

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

JANEIRO/2022

Este relatório tem como objetivo demonstrar a análise do relatório de investimentos, de acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento a Política de Investimentos do mês em referência, e a aprovação pelo Conselho Fiscal.



Conselho Fiscal do ITAPREV

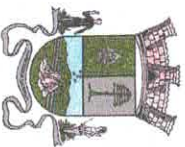
REUNIÃO ORDINÁRIA DO CONSELHO FISCAL

Aos dias 16 de agosto de dois mil e vinte dois às 14h, **90ª (nonagésima reunião)**, do Conselho Fiscal do ITAPREV, reunião ordinária com os senhores membros do Conselho Fiscal, realizada na Sala de Reuniões do Bloco B do Complexo Administrativo da Prefeitura, com Ana Maria Bondezan, Conceição Aparecida Borges Kusuki Conselheiro, Evandro Ferreira Domingues Conforme análise do Balancete de Receitas e Despesas do mês de julho de dois mil e vinte dois, saldo de fechamento R\$ 244.687.207,10 (duzentos e quarenta e quatro milhões seiscentos e oitenta e sete mil duzentos e sete reais dez centavos). Observando quanto pendência de Repasse de Contribuição Patronal da Prefeitura Municipal de Itapecerica da Serra e Autarquia Municipal de Saúde a partir do mês julho de 2022, está sendo efetuado o pagamento da 19ª (décima nona) parcela do total de 24 (vinte e quatro) parcelas atualizadas no valor R\$ 232.857,95 (duzentos e trinta e dois mil oitocentos cinqüenta e sete reais e noventa e cinco centavos) referente ao pagamento da Prefeitura Municipal de Itapecerica da Serra, e o valor de R\$ 157.880,51 (cento cinqüenta e sete mil oitocentos e oitenta reais cinqüenta e um centavos) da Autarquia Municipal de Saúde de Itapecerica da Serra, mês julho de 2022. Analisado o Relatório do Comitê de Investimentos do mês de janeiro a maio de 2022, onde lido foi e APROVADO na sua integra. Encerrada esta reunião a qual lavro a ata e assinamos abaixo, ficando confirmada a próxima reunião ordinária para o dia 27 (vinte e sete) de setembro dois mil e vinte dois, às 14h, neste mesmo local.

Ana Maria Bondezan
Presidente do Conselho Fiscal

Conceição Aparecida Borges Kusuki
Secretária do Conselho Fiscal

Conselheiro Evandro Ferreira Domingues
Conselho Fiscal



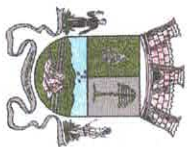
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

PARECER COMITE DE INVESTIMENTOS JANEIRO/2022

O comitê de investimentos do **INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPECERICA DA SERRA-ITAPREV**, fazendo uso de sua competência que lhe confere o Decreto Municipal Nº 2352/2015, em sua reunião ordinária do dia 08 de fevereiro de 2022, analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês de janeiro/2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do RPPS e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

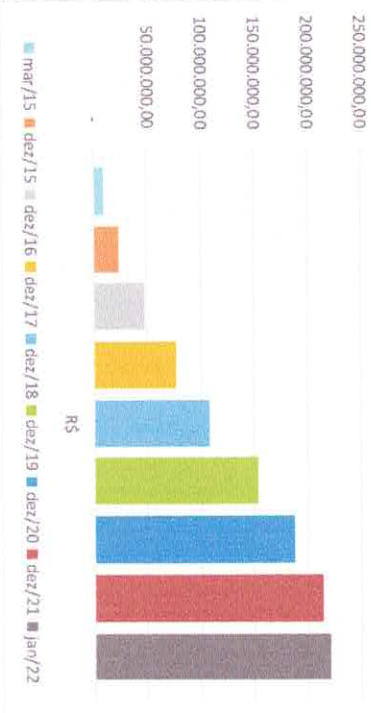
1) CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapacericá da Serra-ITAPREV, no mês de janeiro de 2022 apresentou valorização de 0,35% encerrando o mês com recursos aplicados no valor total de R\$ 22.301.245,11 (Duzentos e vinte e um milhões, trezentos e um mil, duzentos e quarenta e cinco reais e onze centavos).



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Comparativo Evolução Patrimônio



Ano	R\$
mar/15	9.333.541,95
dez/15	22.750.600,24
dez/16	47.169.736,15
dez/17	76.356.500,87
dez/18	107.384.837,09
dez/19	152.862.799,62
dez/20	186.459.080,35
dez/21	214.632.111,69
jan/22	221.301.245,11

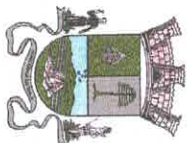
2) COMPOSIÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

A carteira de investimentos do Instituto de Previdência do município de Itapaccerica da Serra-ITAPREV, atende aos requisitos de limites e enquadramento da resolução N^o 3922/2010 e suas alterações e, aos limites e enquadramentos aprovados na política de investimentos vigente sendo composta por:

67,99% em investimentos denominados Renda fixa;

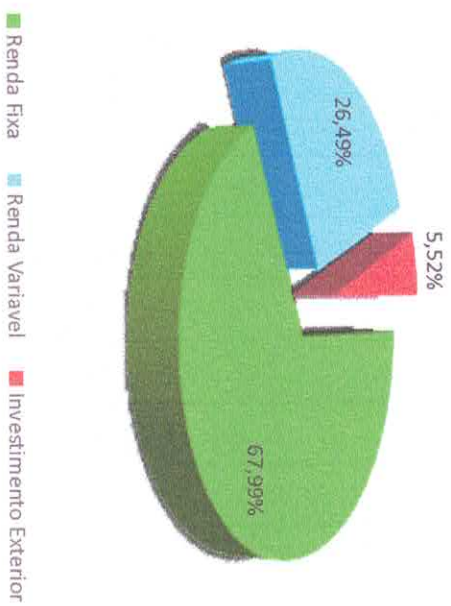
26,49% em investimentos denominados Renda Variável; e

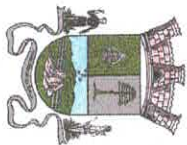
5,52% em investimentos denominados exterior.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Enquadramentos





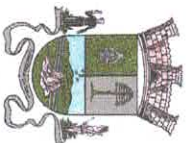
**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO**

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	15.090,70	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.272.522,70	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.607.819,63	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	961.362,75	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.298.846,39	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	4.994.337,89	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.558.655,88	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	16.818.529,03	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.281.440,18	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.825.066,24	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.956.793,21	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IRI-F-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.363.407,28	Artigo 7º, inciso I, Alínea 'b'	Renda Fixa
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.001.389,46	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.591.780,36	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.948.102,74	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	14.392.227,97	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.871.286,48	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	2.103.493,02	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
DAVCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+3	Não há	7.192.480,94	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.716.138,75	Artigo 7º, inciso III, Alínea 'a'	Renda Fixa
CAIXA BRASIL IPCA XVI FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	16/04/2018	5.145.376,91	Artigo 7º, inciso V, Alínea 'b'	Renda Fixa
Renda Fixa			152.917.148,51		

