

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.493.983,09	5,16%	1.034	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.394.622,16	10,91%	921	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.255.907,27	6,28%	1.062	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.940.425,94	7,29%	1.024	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.617.530,90	3,86%	815	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	47.509,67	0,07%	179	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.363.925,75	3,49%	1.220	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	5.605.666,25	8,27%	247	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	2.267.681,02	3,35%	79	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.740.635,61	4,04%	41	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	2.506.468,37	3,70%	568	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.516.375,23	2,24%	188	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	390.736,38	0,58%	135	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.177.822,59	6,16%	161	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.319.731,54	6,37%	565	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	231.847,69	0,34%	90	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FI AÇÕES	D+4	Não há	120.712,50	0,18%	20.144	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.816.100,45	4,16%	1.789	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	199.414,85	0,29%	154	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	63.904,50	0,09%	101	0,01%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

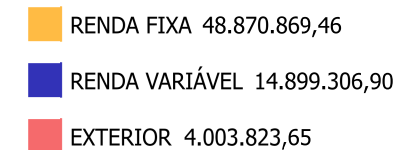
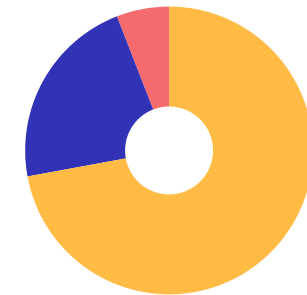
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	349.036,22	0,52%	103	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	122.027,92	0,18%	9.047	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	235.807,30	0,35%	8.980	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ...	D+33	Não há	305.489,98	0,45%	176	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	475.445,76	0,70%	131	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	175.461,55	0,26%	4.466	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	464.200,59	0,68%	9.187	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	D+4	Não há	467.488,98	0,69%	18.766	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	543.093,83	0,80%	30.782	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.856.072,28	2,74%	103	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	532.920,67	0,79%	85	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	696.182,68	1,03%	19.765	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.140.396,77	1,68%	216	0,37%	Artigo 8º, Inciso I
BRASESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	866.963,85	1,28%	72	0,73%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.136.859,80	4,63%	528	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	454.552,26	0,67%	11.452	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.467.138,54	2,16%	133	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.667.134,94	2,46%	10.668	0,14%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	152.048,75	0,22%	25	0,32%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	594.675,58	0,88%	1.118	0,03%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			67.774.000,01				

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

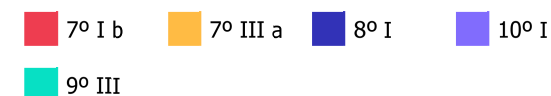
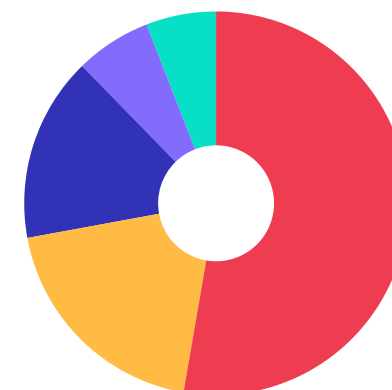
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	19,81%	61,61%	41.755.561,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	35.727.887,66	52,72%	15,23%	20,81%	100,00%	32.046.112,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	60,00%	13.142.981,80	19,39%	13,04%	17,39%	50,00%	20.744.018,21
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,39%	20,00%	13.554.800,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,11%	5,00%	3.388.700,00
Total Renda Fixa	100,00%	48.870.869,46	72,11%	28,27%	78,51%	236,61%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10.563.756,83	15,59%	9,52%	13,38%	20,00%	2.991.043,17
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	4.335.550,07	6,40%	2,34%	3,11%	10,00%	2.441.849,93
Total Renda Variável	30,00%	14.899.306,90	21,98%	11,86%	16,49%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	4.003.823,65	5,91%	2,00%	5,00%	10,00%	2.773.576,35
Total Exterior	10,00%	4.003.823,65	5,91%	2,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	42.908.275,84	63,31	-
ITAÚ UNIBANCO	15.220.824,36	22,46	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.121.163,96	9,03	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.383.339,08	3,52	0,00
META ASSET MANAGEMENT	1.140.396,77	1,68	0,37

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)

