	4,57%	4,57%	9,11%	17,42%	31,38%	-	-
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR - BBVH11	1,48%	-7,66%	-7,66%	-3,24%	-26,11%	-41,50%	-	0,22%
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%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,58%	3,74%	3,74%	5,75%	8,38%	17,29%	1,35%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	3,07%	2,87%	2,87%	3,96%	4,50%	15,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,06%	2,82%	2,82%	3,85%	4,23%	14,81%	2,68%	0,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,07%	2,86%	2,86%	3,87%	4,35%	14,79%	2,69%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,90%	2,37%	2,37%	4,20%	6,18%	8,31%	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%

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,83%	2,18%	2,18%	3,79%	5,27%	6,45%	0,01%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,62%	3,20%	3,20%	6,25%	11,30%	18,09%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,16%	2,64%	2,64%	4,85%	6,92%	9,12%	0,19%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,82%	2,32%	2,32%	3,41%	2,39%	7,61%	0,34%	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
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,19%	2,84%	2,84%	4,82%	6,43%	9,50%	0,47%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,19%	4,61%	4,61%	5,56%	5,60%	22,32%	1,85%	0,04%
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	6,06%	14,48%	14,48%	8,13%	2,89%	64,34%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,02%	11,09%	11,09%	-4,34%	-4,31%	35,59%	11,67%	0,20%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,11%	9,65%	9,65%	-1,69%	-5,16%	46,39%	11,20%	0,18%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,25%	8,72%	8,72%	5,96%	6,30%	67,64%	9,70%	0,12%
IBX (Benchmark)	5,96%	14,89%	14,89%	8,55%	2,79%	66,70%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	5,71%	15,11%	15,11%	5,30%	-0,01%	60,15%	9,55%	0,17%
IDIV (Benchmark)	10,00%	15,48%	15,48%	13,37%	11,66%	55,59%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	8,06%	12,63%	12,63%	4,84%	8,67%	64,19%	8,70%	0,18%
MSCI ACWI (Benchmark)	-6,10%	-19,97%	-19,97%	-12,65%	-12,11%	46,60%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4,57%	-3,05%	-3,05%	9,62%	20,58%	82,26%	10,56%	0,14%

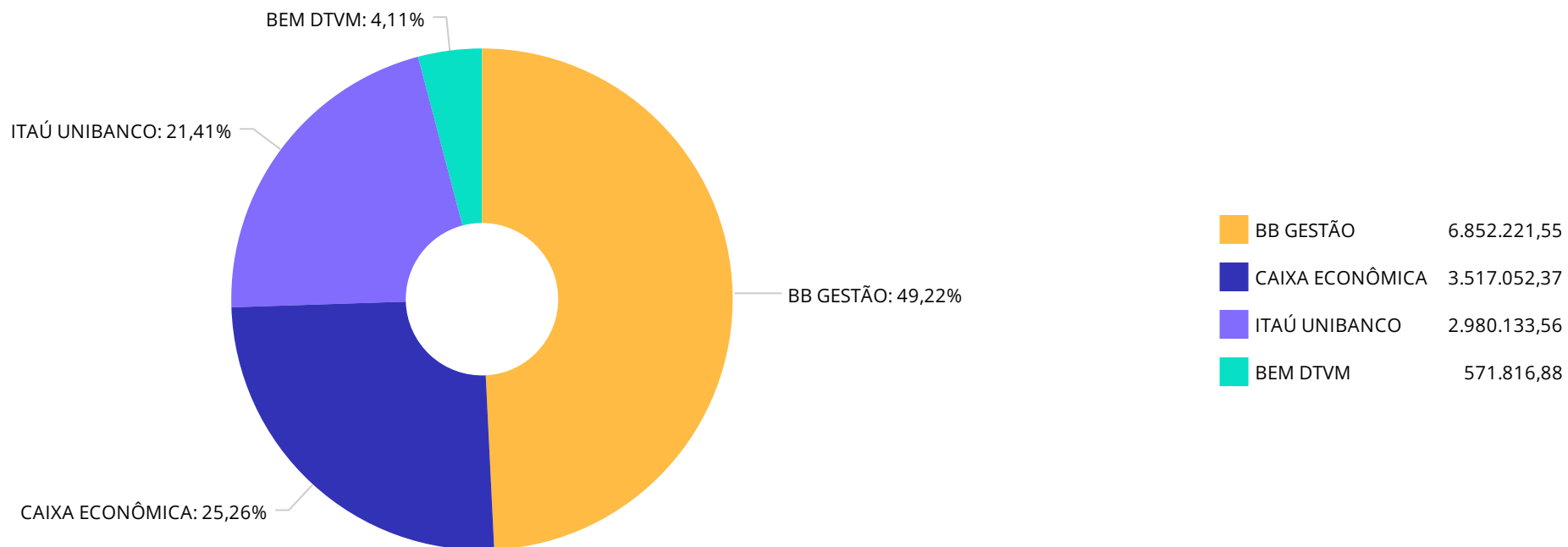
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	8,81%	6,69%	6,69%	-5,35%	-9,80%	48,46%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	8,57%	7,01%	7,01%	-5,42%	-10,49%	43,86%	14,90%	0,22%

