

# **RELATORIO DE INVESTIMENTOS**

## **JANEIRO 2022**

## SUMÁRIO

1. Apresentação .....	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos .....	3
3. Aprovação do Conselho de Administração .....	3

Handwritten signatures and initials in blue ink, including a large signature at the top right, a circular stamp or signature below it, and several other initials and marks scattered around the page number.

## 1. APRESENTAÇÃO

---

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

## 2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

---

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês jan/2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

## 3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

---

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de janeiro de 2022, em reunião realizada em 13 de abril de 2022.


Rosana Teixeira de Carvalho

  
\_\_\_\_\_

Lisete de Fátima Oliveira

  
\_\_\_\_\_


Silvia Cristina de Almas de Alcântara

  
\_\_\_\_\_

Solange Siqueira Duarte Silva

  
\_\_\_\_\_

Mauracy Moraes de Oliveira

  
\_\_\_\_\_



CRÉDITO  
& MERCADO

# 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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	38.614.139,31	10,17%	787	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	21.028.392,29	5,54%	631	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	18.728.222,31	4,93%	1.126	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	11.115.435,96	2,93%	113	1,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	34.621.381,96	9,12%	941	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIC R...	D+0	Não há	10.006.324,24	2,64%	1.059	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	31.683.208,21	8,35%	1.021	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	15.717.934,37	4,14%	834	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.310.070,36	1,14%	821	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.737.404,33	2,57%	110	1,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	18.844.059,84	4,96%	142	1,93%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	29.012.284,52	7,64%	285	1,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	24.997.665,98	6,59%	248	0,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	21.962.731,46	5,79%	836	4,69%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	15.185.797,16	4,00%	132	2,08%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	16.535.427,70	4,36%	49	2,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.596.139,95	3,06%	105	1,41%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.079.431,04	0,81%	24.831	0,24%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.065.444,06	0,81%	531	0,09%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.193.560,46	0,58%	4.556	0,89%	Artigo 9º, Inciso III



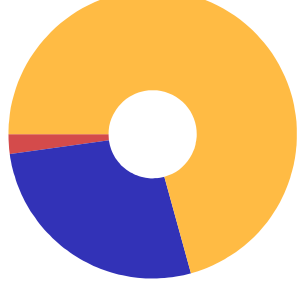
**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	19.466.272,12	5,13%	3.269	2,48%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	18.072.956,62	4,76%	12.029	1,32%	Artigo 10º, Inciso I
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>379.574.284,25</b>				



**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%	25,00%	50,00%	189.787.142,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	181.515.038,65	47,82%	12,00%	17,00%	50,00%	8.272.103,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	86.901.485,03	22,89%	10,00%	25,00%	60,00%	140.843.085,52
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	20,00%	75.914.856,85
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	18.978.714,21
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>268.416.523,68</b>	<b>70,72%</b>	<b>22,00%</b>	<b>87,00%</b>	<b>185,00%</b>	



RENDA FIXA 268.416.523,68

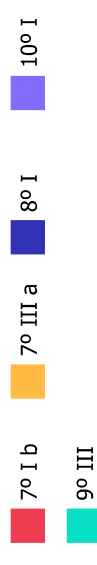
RENDA VARIÁVEL 102.819.325,01

EXTERIOR 8.338.435,56

**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%	65.280.096,27	17,20%	4,00%	10,00%	15,00%	-8.343.953,63
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	37.539.228,74	9,89%	0,00%	1,00%	5,00%	-18.560.514,53
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>102.819.325,01</b>	<b>27,09%</b>	<b>4,00%</b>	<b>11,00%</b>	<b>20,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	8.338.435,56	2,20%	0,00%	2,00%	5,00%	10.640.278,65
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>8.338.435,56</b>	<b>2,20%</b>	<b>0,00%</b>	<b>2,00%</b>	<b>5,00%</b>	







**Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	195.675.663,10	51,55	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	107.722.986,77	28,38	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	24.997.665,98	6,59	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	20.852.840,29	5,49	0,00
ITAÚ DTVM	16.535.427,70	4,36	0,00
ITAÚ UNIBANCO	13.789.700,41	3,63	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	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	181.515.038,65	47,82	12,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	86.901.485,03	22,89	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	65.280.096,27	17,20	4,00	15,00
Artigo 9º, Inciso III	8.338.435,56	2,20	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	37.539.228,74	9,89	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,63%	0,63%	2,31%	2,54%	3,53%	7,08%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	0,61%	2,25%	2,43%	3,24%	6,41%	0,38%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-0,73%	-0,73%	2,94%	-0,91%	-1,15%	4,02%	-	-
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%
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,74%	-0,74%	2,81%	-1,28%	-2,06%	2,77%	1,93%	0,05%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,76%	-0,76%	2,86%	-1,08%	-1,50%	3,29%	2,01%	0,05%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,84%	2,91%	3,86%	5,35%	0,00%	0,01%