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	61,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	35.727.887,66	52,72	15,23	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	13.142.981,80	19,39	13,04	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	10.563.756,83	15,59	9,52	20,00
Artigo 9º, Inciso III	4.003.823,65	5,91	2,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	4.335.550,07	6,40	2,34	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	2,54%	3,88%	3,88%	5,80%	9,10%	18,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,62%	3,82%	3,82%	5,75%	8,64%	18,02%	1,43%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,63%	3,82%	3,82%	5,71%	8,69%	17,87%	1,46%	0,04%
IMA Geral (Benchmark)	1,57%	2,54%	2,54%	3,91%	4,91%	10,14%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,56%	2,32%	2,32%	3,69%	4,43%	8,78%	1,34%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,05%	2,83%	2,83%	3,86%	4,28%	14,73%	2,66%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,89%	2,28%	2,28%	3,43%	5,14%	7,77%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	2,22%	2,22%	3,33%	4,92%	7,31%	0,33%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,61%	3,81%	3,81%	5,92%	8,72%	17,96%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,59%	3,76%	3,76%	5,80%	8,48%	17,37%	1,34%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	2,59%	3,77%	3,77%	5,83%	8,51%	17,41%	1,33%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	3,07%	2,87%	2,87%	3,96%	4,50%	15,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,06%	2,82%	2,82%	3,85%	4,23%	14,81%	2,68%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,93%	2,67%	2,67%	4,59%	6,92%	9,20%	0,03%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	2,57%	2,57%	4,53%	6,56%	8,53%	0,03%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1,15%	2,48%	2,48%	4,35%	8,89%	12,01%	0,57%	0,02%
IPCA (Benchmark)	1,62%	3,20%	3,20%	6,25%	11,30%	18,09%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,36%	2,23%	2,23%	3,66%	4,59%	9,58%	0,92%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,42%	2,35%	2,35%	3,90%	4,34%	8,37%	0,99%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,82%	2,57%	2,57%	4,13%	3,40%	-	0,07%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,82%	2,32%	2,32%	3,41%	2,39%	7,61%	0,34%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,16%	2,64%	2,64%	4,85%	6,92%	9,12%	0,19%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	3,32%	-4,95%	-4,95%	5,17%	14,03%	75,29%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	4,58%	-3,11%	-3,11%	9,51%	20,44%	84,11%	10,49%	0,14%
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,01%	-19,27%	-19,27%	-8,75%	-4,63%	55,65%	10,90%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	0,19%
IBX-50 (Benchmark)	5,43%	15,47%	15,47%	10,28%	4,13%	71,54%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	5,61%	15,18%	15,18%	8,76%	2,95%	66,89%	9,98%	0,18%
IDIV (Benchmark)	10,00%	15,48%	15,48%	13,37%	11,66%	55,59%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7,07%	15,68%	15,68%	11,65%	6,45%	54,59%	9,88%	0,16%
IBX (Benchmark)	5,96%	14,89%	14,89%	8,55%	2,79%	66,70%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	7,44%	15,42%	15,42%	10,76%	-7,79%	56,35%	12,84%	0,21%
Ibovespa (Benchmark)	6,06%	14,48%	14,48%	8,13%	2,89%	64,34%	-	-
BB FI AÇÕES	1,47%	23,35%	23,35%	24,95%	21,81%	36,68%	14,27%	0,27%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,11%	9,65%	9,65%	-1,69%	-5,16%	46,39%	11,20%	0,18%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	6,67%	7,76%	7,76%	6,56%	9,88%	76,28%	9,48%	0,18%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	5,99%	14,29%	14,29%	7,90%	2,57%	62,84%	9,77%	0,16%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	5,49%	8,08%	8,08%	3,48%	-19,77%	0,31%	20,74%	0,26%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	5,54%	4,83%	4,83%	-12,66%	-19,70%	19,01%	15,01%	0,18%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	5,79%	16,94%	16,94%	9,73%	1,88%	55,05%	9,45%	0,18%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	8,08%	12,77%	12,77%	8,15%	7,33%	63,80%	12,58%	0,16%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	7,63%	26,93%	26,93%	29,14%	12,62%	168,32%	22,43%	0,31%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,54%	5,66%	5,66%	-2,78%	-4,38%	51,19%	11,29%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,02%	11,09%	11,09%	-4,34%	-4,31%	35,59%	11,67%	0,20%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	4,95%	12,19%	12,19%	-	-	-	10,99%	0,19%

