

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.863.925,55	5,11%	102	1,59%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	552.933,86	1,52%	1.170	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.700.317,70	10,14%	1.027	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.718.647,37	12,93%	789	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.244.886,11	3,41%	1.120	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.020.759,21	8,28%	931	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.921.421,88	8,01%	8.584	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.892.238,85	18,89%	581	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.551.576,65	4,25%	192	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	472.463,54	1,29%	163	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	458.300,66	1,26%	893	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	597.729,80	1,64%	30	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+1	Não há	1.598.329,35	4,38%	328	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.582.218,80	4,34%	816	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.869.985,48	7,86%	2.448	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	768.984,83	2,11%	85	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	837.925,64	2,30%	8.449	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4 du	Não há	841.396,67	2,31%	149	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			36.494.041,95				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Fevereiro / 2022)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2022** não está cadastrada !!!

Enquadramento e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2022)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.713.616,53	64,98	0,00
SICREDI	4.519.751,23	12,38	0,01
CAIXA DTVM	3.479.059,87	9,53	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.024.040,19	5,55	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.919.648,49	5,26	0,00
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	837.925,64	2,30	0,01

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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 Fevereiro/2022 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,26%	1,31%	2,15%	4,31%	6,70%	14,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	1,17%	1,88%	4,11%	6,26%	13,10%	1,13%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,74%	1,38%	2,27%	2,93%	4,26%	7,47%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	1,36%	2,21%	2,84%	4,00%	6,81%	0,32%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,06%	1,18%	1,97%	4,26%	6,32%	12,94%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	1,13%	1,90%	4,10%	6,00%	12,30%	1,07%	0,03%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,04%	1,12%	1,90%	4,06%	5,68%	11,70%	1,07%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,54%	-0,19%	0,03%	0,73%	0,92%	4,12%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,51%	-0,22%	-0,08%	0,42%	0,42%	2,47%	1,77%	0,05%
CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,98%	1,58%	1,83%	6,20%	-	-	0,36%	-
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,78%	1,55%	2,30%	3,88%	5,64%	7,75%	0,03%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	1,61%	2,38%	4,08%	6,03%	8,15%	0,04%	0,01%
IPCA (Benchmark)	1,01%	1,56%	2,30%	5,77%	10,54%	16,29%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	0,86%	1,63%	2,38%	2,83%	-	0,60%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,67%	0,91%	1,70%	2,28%	2,32%	4,59%	0,61%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,81%	1,48%	2,32%	2,93%	1,86%	6,59%	0,35%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-2,90%	-8,00%	-3,99%	-3,05%	15,05%	48,42%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-2,18%	-7,36%	-2,22%	-0,12%	19,96%	49,66%	10,43%	0,14%