**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
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%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,81%	0,81%	2,29%	1,41%	1,43%	-	0,07%	0,02%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,52%	0,52%	3,06%	3,87%	4,94%	7,72%	0,38%	0,02%

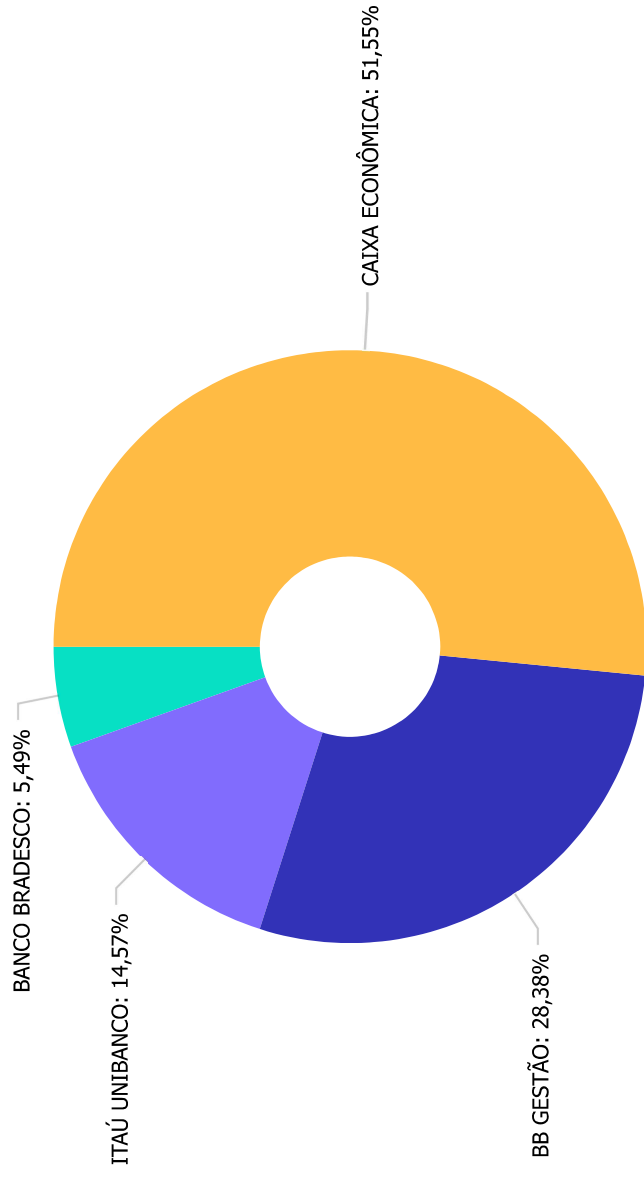
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	-9,77%	-9,77%	-8,63%	5,47%	15,92%	77,11%	-	-
<b>BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-10,62%	-10,62%	-9,28%	3,95%	12,50%	68,78%	10,14%	0,18%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
<b>CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	6,98%	6,98%	8,35%	-7,93%	-2,54%	-1,42%	-	-
<b>ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES</b>	5,16%	5,16%	2,66%	-20,19%	-10,21%	-32,32%	10,97%	0,20%
<b>ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES</b>	6,58%	6,58%	6,34%	-12,24%	-9,03%	-9,86%	10,20%	0,17%
<b>BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES</b>	6,74%	6,74%	8,20%	-9,31%	-3,83%	-7,73%	7,95%	0,16%
<b>CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES</b>	9,48%	9,48%	10,23%	-8,18%	-4,17%	-6,79%	8,76%	0,19%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,73%	0,73%	2,10%	3,47%	5,00%	7,66%	-	-
<b>CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP</b>	2,67%	2,67%	4,10%	0,38%	2,42%	4,66%	2,40%	0,05%
<b>CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP</b>	1,03%	1,03%	2,36%	3,80%	5,01%	8,14%	0,26%	0,01%

