

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

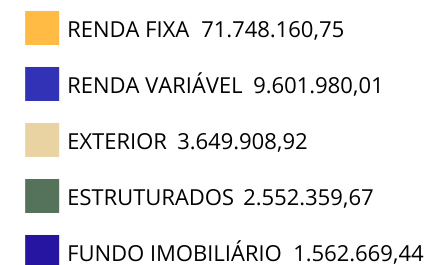
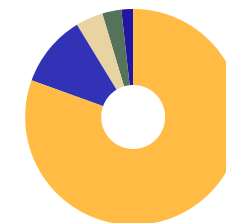
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|---------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1 | Não há | 2.931.958,05 | 3,29% | 1.032 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI... | D+1 | Não há | 9.893.384,77 | 11,10% | 113 | 1,67% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | D+0 | Não há | 7.285.323,88 | 8,18% | 941 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 7.621.036,94 | 8,55% | 1.059 | 0,07% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 6.720.391,84 | 7,54% | 1.021 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0 | Não há | 1.373.185,81 | 1,54% | 834 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0 | Não há | 2.925.733,67 | 3,28% | 1.237 | 0,05% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3 | Não há | 13.680.368,39 | 15,35% | 583 | 0,32% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 4.139.042,24 | 4,64% | 239 | 0,51% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 6.997.301,72 | 7,85% | 191 | 0,61% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 2.153.882,23 | 2,42% | 163 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 2.179.826,51 | 2,45% | 219 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 1.054.124,19 | 1,18% | 881 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1471 | Não há | 171.377,01 | 0,19% | 26 | 0,33% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1471 | Não há | 197.306,80 | 0,22% | 31 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | Não se ... | Não se aplica | 2.111,91 | 0,00% | 28 | 1,10% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | Não se ... | Não se aplica | 1.641.741,46 | 1,84% | 98 | 2,14% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P... | D+90 ou... | 18 meses | 780.063,33 | 0,88% | 14 | 8,35% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 1.962.014,44 | 2,20% | 27.194 | 0,13% | Artigo 8º, Inciso I |
| BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 2.832.729,49 | 3,18% | 164 | 0,50% | Artigo 8º, Inciso I |

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|--|------------|---------------|----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| QUELUZ VALOR FI AÇÕES | D+13 | Não há | 2.332.638,79 | 2,62% | 77 | 2,32% | Artigo 8º, Inciso I |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | D+4 | Não há | 2.474.597,29 | 2,78% | 3.778 | 0,68% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+3 | Não há | 1.166.786,97 | 1,31% | 29.093 | 0,17% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 2.483.121,95 | 2,79% | 531 | 0,07% | Artigo 9º, Inciso III |
| BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP | D+1 | Não há | 2.552.359,64 | 2,86% | 49.084 | 0,11% | Artigo 10º, Inciso I |
| ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP | D+4382 | Não há | 0,01 | 0,00% | 5 | 0,00% | Artigo 10º, Inciso I |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11 | Não se ... | Não se aplica | 0,02 | 0,00% | | 0,00% | Artigo 10º, Inciso II |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | Não se ... | Não se aplica | 1.562.669,44 | 1,75% | | 4,13% | Artigo 11º |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 89.115.078,79 | | | | |

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

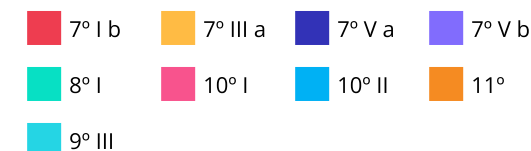
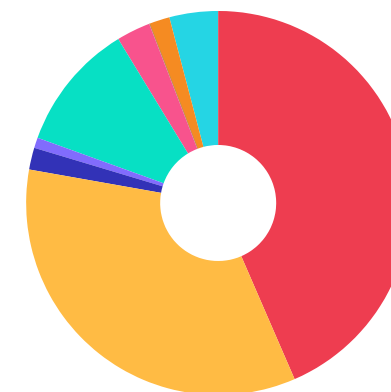
| Artigos - Renda Fixa | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2022 | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 17,89% | 59,24% | 52.791.772,68 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 100,00% | 38.751.014,96 | 43,48% | 13,79% | 17,89% | 59,24% | 14.040.757,72 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 30.573.229,09 | 34,31% | 12,62% | 16,82% | 50,00% | 13.984.310,31 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 16,82% | 20,00% | 17.823.015,76 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' | 5,00% | 1.643.853,37 | 1,84% | 0,00% | 2,09% | 2,09% | 218.651,78 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 5,00% | 780.063,33 | 0,88% | 0,00% | 2,78% | 5,00% | 3.675.690,61 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 71.748.160,75 | 80,51% | 26,41% | 74,29% | 195,57% | |