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.991.992,39	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	2.470.266,66	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.025.489,01	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+7 du	Não há	2.767.633,37	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.089.874,16	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
NETA VALOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.142.001,71	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	D+13	Não há	1.573.486,93	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.376.379,26	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.234.868,23	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
SONOMA BRASIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.380.137,90	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
TARON GT 30 FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.231.707,50	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.141.058,60	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.965.144,42	Artigo 8º, inciso I	Renda Variável
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	4.628.993,04	Artigo 10º, inciso I	Renda Variável
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	D+15	Não há	2.669.423,50	Artigo 10º, inciso I	Renda Variável
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.403.458,99	Artigo 10º, inciso I	Renda Variável
BRAZILIAN GRAVYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARET11	Não se aplica	Não se aplica	485.349,28	Artigo 11º	Renda Variável
Renda Variável			59.577.264,95		

Produto / Fundo	Disponibilidade	Carência	Saldo	Enquadramento	Segmento
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.588.102,60	Artigo 9º, inciso II	Investimento no Exterior
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	D+4 du	Não há	1.564.546,35	Artigo 9º, inciso II	Investimento no Exterior
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+5	Não há	4.382.531,69	Artigo 9º, inciso III	Investimento no Exterior
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+4	Não há	4.879.522,07	Artigo 9º, inciso III	Investimento no Exterior
Investimento no exterior			12.414.702,71		

Renda Fixa	152.917.148,51
Renda variável	59.577.264,95
Investimento no exterior	12.414.702,71
Total Aplicado	224.909.116,17



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

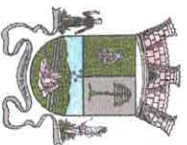
3) META ATUARIAL

O retorno da carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de Itapiclergia da Serra – ITAPREV, no acumulado do ano é positivo em 0,35% (zero virgula trinta e cinco por cento), abaixo da meta atuarial acumulada de IPCA+5,88% que em janeiro ficou acumulada 0,94% (Zero virgula noventa e quatro por cento).

A disseminação da pandemia de COVID-19 que dominou o ano de 2020 e se estende a 2021 e os impactos do noticiário político influenciam no retorno dos investimentos ainda em 2022.

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno Acumulado	Retorno Mês	Meta	Retorno acum.	Meta acum.	Gap (%)
Janeiro	214.632.111,69	12.280.631,66	6.113.007,65	221.301.245,11	765.333,74	0,35%	0,94%	0,35%	0,94%	36,92%





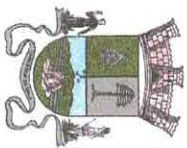
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

4) RETORNO ACUMULADO POR FUNDO DE INVESTIMENTO

Produto / Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922 / 4.392 / 4.604	SEGMENTO	RETORNO OSTIVO	META 2022
SCHRODER BEST IDEAS	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	12,34%	0,94%
META VALOR FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	9,74%	0,94%
BNP PARIBAS ACTION FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	9,15%	0,94%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	7,51%	0,94%
SANTANDER IBOVESP ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	6,87%	0,94%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	6,80%	0,94%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	5,92%	0,94%
CONSTANÇA FUNDAMENTO FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	3,88%	0,94%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FI AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	2,66%	0,94%
CAIXA BRASIL ESTRATEGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	1,43%	0,94%
TAIPON GT 30 FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	1,34%	0,94%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	0,81%	0,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	0,79%	0,94%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	0,73%	0,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,67%	0,94%
CAIXA BRASIL IRF M1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,61%	0,94%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	0,60%	0,94%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,54%	0,94%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,37%	0,94%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	0,32%	0,94%
BB AÇÕES AGRIO FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	0,29%	0,94%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,27%	0,94%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	0,24%	0,94%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RE PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	0,19%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,09%	0,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,08%	0,94%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	0,06%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,02%	0,94%
BB IDIA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	0,01%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	-0,11%	0,94%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	RENDA FIXA	-0,76%	0,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	-0,77%	0,94%
BB IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	RENDA FIXA	-1,63%	0,94%
TRIGONO DELPHOS INCOVEP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	Artigo 8º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-2,07%	0,94%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	Artigo 10º, Inciso I	RENDA VARIÁVEL	-3,12%	0,94%
BNP PARIBAS ACCESS WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	Artigo 9º, Inciso II	RENDA VARIÁVEL	-8,26%	0,94%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I FI AÇÕES	Artigo 9º, Inciso III	RENDA VARIÁVEL	-9,75%	0,94%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	Artigo 9º, Inciso III	RENDA VARIÁVEL	-10,62%	0,94%
SCHRODER SUSTEN TABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVEST EXTERIOR	Artigo 9º, Inciso II	RENDA VARIÁVEL	-11,76%	0,94%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CAREI1	Artigo 11º	RENDA VARIÁVEL	-20,91%	0,94%

TAXA ADMINISTRATIVA

11	Fundos acima da Meta atuarial
18	Fundos abaixo da Meta Atuarial
13	Fundos com rendimento Negativo



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

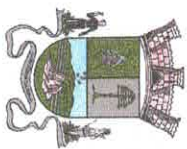
5) ENQUADRAMENTO

Em atendimento a Resolução Nº 4963/2021 em substituição a resolução Nº 3922/2010 e suas alterações, e em atendimento aos limites previsto na política de investimentos vigente, a carteira de investimentos do Instituto de Previdência do Município de Itapeverica da Serra, atende aos limites pré-estabelecidos.

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2022		
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0	0,00%	0,00%	10,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	85.954.891,88	38,22%	20,00%	34,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	61.816.879,72	27,49%	10,00%	14,50%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV	0,00%	0	0,00%	0,00%	6,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	5.145.376,91	2,29%	0,00%	5,00%	5,00%
Total Renda Fixa	100,00%	152.917.148,51	67,99%	30,00%	69,50%	228,00%

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2022		
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	47.390.040,14	21,07%	10,00%	19,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00%	0	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	11.701.875,53	5,20%	2,00%	5,00%	10,00%
Artigo 11º	5,00%	485.349,28	0,22%	0,00%	0,50%	1,00%
Total Renda Variável	30,00%	59.577.264,95	26,49%	12,00%	24,50%	46,00%

Artigos Exterior	Resolução %	Carteira		Estratégia de Alocação - Limite - 2022		
		\$	%	Inferior	Alvo	Superior
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.152.648,95	1,40%	0,50%	3,00%	10,00%
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.262.053,76	4,12%	2,00%	6,00%	10,00%
Total Exterior	10,00%	12.414.702,71	5,52%	2,50%	9,00%	20,00%

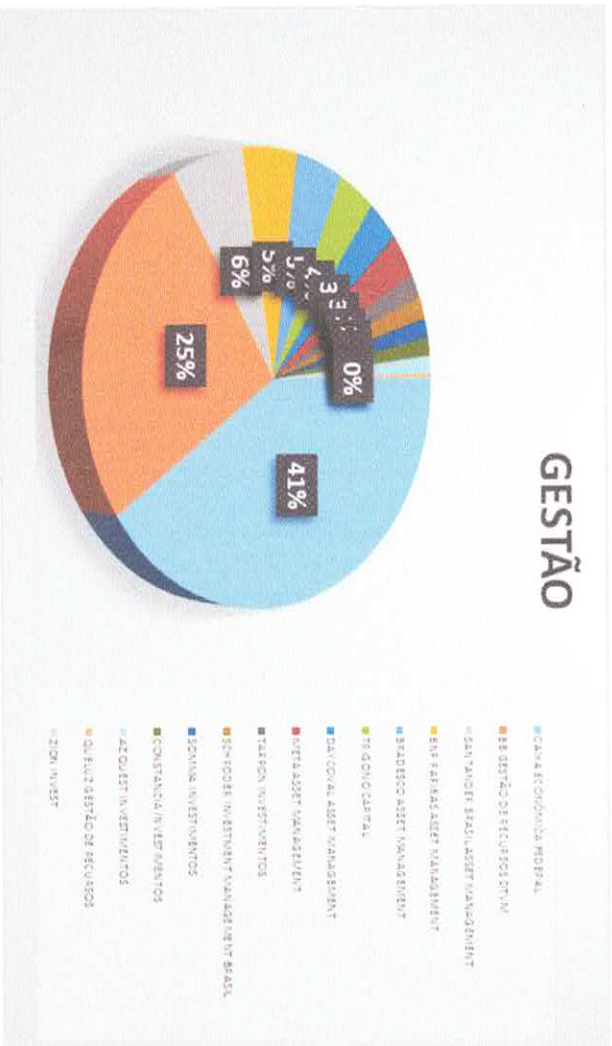


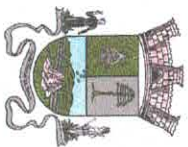
**INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO**

6) DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS

Os recursos financeiros do Instituto de Previdência do Município de Itapeçerica da Serra, apresenta a seguinte distribuição quanto a gestores, administradores e Subsegmento de aplicações:

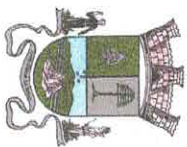
Gestores





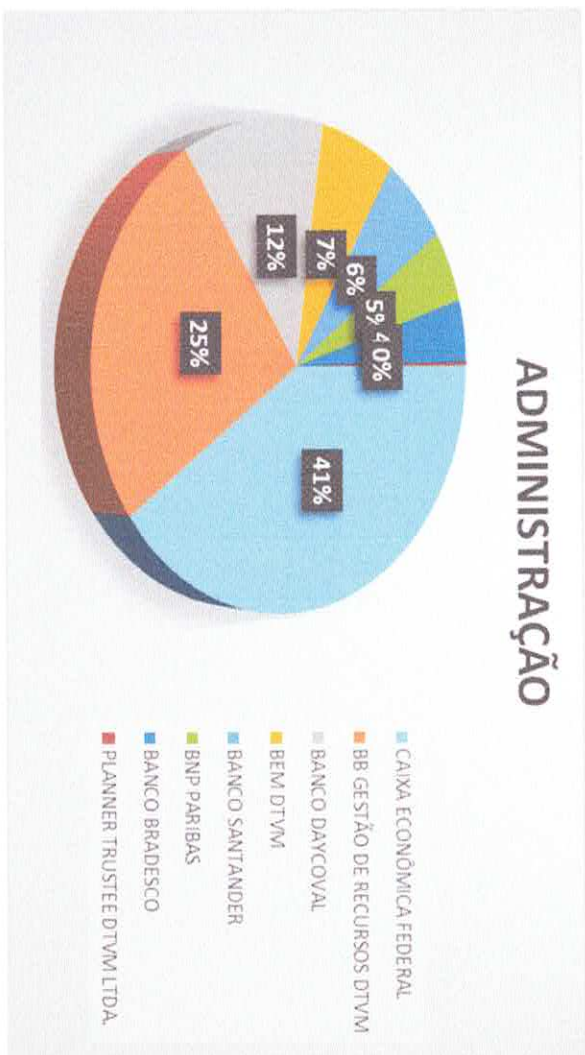
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

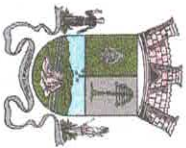
Gestão	Valor	% s/ Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	91.268.680,76	40,58%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.225.941,27	25,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	14.092.518,01	6,27%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	11.381.224,98	5,06%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.948.102,74	4,42%
TRIGONO CAPITAL	8.106.203,02	3,60%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	7.192.480,94	3,20%
META ASSET MANAGEMENT	7.142.001,71	3,18%
TARPON INVESTIMENTOS	4.231.707,50	1,88%
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT BRASIL	3.799.414,58	1,69%
SOMMA INVESTIMENTOS	3.380.137,90	1,50%
CONSTANCIA INVESTIMENTOS	3.089.874,16	1,37%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.991.992,39	1,33%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.573.486,93	0,31%
ZION INVEST	485.349,28	0,06%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

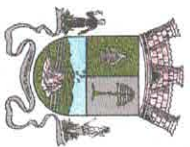
Administradores





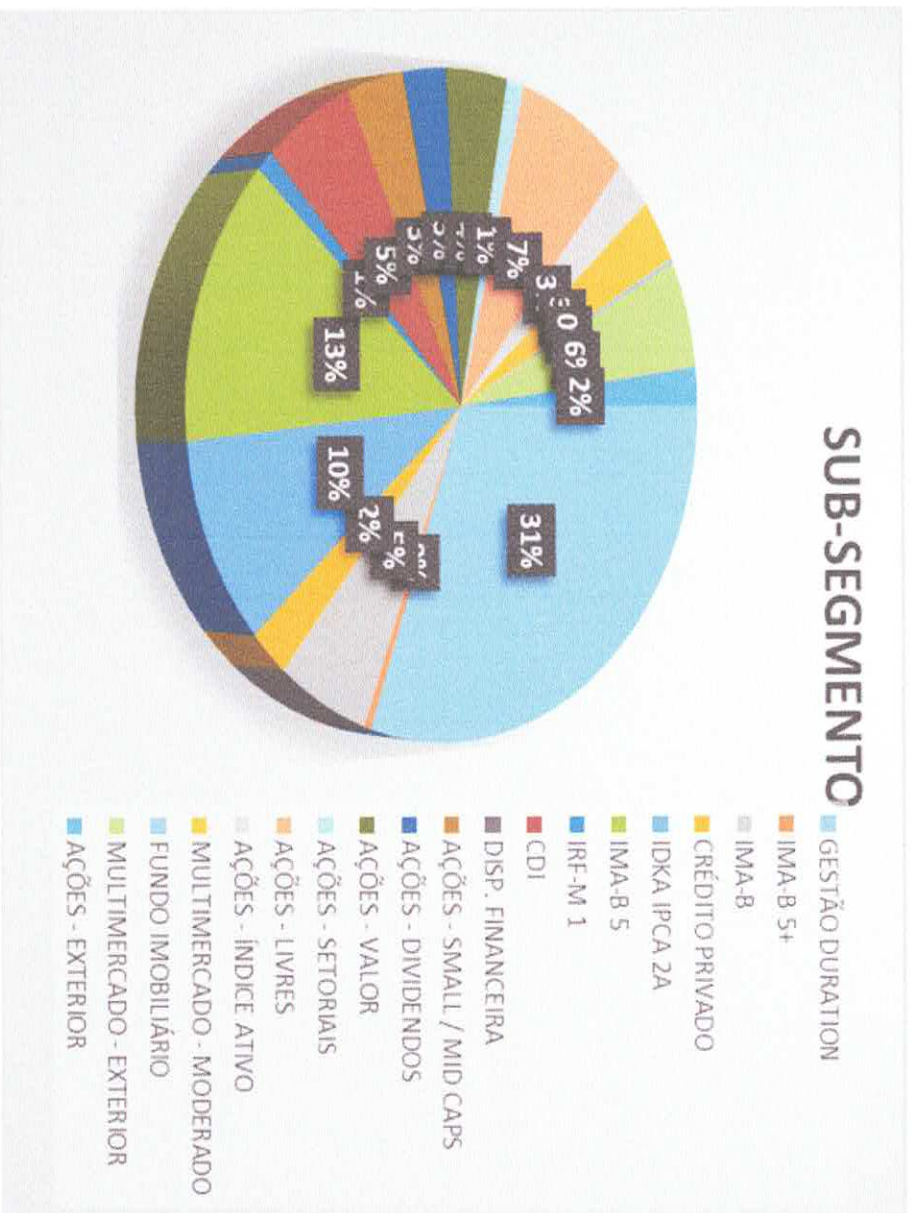
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