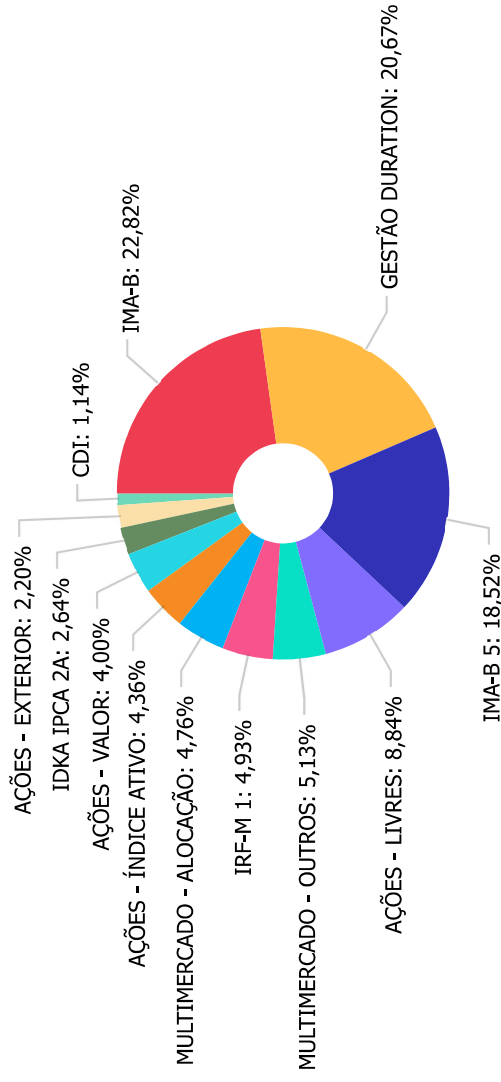


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b>	-9,77%	-9,77%	-8,63%	5,47%	15,92%	77,11%	-	-
<b>BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-10,62%	-10,62%	-9,28%	3,95%	12,50%	68,78%	10,14%	0,18%
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-9,83%	-9,83%	-8,91%	3,38%	13,57%	74,32%	-	-
<b>ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-3,83%	-3,83%	-4,05%	9,54%	20,21%	57,28%	9,23%	0,15%
<b>CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I</b>	-9,75%	-9,75%	-9,03%	3,11%	11,35%	71,14%	10,47%	0,18%



CAIXA ECONÔMICA	195.675.663,10
BB GESTÃO	107.722.986,77
ITAÚ UNIBANCO	55.322.794,09
BANCO BRADESCO	20.852.840,29



IMA-B	86.611.451,47	GESTÃO DURATION	78.463.107,78	IMA-B 5	70.297.347,52	AÇÕES - LIVRES	33.558.871,41
MULTIMERCADO - OUTROS	19.466.272,12	IRF-M 1	18.728.222,31	MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	18.072.956,62	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	16.535.427,70
AÇÕES - VALOR	15.185.797,16	IDKA IPCA 2A	10.006.324,24	AÇÕES - EXTERIOR	8.338.435,56	CDI	4.310.070,36



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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