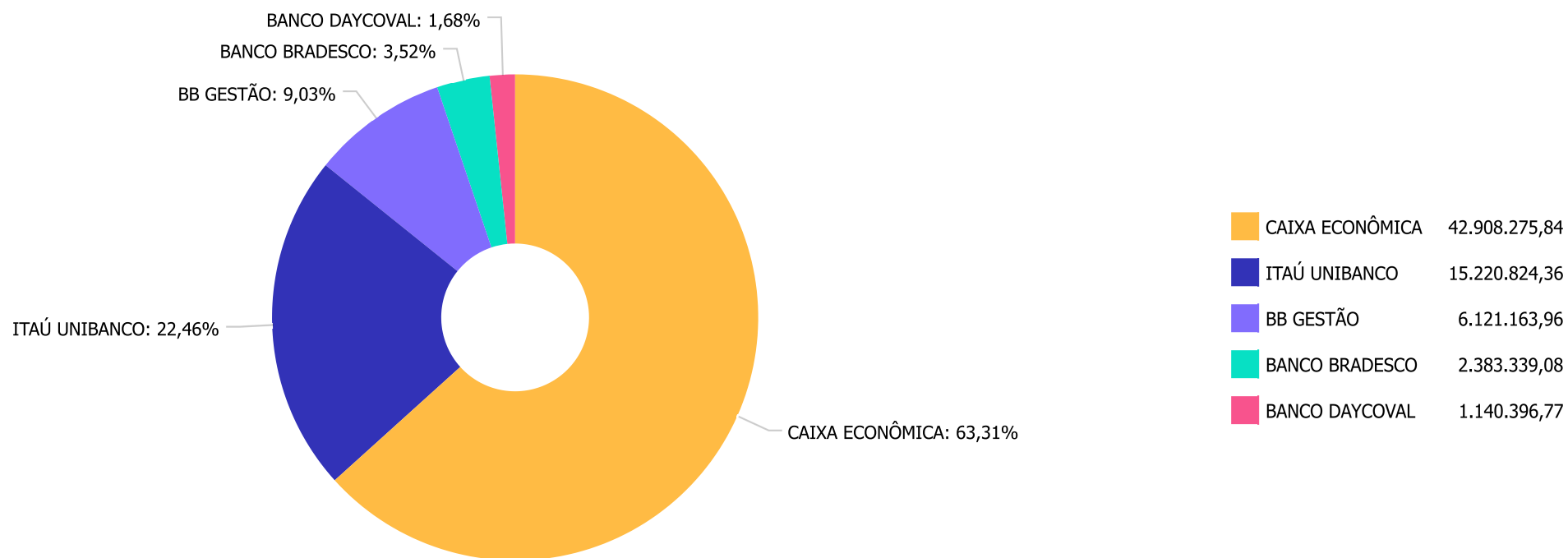
SMLL (Benchmark)	8,81%	6,69%	6,69%	-5,35%	-9,80%	48,46%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	8,57%	7,01%	7,01%	-5,42%	-10,49%	43,86%	14,90%	0,22%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	7,11%	7,84%	7,84%	-2,95%	-4,41%	56,11%	12,11%	0,19%

CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,91%	4,07%	4,07%	4,95%	4,83%	16,39%	1,52%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,19%	4,61%	4,61%	5,56%	5,60%	22,32%	1,85%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,67%	6,43%	6,43%	6,32%	5,71%	21,42%	2,89%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1,15%	2,83%	2,83%	4,71%	7,03%	9,55%	0,12%	0,01%