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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2022 | | | GAP Superior |
|---|---------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 9.601.980,01 | 10,77% | 11,21% | 12,70% | 20,00% | 8.221.035,75 |
| Artigo 8º, Inciso II | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,24% | 20,00% | 17.823.015,76 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 2.552.359,65 | 2,86% | 2,09% | 2,78% | 10,00% | 6.359.148,23 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 0,02 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -0,02 |
| Artigo 11º | 5,00% | 1.562.669,44 | 1,75% | 0,00% | 1,99% | 1,99% | 210.720,63 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 13.717.009,12 | 15,39% | 13,30% | 19,71% | 51,99% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2022 | | | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|---------------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 3.649.908,92 | 4,10% | 3,75% | 5,00% | 10,00% | 5.261.598,96 |
| Total Exterior | 10,00% | 3.649.908,92 | 4,10% | 3,75% | 5,00% | 10,00% | |



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM | 29.462.918,28 | 33,06 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 26.432.529,73 | 29,66 | 0,00 |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT | 24.057.124,72 | 27,00 | 0,00 |
| QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS | 3.895.308,23 | 4,37 | 0,76 |
| SOMMA INVESTIMENTOS | 2.474.597,29 | 2,78 | - |
| PETRA CAPITAL | 1.641.741,46 | 1,84 | 0,18 |
| SECURITY ADMINISTRADORA DE REC... | 780.063,33 | 0,88 | 0,03 |
| GENIAL GESTÃO LTDA | 199.418,72 | 0,22 | 0,00 |
| RJI CORRETORA DE VALORES | 171.377,01 | 0,19 | 0,03 |
| ÍNDIGO DTVM | 0,02 | 0,00 | - |

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)

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 | 59,24 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 38.751.014,96 | 43,48 | 13,79 | 59,24 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 16.892.860,70 | 18,96 | 12,62 | 50,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' | 1.643.853,37 | 1,84 | 0,00 | 2,09 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b ' | 780.063,33 | 0,88 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 9.601.980,01 | 10,77 | 11,21 | 20,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 20,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 3.649.908,92 | 4,10 | 3,75 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 2.552.359,65 | 2,86 | 2,09 | 10,00 |
| Artigo 11º | 1.562.669,44 | 1,75 | 0,00 | 1,99 |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| CDI + 3,50% ao ano (Benchmark) | 1,02% | 1,02% | 2,99% | 5,28% | 8,68% | 15,29% | - | - |
| MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | -11,22% | -11,22% | -22,80% | -45,99% | -68,64% | -70,61% | - | 0,15% |
| IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark) | 0,05% | 0,05% | 3,41% | 3,29% | 4,87% | 13,47% | - | - |
| 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% |
| 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% |
| 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% | - | - |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | -0,08% | -0,08% | 0,80% | -0,35% | -1,33% | -38,04% | 0,44% | 0,02% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 0,08% | 0,08% | 3,34% | 3,06% | 3,76% | 11,27% | 0,98% | 0,03% |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | -0,11% | -0,11% | -0,38% | -5,00% | -20,76% | -78,46% | 0,19% | 0,17% |
| 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% |
| IMA-B (Benchmark) | -0,73% | -0,73% | 2,94% | -0,91% | -1,15% | 4,02% | - | - |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,76% | -0,76% | 2,89% | -1,02% | -1,38% | 3,29% | 2,01% | 0,05% |
| 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% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | -0,76% | -0,76% | 2,86% | -1,08% | -1,50% | 3,29% | 2,01% | 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 |
|---|--------|--------|--------|--------|--------|---------|---------|------------------|
| CDI (Benchmark) | 0,73% | 0,73% | 2,10% | 3,47% | 5,00% | 7,66% | - | - |
| SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP | -0,35% | -0,35% | 1,45% | -0,65% | -0,62% | -1,15% | 1,14% | 0,03% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | -0,17% | -0,17% | -1,01% | -1,66% | -5,79% | -10,04% | 0,01% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,79% | 0,79% | 2,18% | 3,74% | 5,25% | 7,57% | 0,05% | 0,01% |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,78% | 0,78% | 2,24% | 3,85% | 5,59% | 7,61% | 0,01% | 0,01% |
| IPCA (Benchmark) | 0,54% | 0,54% | 2,24% | 5,63% | 10,38% | 15,41% | - | - |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,19% | 0,19% | 2,51% | 1,24% | 1,20% | - | 0,76% | 0,03% |
| BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,24% | 0,24% | 2,49% | 1,09% | 0,67% | 4,30% | 0,70% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 0,67% | 0,67% | 2,42% | 0,62% | 0,53% | 6,39% | 0,36% | 0,03% |