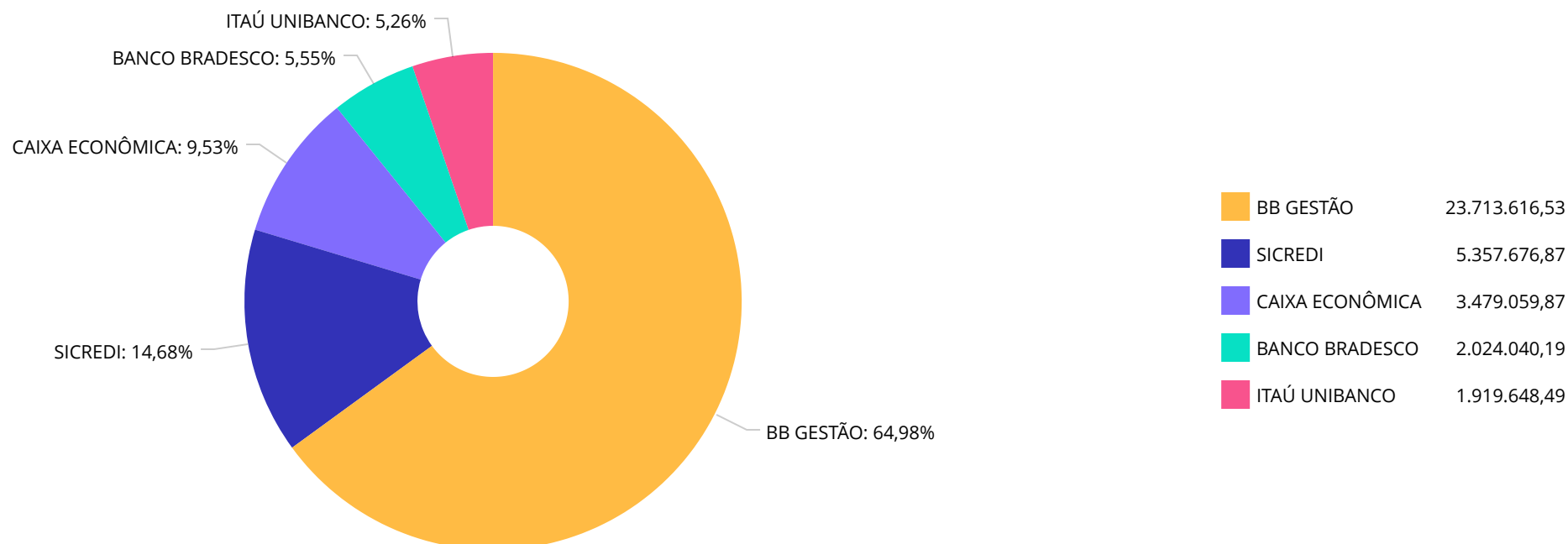
Ibovespa (Benchmark)	0,89%	7,94%	11,02%	-4,75%	2,82%	8,61%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	0,56%	7,33%	10,66%	-5,65%	-0,38%	1,38%	5,92%	0,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-0,37%	3,30%	7,52%	-1,86%	9,72%	16,21%	6,03%	0,14%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1,17%	6,89%	5,19%	-	-	-	6,60%	0,18%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	1,49%	12,90%	13,14%	-3,29%	2,91%	5,85%	5,74%	0,19%

CDI (Benchmark)	0,75%	1,49%	2,26%	3,81%	5,65%	8,15%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,00%	1,73%	3,10%	2,94%	3,80%	-	0,76%	0,02%

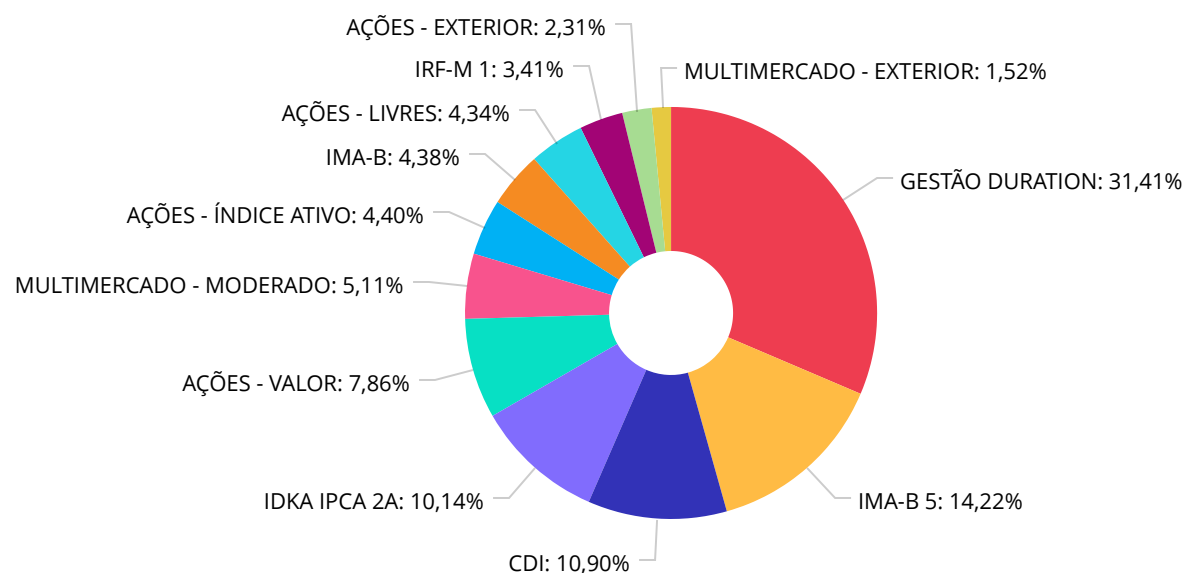
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-6,82%	-15,98%	-14,54%	-5,81%	1,83%	72,27%	-	-
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,75%	-15,69%	-13,16%	-4,48%	2,91%	70,50%	13,40%	0,19%