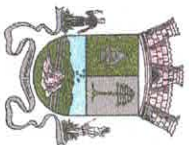
Administrador	Valor	% s/Carteira
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	91.268.680,76	40,58%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.225.941,27	25,00%
BANCO DAYCOVAL	26.672.393,17	11,86%
BEM DTVM	14.834.905,96	6,60%
BANCO SANTANDER	14.092.518,01	6,27%
BNP PARIBAS	11.381.224,98	5,06%
BANCO BRADESCO	9.948.102,74	4,42%
PLANNER TRUSTEE DTVM LTDA.	485.349,28	0,22%



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP, DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Subsegmento das Aplicações





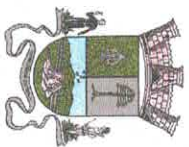
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Sub-Segmento	Valor	% s/Carteira	
GESTÃO DURATION	69.068.848,89	30,71%	GESTÃO DURATION - R\$ 65.914.947,25
IMA-B 5+	961.362,75	0,43%	LONGÍSSIMO PRAZO - R\$ 3.206.124,67
IMA-B	12.359.132,62	5,50%	LONGO PRAZO - R\$ 19.606.607,48
CRÉDITO PRIVADO	5.145.376,91	2,29%	
IDKA IPCA 2A	21.553.962,88	9,58%	
IMA-B 5	29.427.243,76	13,08%	
IRF-M 1	2.363.407,28	1,05%	
CDI	12.037.813,42	5,35%	CURTO PRAZO - R\$ 9.780.065,77
DISP. FINANCEIRA	0,00		
ações - SMALL / MID CAPS	7.724.770,18	3,43%	
ações - DIVIDENDOS	6.141.058,60	2,73%	
ações - VALOR	8.715.488,64	3,88%	
ações - SETORIAIS	2.470.266,66	1,10%	ações - R\$ 47.457.635,72
ações - LIVRES	16.581.938,90	7,37%	
ações - ÍNDICE ATIVO	5.756.517,16	2,56%	
MULTIMERCADO - MODERADO	7.298.416,54	3,25%	MULTIMERCADO - R\$ 4.677.927,92
FUNDO IMOBILIÁRIO	485.349,28	0,22%	FUNDO IMOBILIÁRIO - R\$ 898.362,85
MULTIMERCADO - EXTERIOR	12.414.702,71	5,52%	EXTERIOR - R\$ 14.478.530,9
ações - EXTERIOR	3.303.458,99	1,96%	

7) RISCO

Value at Risk (VaR) é um método para avaliar o risco em operações financeiras. O VaR resume, em um número, o risco de um produto financeiro ou o risco de uma carteira de investimentos, de um montante financeiro. Esse número representa a pior perda esperada em um dado horizonte de tempo e é associado a um intervalo de confiança.

Existem várias técnicas de avaliação do risco de operações financeiras, tais como Back Test, Stress Test, Expected Shortfall, além do Value at Risk. Essas técnicas visam quantificar o risco de mercado, ou seja, do risco de perdas monetárias decorrentes da variação de preços, de taxas de juros ou de taxas de câmbio.



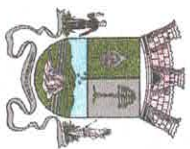
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Normalmente o VaR é calculado com 95%, 97,5% ou 99% de confiança. Este nível de confiança nos indica que é esperada perda maior que a calculada pelo VaR. Assim, ao utilizar 99% de confiança, espera-se que a cada 100 observações do VaR, em pelo menos 1 vez a perda do investimento financeiro seja superior à perda estimada no cálculo do VaR.

Assim, com o auxílio da amostra e distribuição dos retornos do ativo que está em análise e o seu desvio padrão, o VaR calcula qual a probabilidade de perda máxima que se pode ter investindo naquele ativo com um intervalo de confiança. Por exemplo, o VaR calculado de um investimento é de 5% com um intervalo de confiança de 99%. Isso nos diz que a perda máxima que esse investimento pode sofrer é de 5%. Vale destacar que em casos como crise financeira, pandemias e eventos “fora da curva”, as perdas não podem ser mensuradas pelo VaR.

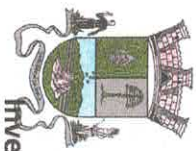
Retorno dos investimentos e benchmark JANEIRO/2022

Renda Fixa



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA ESTADO DE SÃO PAULO

IRF-M 1												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,61%	0,61%	2,25%	2,44%	3,30%	6,63%	0,20%	0,37%	1,29%			
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-	-			
IPCA + 6,00% ao ano												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL IPCA XVII FI RENDA FIXA CREDITO P...	0,27%	0,27%	3,14%	1,62%	2,65%	9,55%	0,20%	0,91%	3,34%			
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	1,03%	3,76%	8,77%	17,00%	29,59%	-	-	-			
IPCA												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIX...	0,19%	0,19%	2,51%	1,24%	1,20%	-	0,30%	0,76%	2,50%			
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,24%	2,49%	1,09%	0,67%	4,30%	0,40%	0,70%	2,42%			
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,33%	0,33%	2,47%	2,45%	3,54%	6,00%	0,40%	0,55%	1,58%			
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDE...	-	-	-	-	-	-	0,20%	0,00%	-			
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIX...	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,20%	0,36%	2,57%			
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,81%	0,81%	2,29%	1,43%	1,43%	-	0,40%	0,07%	2,30%			
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-	-			
IMA-B 5+												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PR...	-1,63%	-1,63%	2,40%	-5,08%	-6,71%	-3,70%	0,20%	3,36%	7,45%			
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,61%	-1,61%	2,45%	-4,92%	-6,47%	-3,03%	-	-	-			
IMA-B 5												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,04%	0,04%	3,24%	2,83%	3,59%	10,54%	0,50%	1,02%	3,23%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,08%	0,08%	3,33%	3,12%	4,25%	11,85%	0,20%	1,00%	3,23%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,09%	0,09%	3,35%	3,20%	4,32%	11,89%	0,20%	0,99%	3,20%			
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-	-			
IMA-B												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	-0,76%	-0,76%	2,87%	-1,06%	-1,42%	3,39%	0,20%	2,01%	5,18%			
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO...	-0,76%	-0,76%	2,84%	-1,05%	-1,38%	3,43%	0,20%	2,05%	5,16%			
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	-0,77%	-0,77%	2,86%	-1,09%	-1,42%	3,46%	0,20%	2,02%	5,19%			
IMA-B (Benchmark)	-0,73%	-0,73%	2,94%	-0,91%	-1,15%	4,02%	-	-	-			
IDKA IPCA 2 Anos												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI...	0,02%	0,02%	3,17%	3,14%	4,54%	12,58%	0,20%	1,11%	3,27%			
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREV...	0,01%	0,01%	3,16%	3,11%	4,47%	12,51%	0,20%	1,06%	3,14%			
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-	-			
CDI												
Ativos												
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,61%	0,61%	1,22%	2,77%	3,83%	5,57%	0,80%	0,00%	0,63%			
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CU...	0,56%	0,56%	1,59%	2,48%	3,08%	3,49%	1,75%	0,00%	0,68%			
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRI...	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	1,00%	0,00%	0,72%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	0,79%	2,18%	3,74%	5,25%	7,57%	0,20%	0,05%	0,81%			
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-	-			