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

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark) | 1,23% | 1,23% | 4,38% | 10,06% | 19,76% | 35,73% | - | - |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| IPCA (Benchmark) | 0,54% | 0,54% | 2,24% | 5,63% | 10,38% | 15,41% | - | - |
| ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP | 1,53% | 1,53% | 4,74% | 9,95% | 22,09% | - | 0,00% | 0,00% |
| IFIX (Benchmark) | -0,99% | -0,99% | 3,78% | -1,67% | -3,56% | -9,76% | - | - |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,26% | 6,65% | 0,00% | 0,09% |
| Ibovespa (Benchmark) | 6,98% | 6,98% | 8,35% | -7,93% | -2,54% | -1,42% | - | - |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | 6,78% | 6,78% | 6,78% | -12,54% | -9,79% | -14,15% | 10,10% | 0,18% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 6,49% | 6,49% | 8,64% | -2,97% | 5,03% | 11,07% | 8,38% | 0,16% |
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 7,51% | 7,51% | 7,26% | -8,88% | -0,08% | -10,08% | 9,32% | 0,17% |
| QUELUZ VALOR FI AÇÕES | 6,80% | 6,80% | 7,27% | -15,74% | -13,12% | -24,14% | 8,15% | 0,19% |
| 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% |
| CDI (Benchmark) | 0,73% | 0,73% | 2,10% | 3,47% | 5,00% | 7,66% | - | - |
| BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 1,32% | 1,32% | 2,02% | 2,41% | 3,59% | 7,61% | 0,62% | 0,02% |