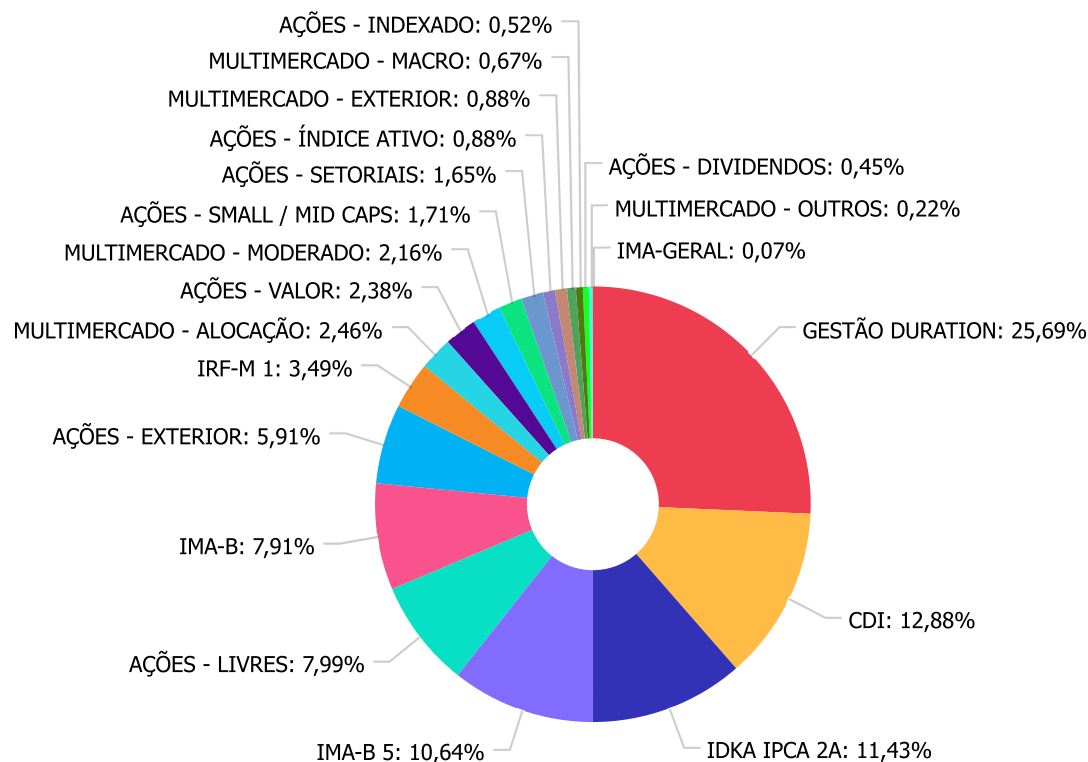
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-3,98%	-19,32%	-19,32%	-9,41%	-5,15%	56,83%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,01%	-19,27%	-19,27%	-8,75%	-4,63%	55,65%	10,90%	0,19%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,11%	-19,62%	-19,62%	-10,12%	-7,40%	52,03%	12,22%	0,19%

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



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

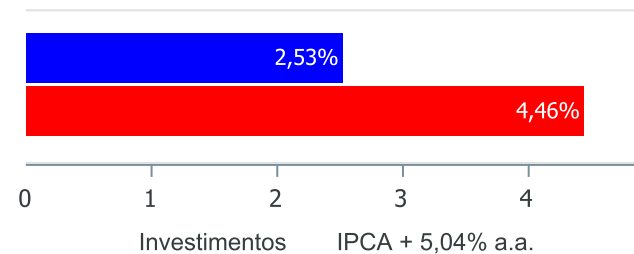


GESTÃO DURATION	17.413.868,39
CDI	8.729.401,82
IDKA IPCA 2A	7.749.890,36
IMA-B 5	7.208.106,96
AÇÕES - LIVRES	5.414.681,41
IMA-B	5.358.166,51
AÇÕES - EXTERIOR	4.003.823,65
IRF-M 1	2.363.925,75
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	1.667.134,94
AÇÕES - VALOR	1.615.842,53
MULTIMERCADO - MODERADO	1.467.138,54
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.160.383,27
AÇÕES - SETORIAIS	1.121.498,25
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	596.825,17
MULTIMERCADO - EXTERIOR	594.675,58
MULTIMERCADO - MACRO	454.552,26
AÇÕES - INDEXADO	349.036,22
AÇÕES - DIVIDENDOS	305.489,98
MULTIMERCADO - OUTROS	152.048,75

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	67.593.907,73	1.964.097,74	1.841.025,49	67.966.852,67	249.872,69	249.872,69	0,37%	0,37%	0,95%	0,95%	38,73%	3,09%
Fevereiro	67.966.852,67	738.482,81	2.740.000,00	66.039.692,72	74.357,24	324.229,93	0,11%	0,48%	1,39%	2,35%	20,36%	2,63%
Março	66.039.692,72	906.247,18	530.000,00	67.774.000,01	1.358.060,11	1.682.290,04	2,04%	2,53%	2,06%	4,46%	56,84%	3,47%