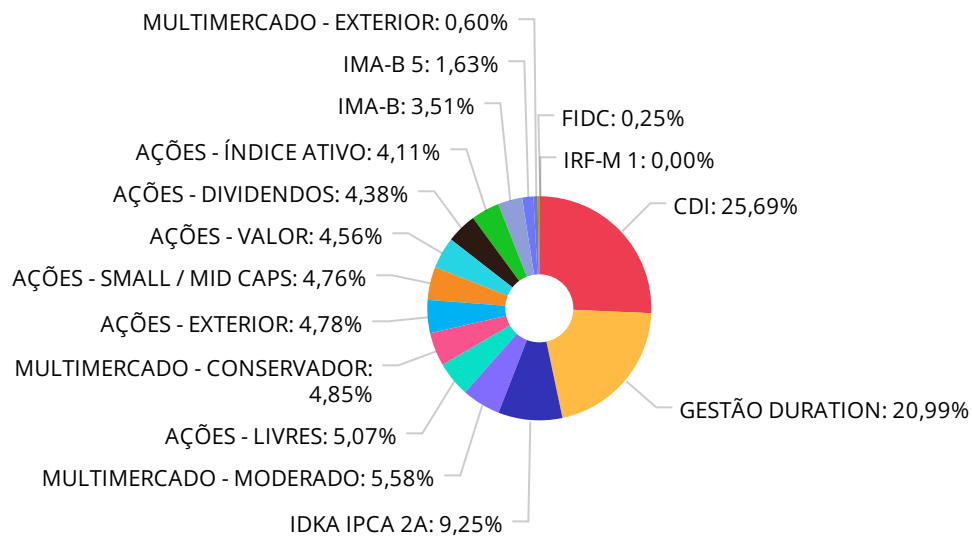
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	19,095%

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



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

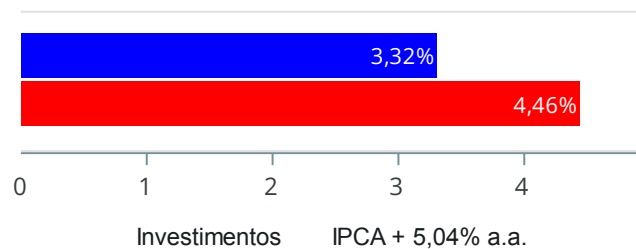


■ CDI	3.576.938,33	■ GESTÃO DURATION	2.922.291,82	■ IDKA IPCA 2A	1.287.044,33
■ MULTIMERCADO - MODERADO	777.173,93	■ AÇÕES - LIVRES	705.840,29	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	674.712,02
■ AÇÕES - EXTERIOR	664.888,52	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	662.352,87	■ AÇÕES - VALOR	635.121,86
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	610.391,56	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	571.816,88	■ IMA-B	488.685,12
■ IMA-B 5	226.643,70	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	83.100,90	■ FIDC	34.222,22
■ IRF-M 1	0,01				