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

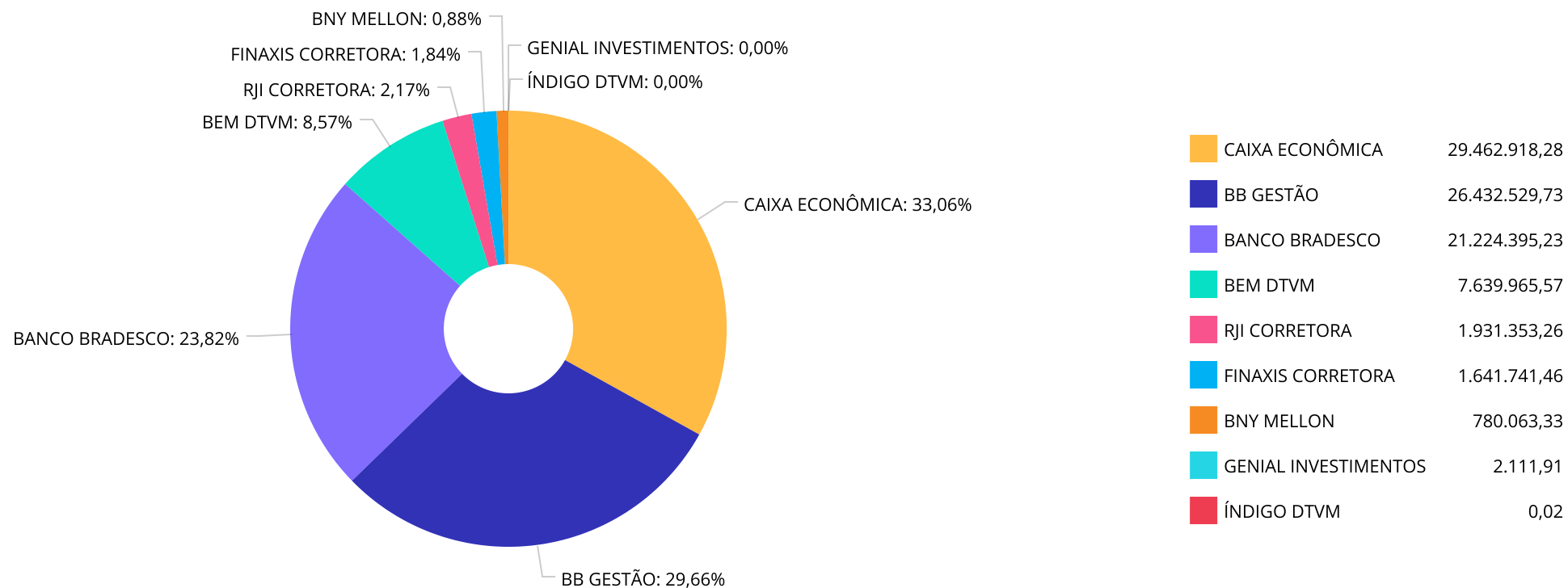
| Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-----|-----|----|----|-----|-----|---------|------------------|
|-----|-----|----|----|-----|-----|---------|------------------|



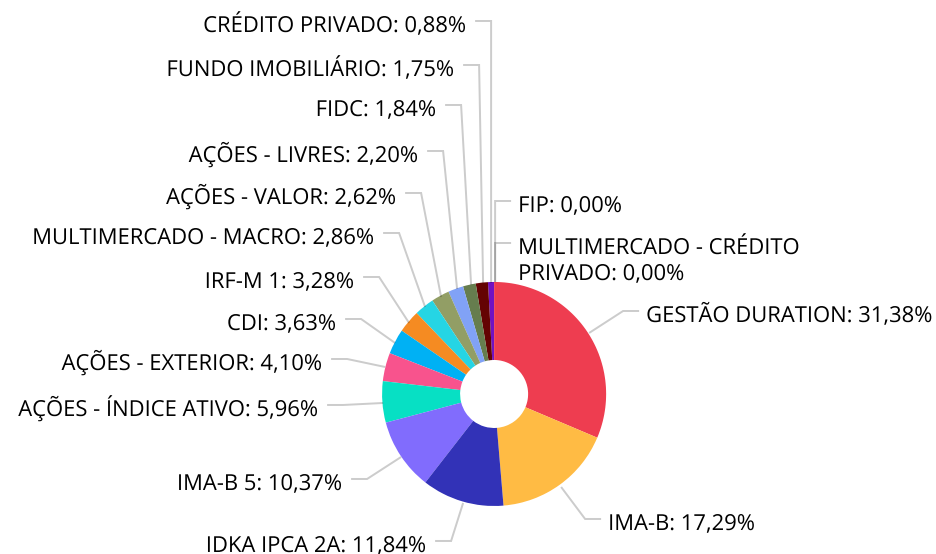
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | 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 NÍVEL I | -9,75% | -9,75% | -9,03% | 3,11% | 11,35% | 71,14% | 10,47% | 17,527% |
| BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I | -7,58% | -7,58% | -10,88% | -23,24% | -16,77% | -5,14% | 12,36% | 13,773% |