Investimento no Exterior

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA ESTADO DE SÃO PAULO

Global BDRX	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa Adm	Var Mês	Volatilidade - 12 meses
Ativos									
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-10,62%	-10,62%	-9,28%	3,95%	12,50%	68,78%	1,00%	10,14	18,07%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	0,70%	10,47	17,53%
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-	-
MSCI ACWI									
Ativos									
SCHRÖDER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVES...	-11,14%	-11,14%	-11,75%	-1,79%	7,43%	-	0,85%	8,16	17,48%
MSCI ACWI (Benchmark)	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-	-
MSCI WORLD									
Ativos									
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	-8,26%	-8,26%	-6,17%	2,08%	12,56%	44,70%	0,70%	5,87	17,13%
MSCI WORLD (Benchmark)	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-	-

8) DELIBERAÇÕES

Deliberações do comitê de investimentos:

Aplicação:

BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO: Aplicação de R\$ 5.000.000,00 (cinco milhões de reais) no ativo para diversificação da carteira em ativos pré-fixados “puros”. Fundo de vértice com vencimento em 2024. Os recursos utilizados para a aplicação forma resgatadas do ativo CAIXA BR DISPONIBILIDADE.

Manutenção dos ativos em carteira com direcionamento dos repasse de contribuição para ativos de Renda Fixa com liquidez diária para aporte em oportunidade de investimentos em ativos de maior retorno.

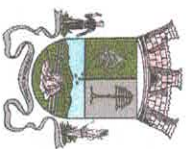
Repasse das contribuições dos entes - Estima-se o recebimento de aproximadamente R\$ 3.100.000,00 (três milhões e cem mil reais) que serão utilizados aproximadamente R\$ 900.000,00 (Novecentos mil reais) para pagamento de benefícios e custeio do RPPS. O Saldo restante ficará aplicado no fundo CX BR DISPONIBILIDADE para futura diversificação da carteira em ativos de gestão duration, CDI e renda variável.

- A carteira do RPPS atende as especificações e enquadramentos e limites da resol. 3922/2010.

- A carteira do RPPS possui 99,78% de liquidez, permitindo a manutenção do portfólio em casos de mudanças no cenário econômico.

- Não há desequilíbrio ou ativos em liquidação na carteira do RPPS.

- No fechamento de outubro, a carteira de investimentos encontra-se com rentabilidade abaixo da meta atuarial acumulada projetada, devido a disseminação da pandemia de COVID-19 e incertezas políticas.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

9) Credenciamento

Distribuidores

Distribuidores com credenciamento válidos.

Gestores

Gestores com credenciamento válidos.

Administradores

Administradores com credenciamento válidos.

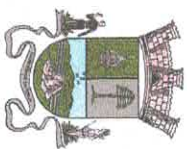
10) Assuntos Gerais:

O mês de janeiro foi de bons retornos nos fundos de ações com destaque para os fundos Meta Valor FIA e Quéluz Valor FIA, fundos de ações valor que durante todo o ano de 2021 apresentaram retorno negativo. Os rendimentos positivos dos fundos de ações foram minimizados pelas notícias no exterior que impactaram nos fundos de ações de investimento no exterior.

A disseminação rápida da variante Omicron da corona vírus e agora uma possível invasão da Rússia aos territórios da Ucrânia dominaram o noticiário do mês. Apesar de mais contagiosa a variante Omicron está com baixa letalidade devido ao avanço da vacinação que se mostra eficaz as variantes que surgem desde o início da pandemia. A Rússia ameaça invadir a Ucrânia devido a um possível ingresso do mesmo a OTAN, que possui países europeus aliados aos Estados Unidos o que poderia levar a instalação de bases americanas na Ucrânia vizinha a Rússia.

No cenário nacional, o COPOM manteve o ritmo de elevação de taxa de juros e elevou a Selic em 1.5p.p., fixando SELIC em 10,75%p.p. economistas ainda estimam outro aumento de 1,5%p.p. fixando a Selic em 12,25%p.p., por um período próximo as eleições iniciando novo processo de queda levando a próximo de 8,0%p.p. ao final de 2023. 2022 ainda será um ano de muita volatilidade também devido a eleições brasileiras em outubro que escolherá um novo presidente ou a reeleição de Jair Bolsonaro, pesquisas indicam polarização entre Bolsonaro e o ex-presidente Lula com grande margem para o ex-presidente que pode ser eleito ainda em primeiro turno. Espera-se ainda o surgimento de uma terceira via, que caminha entre Ciro Gomes, Sergio Moro e João Doria.

Na reunião do comitê de investimentos também foi debatida a política de investimentos para o ano de 2022, para o ano de 2022 a meta de rentabilidade da carteira será de IPCA + 4,88%, conforme a duração do passivo apresentado pelo cálculo atuarial vigente, em 16 de fevereiro de 2022 será apresentada pela consultoria de investimentos a política aprovada pelo comitê para apreciação e deliberações. Devido a publicação da resolução 4963/21 em substituição a resolução 3922/201 e suas alterações, foram prorrogados a aprovação e o envio da política para 31 de março de 2022, mesmo com esta prorrogação, a resolução já está em vigor desde 02 de janeiro de 2022 e as novas regras devem ser observadas mesmo sem uma política de investimentos vigente.



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Em janeiro foi apresentado ao comitê de investimentos a oportunidade de aporte ao fundo de vértice BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO, o fundo compra especificamente títulos do tesouro com vencimento em 2024, com isso o fundo possui carência de resgate até o vencimento das notas. Com o aumento da taxa SELIC estes fundos apresentam retornos contratados próximo a meta atuarial, opção a contratação dos títulos, públicos que o RPPS deverá contratar custodiante e corretagem de terceiro. Na carteira do RPPS, o valor aportado no fundo R\$5.000.000,00 (cinco milhões) atualmente representa pouco mais da carteira do RPPS no fechamento de janeiro/2022. Com isso o valor aportado não será necessário para cobertura das despesas correntes do RPPS até o vencimento, a também a expectativa de retorno próximo a meta atuarial sendo complementada pelos fundos de renda variável e investimento no exterior.

No processo de acompanhamento de mercado e reuniões com representantes de Asset's, o comitê de investimentos reuniu-se de forma virtual com representantes da asset Bayes Capital, o comitê ainda possui agenda com representantes do bando Daycoval, BNP Paribas, Torres Invest, Dolar Bills e BGC Corretora na sede do IPREJUN em Jundiaí/SP.