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	15.059.519,11	1.678.393,22	3.693.882,34	13.170.689,49	126.659,50	126.659,50	0,84%	0,84%	0,95%	0,95%	88,27%	3,31%
Fevereiro	13.170.689,49	2.057.255,87	1.823.700,00	13.405.393,24	1.147,88	127.807,38	0,01%	0,85%	1,39%	2,35%	36,14%	2,50%
Março	13.405.393,24	2.269.852,70	2.713.309,69	13.289.721,70	327.785,45	455.592,83	2,45%	3,32%	2,06%	4,46%	74,40%	3,60%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



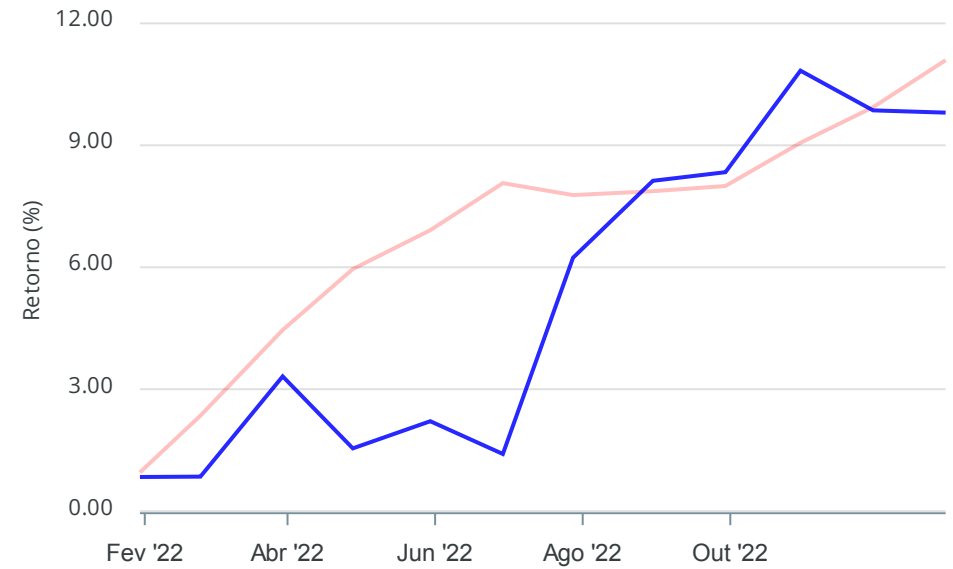
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

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 Março/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	474.110,37	0,00	0,00	488.685,11	14.574,74	3,07%	3,07%	2,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	63.416,82	0,00	0,00	65.056,99	1.640,17	2,59%	2,59%	1,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.352.291,73	0,00	100.000,00	1.287.044,33	34.752,60	2,57%	2,62%	1,43%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	844.859,13	0,00	700.000,00	161.586,71	16.727,58	1,98%	2,58%	1,35%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	33.722,04	0,00	0,00	34.222,22	500,18	1,48%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.670.284,90	0,00	0,00	2.701.347,10	31.062,20	1,16%	1,16%	0,19%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	743.563,12	0,00	117.563,12	631.502,66	5.502,66	0,74%	0,83%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	863.897,62	1.706.585,66	258.600,00	2.328.955,08	17.071,80	0,66%	0,96%	0,04%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	205.111,30	163.267,04	54.709,69	315.788,10	2.119,45	0,58%	0,90%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.812.843,05	0,00	1.600.000,00	220.944,72	8.101,67	0,45%	0,82%	0,34%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	300.000,00	0,00	300.692,49	692,49	0,23%	2,40%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	3,06%	2,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,87%	0,33%
Total Renda Fixa	9.064.100,10	2.169.852,70	2.830.872,81	8.535.825,53	132.745,54	1,46%		0,52%