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



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



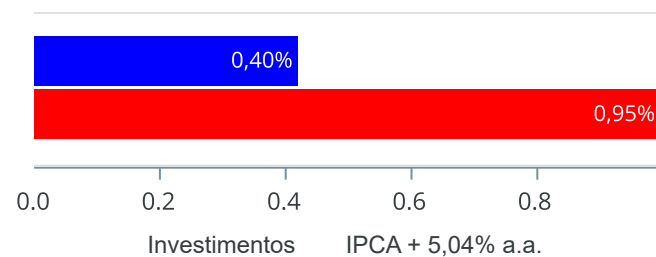
| | | | | | |
|----------------------------------|---------------|------------------------|---------------|------------------------|---------------|
| ■ GESTÃO DURATION | 27.962.993,99 | ■ IMA-B | 15.405.612,82 | ■ IDKA IPCA 2A | 10.552.994,99 |
| ■ IMA-B 5 | 9.242.957,88 | ■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 5.307.326,78 | ■ AÇÕES - EXTERIOR | 3.649.908,92 |
| ■ CDI | 3.233.950,70 | ■ IRF-M 1 | 2.925.733,67 | ■ MULTIMERCADO - MACRO | 2.552.359,64 |
| ■ AÇÕES - VALOR | 2.332.638,79 | ■ AÇÕES - LIVRES | 1.962.014,44 | ■ FIDC | 1.643.853,37 |
| ■ FUNDO IMOBILIÁRIO | 1.562.669,44 | ■ CRÉDITO PRIVADO | 780.063,33 | ■ FIP | 0,02 |
| ■ MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO | 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 | 77.145.329,80 | 7.549.952,44 | 4.815.604,25 | 80.195.550,11 | 315.872,12 | 315.872,12 | 0,40% | 0,40% | 0,95% | 0,95% | 41,50% | 2,25% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



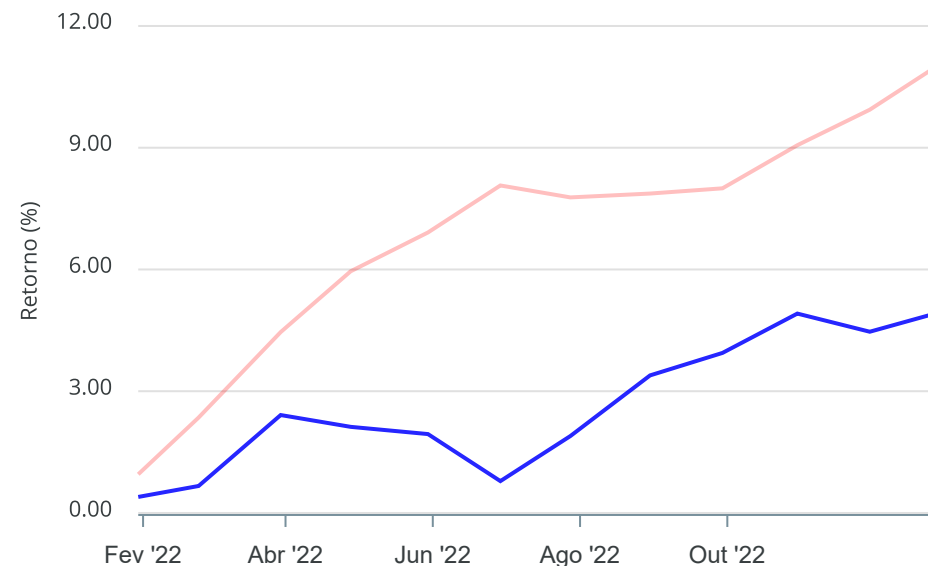
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B