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



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



GESTÃO DURATION	11.464.574,71
IMA-B 5	5.191.110,91
CDI	3.977.452,34
IDKA IPCA 2A	3.700.317,70
AÇÕES - VALOR	2.869.985,48
MULTIMERCADO - MODERADO	1.863.925,55
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.606.910,47
IMA-B	1.598.329,35
AÇÕES - LIVRES	1.582.218,80
IRF-M 1	1.244.886,11
AÇÕES - EXTERIOR	841.396,67
MULTIMERCADO - EXTERIOR	552.933,86

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
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ ATENÇÃO! Meta de Rentabilidade de **2022** não está cadastrada !!!

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.658.006,16	0,00	0,00	3.700.317,70	42.311,54	1,16%	1,16%	1,13%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.669.414,86	0,00	0,00	4.718.647,37	49.232,51	1,05%	1,05%	1,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	467.590,39	0,00	0,00	472.463,54	4.873,15	1,04%	1,04%	1,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	591.949,07	0,00	0,00	597.729,80	5.780,73	0,98%	0,98%	0,36%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	454.577,34	0,00	0,00	458.300,66	3.723,32	0,82%	0,82%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.996.614,16	0,00	0,00	3.020.759,21	24.145,05	0,81%	0,81%	0,35%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	2.898.777,08	0,00	0,00	2.921.421,88	22.644,80	0,78%	0,78%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.235.776,41	0,00	0,00	1.244.886,11	9.109,70	0,74%	0,74%	0,32%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.541.238,06	0,00	0,00	1.551.576,65	10.338,59	0,67%	0,67%	0,61%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.846.438,35	0,00	0,00	6.892.238,85	45.800,50	0,67%	0,67%	0,60%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	1.590.181,46	0,00	0,00	1.598.329,35	8.147,89	0,51%	0,51%	1,77%
Total Renda Fixa	26.950.563,34	0,00	0,00	27.176.671,12	226.107,78	0,84%		0,71%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	825.595,98	0,00	0,00	837.925,64	12.329,66	1,49%	1,49%	5,74%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	760.081,50	0,00	0,00	768.984,83	8.903,33	1,17%	1,17%	6,60%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.845.536,91	0,00	0,00	1.863.925,55	18.388,64	1,00%	1,00%	0,76%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.573.446,72	0,00	0,00	1.582.218,80	8.772,08	0,56%	0,56%	5,92%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.880.540,09	0,00	0,00	2.869.985,48	-10.554,61	-0,37%	-0,37%	6,03%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	565.277,83	0,00	0,00	552.933,86	-12.343,97	-2,18%	-2,18%	10,43%
Total Renda Variável	8.450.479,03	0,00	0,00	8.475.974,16	25.495,13	0,30%		5,16%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG FI AÇÕES BDR NÍVEL I	892.742,83	0,00	0,00	841.396,67	-51.346,16	-5,75%	-5,75%	13,40%
Total Exterior	892.742,83	0,00	0,00	841.396,67	-51.346,16	-5,75%		13,40%

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.