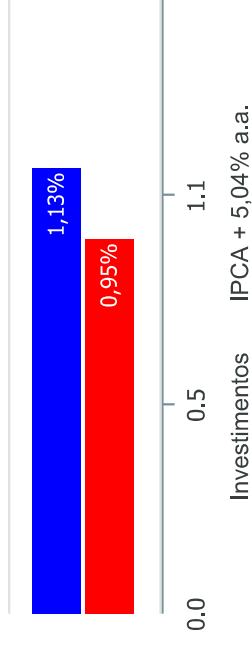




**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022**

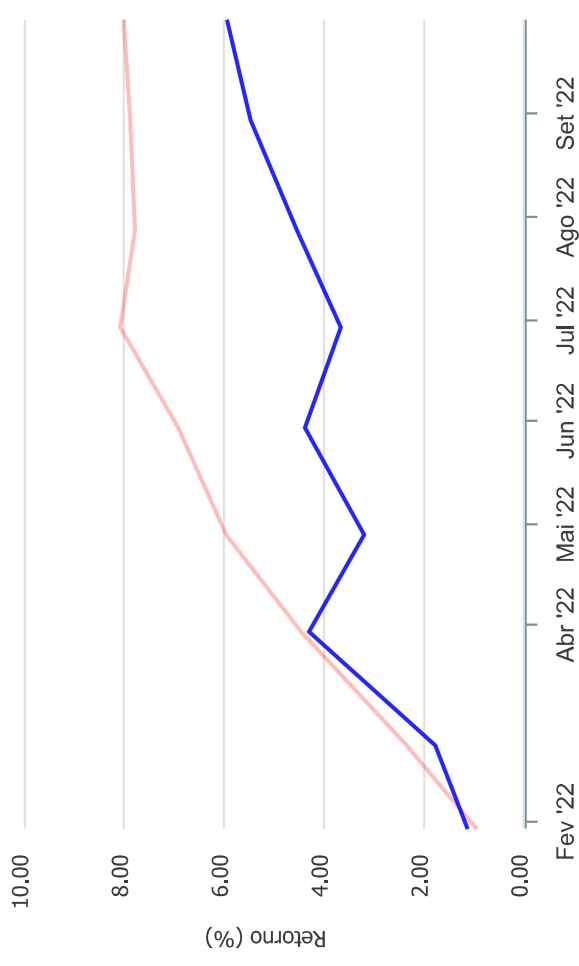
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	376.717,647,44	10.356.964,81	11.768.751,83	379.574.284,25	4.268.423,83	4.268.423,83	1,13%	1,13%	0,95%	0,95%	118,92%	2,69%

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**





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  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  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 ATIVA FIC RENDA FIXA LP	18.692.461,02	0,00	0,00	18.844.059,84	151.598,82	0,81%	0,81%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	18.613.923,23	0,00	0,00	18.728.222,31	114.299,08	0,61%	0,61%	0,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	44.360.024,71	0,00	10.000.000,00	34.621.381,96	261.357,25	0,59%	0,67%	0,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.686.679,40	356.964,81	1.768.751,83	4.310.070,36	35.177,98	0,58%	0,65%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	24.867.765,58	0,00	0,00	24.997.665,98	129.900,40	0,52%	0,52%	0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	31.654.599,46	0,00	0,00	31.683.208,21	28.608,75	0,09%	0,09%	0,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	38.584.501,46	0,00	0,00	38.614.139,31	29.637,85	0,08%	0,08%	1,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.006.324,24	6.324,24	0,06%	0,02%	1,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9.809.541,60	0,00	0,00	9.737.404,33	-72.137,27	-0,74%	-0,74%	1,93%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	15.837.848,60	0,00	0,00	15.717.934,37	-119.914,23	-0,76%	-0,76%	2,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	11.200.738,14	0,00	0,00	11.115.435,96	-85.302,18	-0,76%	-0,76%	2,01%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	29.235.473,76	0,00	0,00	29.012.284,52	-223.189,24	-0,76%	-0,76%	2,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	21.191.116,19	0,00	0,00	21.028.392,29	-162.723,90	-0,77%	-0,77%	2,02%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>269.734.673,15</b>	<b>10.356.964,81</b>	<b>11.768.751,83</b>	<b>268.416.523,68</b>	<b>93.637,55</b>	<b>0,03%</b>		<b>1,07%</b>



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	13.871.260,04	0,00	0,00	15.185.797,16	1.314.537,12	9,48%	9,48%	8,76%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	20.576.212,61	0,00	0,00	21.962.731,46	1.386.518,85	6,74%	6,74%	7,95%
ITAU FOF RPI IBOVSPA ATIVO FIC AÇÕES	15.515.214,23	0,00	0,00	16.535.427,70	1.020.213,47	6,58%	6,43%	10,20%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.027.239,75	0,00	0,00	11.596.139,95	568.900,20	5,16%	5,16%	10,97%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	17.602.673,28	0,00	0,00	18.072.956,62	470.283,34	2,67%	2,67%	2,40%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	19.267.759,40	0,00	0,00	19.466.272,12	198.512,72	1,03%	1,03%	0,26%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>97.860.359,31</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>102.819.325,01</b>	<b>4.958.965,70</b>	<b>5,07%</b>		<b>6,34%</b>



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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.280.935,32	0,00	0,00	2.193.560,46	-87.374,86	-3,83%	-3,83%	9,23%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.396.464,77	0,00	0,00	3.065.444,06	-331.020,71	-9,75%	-9,75%	10,47%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.445.214,89	0,00	0,00	3.079.431,04	-365.783,85	-10,62%	-10,62%	10,14%
<b>Total Exterior</b>	<b>9.122.614,98</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8.338.435,56</b>	<b>-784.179,42</b>	<b>-8,60%</b>		<b>10,02%</b>



#### Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

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

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.