No processo de atualização e aprimoramento dos membros do comitê já a definição pela participação no Congresso Brasileiro de investimentos realizado pela ABIPEM em março de 2022 na cidade de Florianópolis SC, Congresso Estadual APEPREM em abril na cidade de Águas de Lindóia e No Congresso Jurídico Financeiro APEPREM em agosto de 2022 na cidade de São Paulo

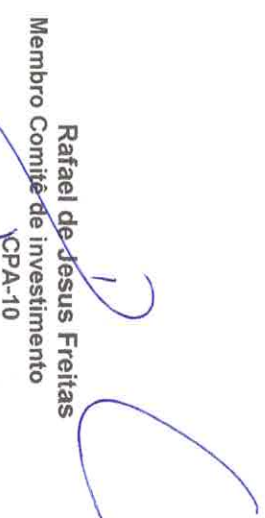
Credenciamentos em análise pelo comitê de investimentos:

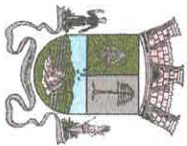
Fundos:

BAYES SISTEMÁTICO FI AÇÕES; GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES;
PRÓPRIO CAPITAL FI AÇÕES; DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NIVEL I
CAIXA BR 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS ; CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO


José Roberto dos Santos
Membro Comitê de Investimento
CPA-10


Alex Domingues de Castro Santos
Membro Comitê de Investimento
CPA-10/CGRPPS

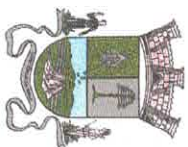

Rafael de Jesus Freitas
Membro Comitê de Investimento
CPA-10



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

APROVAÇÃO DO CONSELHO FISCAL

O Conselho Fiscal, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, aprovou o relatório de investimentos referente ao mês de JANEIRO DE 2022, conforme registro na ata de reunião em anexo



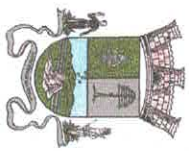
INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

RELATÓRIO DE INVESTIMENTOS

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2022



INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAP. DA SERRA
ESTADO DE SÃO PAULO

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	4.628.993,04	2,06%	103	3,91%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.669.423,50	1,19%	131	0,25%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.403.458,99	1,96%	18.800	0,13%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FI ...	Não se ...	Não se aplica	485.349,28	0,22%		0,17%	Artigo 11º
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	16.090,70	0,01%	172.631	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	10.272.522,70	4,57%	1.032	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	9.607.819,63	4,27%	787	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	961.362,75	0,43%	256	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.298.846,39	2,80%	631	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	4.994.357,89	2,22%	114	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.558.655,88	2,03%	306	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	16.818.529,03	7,48%	941	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	11.281.440,18	5,02%	1.059	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.825.066,24	6,59%	1.021	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.956.793,21	1,76%	834	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.363.407,28	1,05%	1.237	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	9.001.369,46	4,00%	583	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.591.780,36	1,60%	821	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.948.102,74	4,42%	191	0,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	14.392.227,97	6,40%	142	1,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

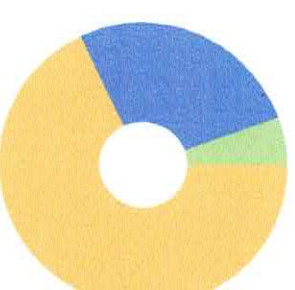
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.871.286,48	1,72%	881	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	2.103.493,02	0,94%	285	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	7.192.480,94	3,20%	4.763	5,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.716.138,75	5,21%	87	1,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IPCA XVII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	5.145.376,91	2,29%	98	2,37%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.991.992,39	1,33%	5.376	0,15%	Artigo 8º, Inciso I
BB AGRO FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	2.470.266,66	1,10%	7.848	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.025.489,01	3,12%	918	3,07%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+7 du	Não há	2.767.633,37	1,23%	13.432	0,61%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.089.874,16	1,37%	4.707	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.142.001,71	3,18%	230	2,58%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FIC AÇÕES	D+13	Não há	1.573.486,93	0,70%	77	1,57%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.376.379,26	1,06%	40	0,55%	Artigo 8º, Inciso I
SCHRODER BEST IDEAS FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.234.868,23	0,99%	7	3,88%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.380.137,90	1,50%	3.778	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.231.707,50	1,88%	33	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.141.058,60	2,73%	14	1,59%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.965.144,42	0,87%	30	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	D+5 du	Não há	1.588.102,60	0,71%	92	0,77%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIM...	D+4 du	Não há	1.564.546,35	0,70%	557	0,47%	Artigo 9º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.382.531,69	1,95%	24.831	0,35%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.879.522,07	2,17%	531	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			224.909.116,17				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	10,00%	50,00%	112.454.558,09	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	85.954.891,88	38,22%	20,00%	34,00%	116.463.312,67	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	6.747.273,49	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	61.816.879,72	27,49%	10,00%	14,50%	73.128.589,98	
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,00%	44.981.823,23	
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	5.145.376,91	2,29%	0,00%	5,00%	6.100.078,90	
Total Renda Fixa	100,00%	152.917.148,51	67,99%	30,00%	69,50%	228,00%	



RENDA FIXA 152.917.148,51

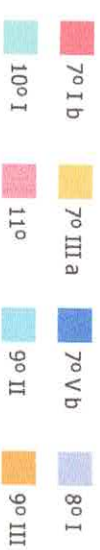
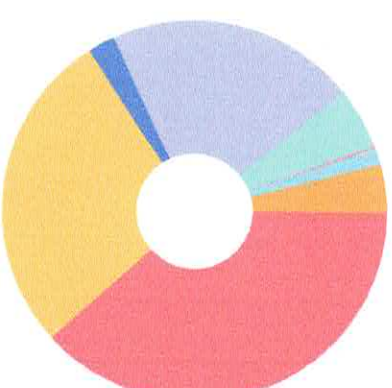
RENDA VARIÁVEL 59.577.264,95

EXTERIOR 12.414.702,71

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	47.390.040,14	21,07%	10,00%	19,00%	30,00%	20.082.694,71
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.245.455,81
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	11.701.875,53	5,20%	2,00%	5,00%	10,00%	10.789.036,09
Artigo 11º	5,00%	485.349,28	0,22%	0,00%	0,50%	1,00%	1.763.741,88
Total Renda Variável	30,00%	59.577.264,95	26,49%	12,00%	24,50%	46,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	3.152.648,95	1,40%	0,50%	3,00%	10,00%	19.338.262,67
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.262.053,76	4,12%	2,00%	6,00%	10,00%	13.228.857,86
Total Exterior	10,00%	12.414.702,71	5,52%	2,50%	9,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	91.268.680,76	40,58	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.225.941,27	25,00	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	14.092.518,01	6,27	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	11.381.224,98	5,06	0,02
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.948.102,74	4,42	0,00
TRIGONO CAPITAL	8.106.203,02	3,60	0,18
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	7.192.480,94	3,20	0,09
META ASSET MANAGEMENT	7.142.001,71	3,18	2,55
TARPON INVESTIMENTOS	4.231.707,50	1,88	0,07
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	3.799.414,58	1,69	0,05
SOMMA INVESTIMENTOS	3.380.137,90	1,50	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.089.874,16	1,37	0,21
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.991.992,39	1,33	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.573.486,93	0,70	0,31
ZION INVEST	485.349,28	0,22	0,06