IMA-B 5

IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+

Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.045.893,68 | 0,00 | 0,00 | 1.054.124,19 | 8.230,51 | 0,79% | 0,79% | 0,05% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 7.237.009,12 | 0,00 | 0,00 | 7.285.323,88 | 48.314,76 | 0,67% | 0,67% | 0,36% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.908.023,86 | 0,00 | 0,00 | 2.925.733,67 | 17.709,81 | 0,61% | 0,61% | 0,37% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,00 | 4.456.109,70 | 2.289.133,46 | 2.179.826,51 | 12.850,27 | 0,29% | 0,78% | 0,01% |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 6.980.708,03 | 0,00 | 0,00 | 6.997.301,72 | 16.593,69 | 0,24% | 0,24% | 0,70% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 13.654.317,24 | 0,00 | 0,00 | 13.680.368,39 | 26.051,15 | 0,19% | 0,19% | 0,76% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 6.714.323,58 | 0,00 | 0,00 | 6.720.391,84 | 6.068,26 | 0,09% | 0,09% | 0,99% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA | 2.152.263,30 | 0,00 | 0,00 | 2.153.882,23 | 1.618,93 | 0,08% | 0,08% | 0,98% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 7.619.603,49 | 0,00 | 0,00 | 7.621.036,94 | 1.433,45 | 0,02% | 0,02% | 1,11% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 2.931.675,68 | 0,00 | 0,00 | 2.931.958,05 | 282,37 | 0,01% | 0,01% | 1,06% |
| TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 171.518,68 | 0,00 | 0,00 | 171.377,01 | -141,67 | -0,08% | -0,08% | 0,44% |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 197.519,24 | 0,00 | 0,00 | 197.306,80 | -212,44 | -0,11% | -0,11% | 0,19% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1 | 1.644.500,35 | 0,00 | 0,00 | 1.641.741,46 | -2.758,89 | -0,17% | -0,17% | 0,01% |
| SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI... | 782.835,96 | 0,00 | 0,00 | 780.063,33 | -2.772,63 | -0,35% | -0,35% | 1,14% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ... | 6.897.022,76 | 3.093.842,74 | 59.651,64 | 9.893.384,77 | -37.829,09 | -0,38% | -0,76% | 2,01% |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA | 2.538.289,08 | 0,00 | 2.526.470,79 | 0,00 | -11.818,29 | -0,47% | -0,47% | 1,99% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 1.383.662,03 | 0,00 | 0,00 | 1.373.185,81 | -10.476,22 | -0,76% | -0,76% | 2,01% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4.170.623,96 | 0,00 | 0,00 | 4.139.042,24 | -31.581,72 | -0,76% | -0,76% | 2,01% |
| MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 2.378,68 | 0,00 | 0,00 | 2.111,91 | -266,77 | -11,22% | - | - |
| Total Renda Fixa | 69.032.168,72 | 7.549.952,44 | 4.875.255,89 | 71.748.160,75 | 41.295,48 | 0,06% | | 0,99% |

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 |
|--|----------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| SOMMA BRASIL FI AÇÕES | 2.301.794,93 | 0,00 | 0,00 | 2.474.597,29 | 172.802,36 | 7,51% | 7,51% | 9,32% |
| QUELUZ VALOR FI AÇÕES | 2.184.216,10 | 0,00 | 0,00 | 2.332.638,79 | 148.422,69 | 6,80% | 6,80% | 8,15% |
| BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES | 2.652.972,56 | 0,00 | 0,00 | 2.832.729,49 | 179.756,93 | 6,78% | 6,78% | 10,10% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 1.842.518,90 | 0,00 | 0,00 | 1.962.014,44 | 119.495,54 | 6,49% | 6,49% | 8,38% |
| BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 2.519.140,98 | 0,00 | 0,00 | 2.552.359,64 | 33.218,66 | 1,32% | 1,32% | 0,62% |
| CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11 | 0,02 | 0,00 | 0,00 | 0,02 | 0,00 | 0,00% | - | - |
| ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP | 0,01 | 0,00 | 0,00 | 0,01 | 0,00 | 0,00% | 1,53% | 0,00% |
| ÁQUILLA FII - AQLL11 | 1.576.598,12 | 0,00 | 0,00 | 1.562.669,44 | -13.928,68 | -0,88% | 0,00% | 0,00% |
| Total Renda Variável | 13.077.241,62 | 0,00 | 0,00 | 13.717.009,12 | 639.767,50 | 4,89% | | 6,47% |



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 |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|--------------------|---------------|------------|---------------|
| BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 1.262.433,08 | 0,00 | 0,00 | 1.166.786,97 | -95.646,11 | -7,58% | -7,58% | 12,36% |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 2.751.260,85 | 0,00 | 0,00 | 2.483.121,95 | -268.138,90 | -9,75% | -9,75% | 10,47% |
| Total Exterior | 4.013.693,93 | 0,00 | 0,00 | 3.649.908,92 | -363.785,01 | -9,06% | | 11,07% |

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 & MERCADO GESTÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.. 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.