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 SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	610.092,11	0,00	0,00	662.352,87	52.260,76	8,57%	8,57%	14,90%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	564.840,34	0,00	0,00	610.391,56	45.551,22	8,06%	8,06%	8,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	262.947,20	0,00	0,00	278.786,46	15.839,26	6,02%	6,02%	11,67%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	540.924,11	0,00	0,00	571.816,88	30.892,77	5,71%	5,71%	9,55%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	603.470,23	0,00	0,00	635.121,86	31.651,63	5,24%	5,24%	9,70%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	406.298,46	0,00	0,00	427.053,83	20.755,37	5,11%	5,73%	11,20%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	79.469,64	0,00	0,00	83.100,90	3.631,26	4,57%	4,57%	10,56%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	760.551,09	0,00	0,00	777.173,93	16.622,84	2,19%	2,19%	1,85%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	666.804,50	0,00	0,00	674.712,02	7.907,52	1,19%	1,19%	0,47%
Total Renda Variável	4.495.397,68	0,00	0,00	4.720.510,31	225.112,63	5,01%		7,94%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	589.458,58	100.000,00	0,00	664.888,52	-24.570,06	-3,56%	-4,11%	12,22%
Total Exterior	589.458,58	100.000,00	0,00	664.888,52	-24.570,06	-3,56%		12,22%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.631.970,13	0,00	0,00	2.701.347,10	69.376,97	2,64%	2,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.586.676,04	0,00	350.000,00	1.287.044,33	50.368,29	3,17%	3,82%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.888.249,59	0,00	1.702.511,42	220.944,72	35.206,55	1,86%	2,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	362.400,72	5.107.885,98	3.176.360,45	2.328.955,08	35.028,83	0,64%	2,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.634.788,47	0,00	1.500.000,00	161.586,71	26.798,24	1,64%	3,74%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	475.117,43	0,00	0,00	488.685,11	13.567,68	2,86%	2,86%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.310.426,82	497.615,81	1.502.020,16	315.788,10	9.765,63	0,54%	2,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	62.700,62	0,00	0,00	65.056,99	2.356,37	3,76%	3,76%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	300.000,00	0,00	300.692,49	692,49	0,23%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	2,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	2,82%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	37.061,53	0,00	0,00	34.222,22	-2.839,31	-7,66%	-7,66%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.160,27	955.661,26	234.289,68	631.502,66	-141.029,19	-14,01%	2,18%
Total Renda Fixa	10.040.551,64	6.861.163,05	8.465.181,71	8.535.825,53	99.292,55	0,59%	

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
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	496.756,28	0,00	0,00	571.816,88	75.060,60	15,11%	15,11%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	541.930,88	0,00	0,00	610.391,56	68.460,68	12,63%	12,63%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	584.167,59	0,00	0,00	635.121,86	50.954,27	8,72%	8,72%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	618.947,98	0,00	0,00	662.352,87	43.404,89	7,01%	7,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	389.485,21	0,00	0,00	427.053,83	37.568,62	9,65%	9,65%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	742.938,11	0,00	0,00	777.173,93	34.235,82	4,61%	4,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	250.966,07	0,00	0,00	278.786,46	27.820,39	11,09%	11,09%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	656.067,37	0,00	0,00	674.712,02	18.644,65	2,84%	2,84%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	85.715,05	0,00	0,00	83.100,90	-2.614,15	-3,05%	-3,05%
Total Renda Variável	4.366.974,54	0,00	0,00	4.720.510,31	353.535,77	8,10%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	703.153,19	100.000,00	0,00	664.888,52	-138.264,67	-17,22%	-19,62%
Total Exterior	703.153,19	100.000,00	0,00	664.888,52	-138.264,67	-17,22%	

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

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

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