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	85.954.891,88	38,22	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	61.816.879,72	27,49	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5.145.376,91	2,29	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	47.390.040,14	21,07	10,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	3.152.648,95	1,40	0,50	10,00
Artigo 9º, Inciso III	9.262.053,76	4,12	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	11.701.875,53	5,20	2,00	10,00
Artigo 11º	485.349,28	0,22	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Artigo 14º - 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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VAR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,05%	0,05%	3,41%	3,29%	4,87%	13,47%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	0,01%	3,16%	3,11%	4,47%	12,51%	1,06%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,02%	0,02%	3,17%	3,14%	4,54%	12,58%	1,11%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	1,03%	3,76%	8,77%	17,00%	29,59%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVII FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	0,27%	0,27%	3,14%	1,62%	2,65%	9,55%	0,91%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,61%	-1,61%	2,45%	-4,92%	-6,47%	-3,03%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,63%	-1,63%	2,40%	-5,08%	-6,71%	-3,70%	3,36%	0,07%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	0,61%	2,25%	2,44%	3,30%	6,63%	0,37%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,42%	3,32%	4,57%	12,47%	-	-
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%
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%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,04%	0,04%	3,24%	2,83%	3,59%	10,54%	1,02%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-0,73%	-0,73%	2,94%	-0,91%	-1,15%	4,02%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,77%	-0,77%	2,86%	-1,09%	-1,42%	3,46%	2,02%	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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,76%	-0,76%	2,87%	-1,06%	-1,42%	3,39%	2,01%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	0,79%	2,18%	3,74%	5,25%	7,57%	0,05%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,56%	0,56%	1,59%	2,48%	3,08%	3,49%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,61%	0,61%	1,72%	2,77%	3,83%	5,57%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,54%	0,54%	2,24%	5,63%	10,38%	15,41%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,67%	2,42%	0,62%	0,53%	6,39%	0,36%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,33%	0,33%	2,47%	2,45%	3,54%	6,00%	0,55%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,24%	0,24%	2,49%	1,09%	0,67%	4,30%	0,70%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	0,19%	2,51%	1,24%	1,20%	-	0,76%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,81%	0,81%	2,29%	1,41%	1,43%	-	0,07%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-	-	-	-	-	-	0,00%	-

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
Global BDRX (Benchmark)	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-10,62%	-10,62%	-9,28%	3,95%	12,50%	68,78%	10,14%	0,18%
IBX (Benchmark)	6,87%	6,87%	8,36%	-9,14%	-2,11%	-0,51%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	9,75%	9,75%	14,12%	-10,92%	-11,06%	-15,06%	11,85%	0,21%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	6,80%	6,80%	7,27%	-15,74%	-13,12%	-24,14%	8,15%	0,19%
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%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6,87%	6,87%	8,07%	-8,36%	-4,21%	-11,92%	8,52%	0,17%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	7,51%	7,51%	7,26%	-8,88%	-0,08%	-10,08%	9,32%	0,17%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,88%	3,88%	6,64%	-8,47%	2,09%	-9,60%	9,05%	0,17%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	9,15%	9,15%	10,15%	-8,85%	-5,27%	-5,23%	8,85%	0,19%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,12%	-3,12%	-4,37%	-13,04%	35,26%	-	14,98%	0,27%
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	12,34%	12,34%	11,27%	-5,61%	-4,81%	2,04%	8,99%	0,19%
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%	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,07%	-2,07%	-2,40%	-7,04%	-	-	13,54%	-

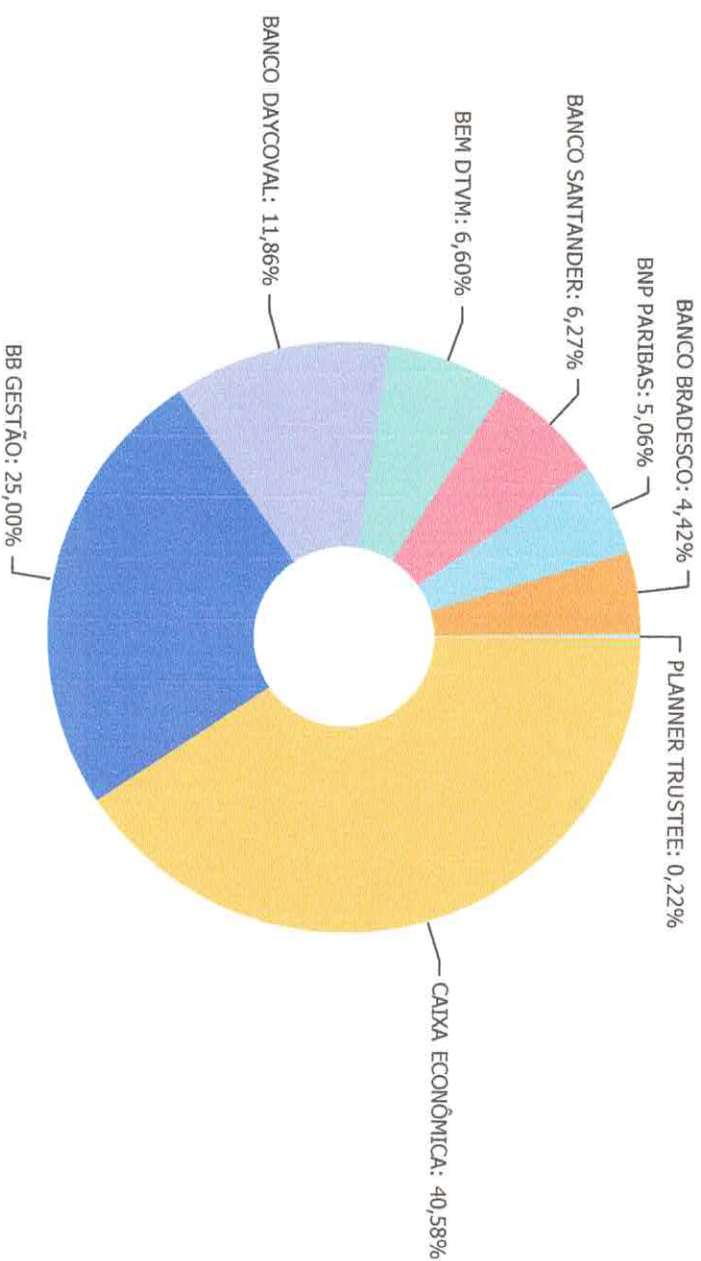
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	Var Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	3,42%	3,42%	4,89%	-17,43%	-10,25%	-14,29%	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	5,58%	5,58%	7,81%	-15,26%	-8,12%	-14,36%	15,97%	0,21%
CDI (Benchmark)	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	1,43%	3,67%	0,91%	3,58%	6,72%	1,73%	0,04%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,73%	0,73%	2,73%	1,75%	1,65%	-	1,13%	0,03%
MSCI ACWI (Benchmark)	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-5,30%	-5,30%	-0,53%	5,52%	25,85%	39,39%	8,59%	0,14%
IFIX (Benchmark)	-0,99%	-0,99%	3,78%	-1,67%	-3,56%	-9,76%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-24,91%	-24,91%	-18,43%	170,13%	201,45%	80,87%	41,52%	0,91%

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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NIVEL I	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	-10,62%	-10,62%	-9,28%	3,95%	12,50%	68,78%	10,14%	0,18%
MSCI WORLD (Benchmark)								
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	-9,13%	-9,13%	-8,52%	4,26%	12,44%	63,87%	-	-
	-8,26%	-8,26%	-6,77%	2,08%	12,96%	44,70%	5,87%	0,17%
MSCI ACWI (Benchmark)								
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	-8,76%	-8,76%	-8,61%	3,62%	9,17%	61,14%	-	-
	-11,14%	-11,14%	-11,79%	-1,79%	7,43%	-	8,16%	0,17%

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



CAIXA ECONÔMICA	91.268.680,76
BB GESTÃO	56.225.941,27
BANCO DAYCOVAL	26.672.393,17
BEM DTVM	14.834.905,96
BANCO SANTANDER	14.092.518,01
BNP PARIBAS	11.381.224,98
BANCO BRADESCO	9.948.102,74
PLANNER TRUSTEE	485.349,28

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

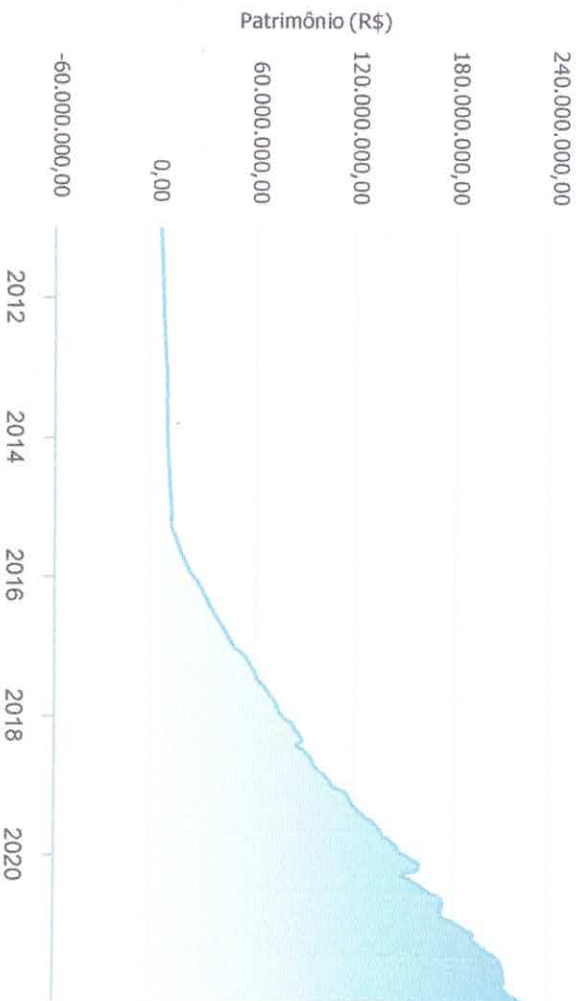
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	214.632.111,69	11.944.031,15	6.040.231,47	221.301.245,11	765.333,74	765.333,74	0,35%	0,35%	0,94%	0,94%	36,92%	3,59%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF- M IRF-M 1
 - IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
 - CDI IMA-B

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 (%)	(%) Instt	Var - Mês
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	14.276.443,76	0,00	0,00	14.392.227,97	115.784,21	0,81%	0,81%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.841.059,79	0,00	0,00	3.871.286,48	30.226,69	0,79%	0,79%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16.706.992,04	0,00	0,00	16.818.529,03	111.536,99	0,67%	0,67%	0,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.349.101,30	0,00	0,00	2.363.407,28	14.305,98	0,61%	0,61%	0,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.306.100,96	336.600,51	72.748,38	3.591.780,36	21.827,27	0,60%	0,65%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	16.032,61	0,00	27,80	16.090,70	85,89	0,54%	0,56%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	3.616.257,64	6.944.031,15	6.040.231,47	4.558.655,88	38.598,56	0,37%	0,61%	0,00%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	11.678.216,67	0,00	0,00	11.716.138,75	37.922,08	0,32%	0,32%	0,55%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	5.131.297,78	0,00	0,00	5.145.376,91	14.079,13	0,27%	0,27%	0,91%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.924.511,42	0,00	0,00	9.948.102,74	23.591,32	0,24%	0,24%	0,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.984.228,41	0,00	0,00	9.001.369,46	17.141,05	0,19%	0,19%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.811.679,77	0,00	0,00	14.825.066,24	13.386,47	0,09%	0,09%	0,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	9.600.445,26	0,00	0,00	9.607.819,63	7.374,37	0,08%	0,08%	1,00%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	7.189.467,81	0,00	0,00	7.192.480,94	3.013,13	0,04%	0,04%	1,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.279.318,22	0,00	0,00	11.281.440,18	2.121,96	0,02%	0,02%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	10.271.533,39	0,00	0,00	10.272.522,70	989,31	0,01%	0,01%	1,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIAR...	0,00	5.000.000,00	0,00	4.994.357,89	-5.642,11	-0,11%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.986.980,13	0,00	0,00	3.956.793,21	-30.186,92	-0,76%	-0,76%	2,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	2.119.675,02	0,00	0,00	2.103.493,02	-16.182,00	-0,76%	-0,76%	2,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.347.588,72	0,00	0,00	6.298.846,39	-48.742,33	-0,77%	-0,77%	2,02%

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 (%)	(%) Instít	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	977.272,34	0,00	0,00	961.362,75	-15.909,59	-1,63%	-1,63%	3,36%
Total Renda Fixa	146.414.203,04	12.280.631,66	6.113.007,65	152.917.148,51	335.321,46	0,22%		0,76%

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
SCHRODER BEST IDEAS FI AÇÕES	1.989.314,13	0,00	0,00	2.234.868,23	245.554,10	12,34%	12,34%	8,99%
META VALOR FI AÇÕES	6.507.828,02	0,00	0,00	7.142.001,71	634.173,69	9,74%	9,74%	11,85%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.436.457,39	0,00	0,00	7.026.489,01	589.031,62	9,15%	9,15%	8,85%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	3.144.101,19	0,00	0,00	3.380.137,90	236.036,71	7,51%	7,51%	9,32%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.223.662,15	0,00	0,00	2.376.379,26	152.717,11	6,87%	6,87%	8,52%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.473.368,06	0,00	0,00	1.573.486,93	100.118,87	6,80%	6,80%	8,15%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	2.613.047,03	0,00	0,00	2.767.633,37	154.586,34	5,92%	5,98%	15,97%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.974.527,30	0,00	0,00	3.089.874,16	115.346,86	3,88%	3,88%	9,05%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FI AÇÕES	2.915.054,54	0,00	0,00	2.991.992,39	76.937,85	2,64%	2,64%	9,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.631.839,37	0,00	0,00	2.669.423,50	37.584,13	1,43%	1,43%	1,73%
TARPON GT 30 FIC AÇÕES	4.175.634,27	0,00	0,00	4.231.707,50	56.073,23	1,34%	1,34%	10,08%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	4.596.430,43	0,00	0,00	4.628.993,04	33.562,61	0,73%	0,73%	1,13%
BB AGRO FIC AÇÕES	2.463.113,39	0,00	0,00	2.470.266,66	7.153,27	0,29%	0,29%	7,97%
TRIGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.270.630,79	0,00	0,00	6.141.056,60	-129.572,19	-2,07%	-2,07%	13,54%
TRIGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.028.409,20	0,00	0,00	1.965.144,42	-63.264,78	-3,12%	-3,12%	14,98%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.650.044,42	0,00	0,00	4.403.458,99	-246.585,43	-5,30%	-5,30%	8,59%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FIL - ...	646.354,57	0,00	0,00	485.349,28	-161.005,29	-24,91%	-24,91%	41,52%
Total Renda Variável	57.738.816,25	0,00	0,00	59.577.264,95	1.838.448,70	3,18%		9,64%

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
ACCESS EQUITY WORLD INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇ...	1.730.998,15	0,00	0,00	1.588.102,60	-142.895,55	-8,26%	-8,26%	5,87%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.406.435,23	0,00	0,00	4.879.522,07	-526.913,16	-9,75%	-9,75%	10,47%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.903.101,66	0,00	0,00	4.382.531,69	-520.569,97	-10,62%	-10,62%	10,14%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMEN...	1.760.690,93	0,00	0,00	1.564.546,35	-196.144,58	-11,14%	-11,14%	8,16%
Total Exterior	13.801.225,97	0,00	0,00	12.414.702,71	-1.386.523,26	-10,05%		9,47%

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.