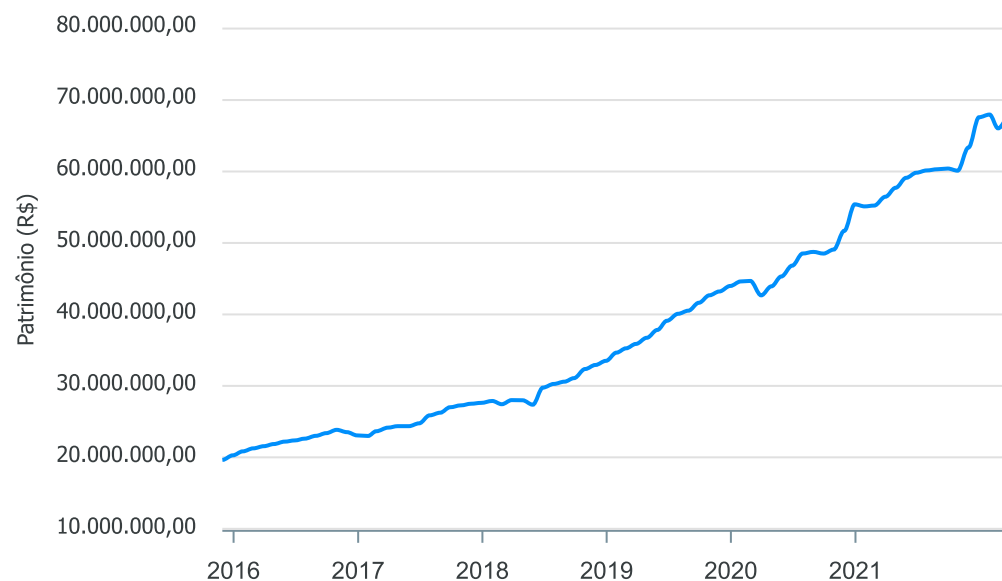
Investimentos x Meta de Rentabilidade



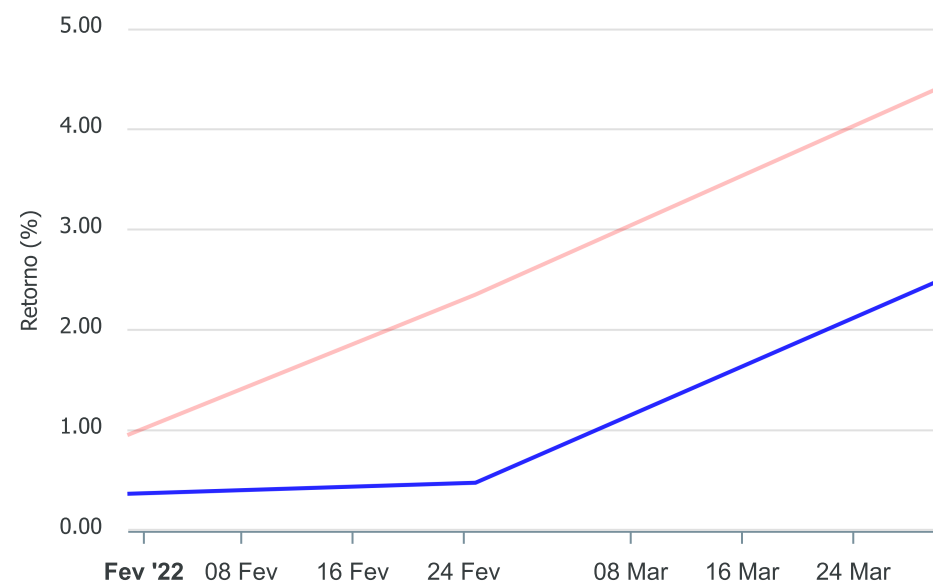
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.539.735,56	0,00	0,00	2.617.530,90	77.795,34	3,06%	3,06%	2,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.367.720,76	300.588,00	0,00	2.740.635,61	72.326,85	2,71%	3,05%	2,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.146.988,04	0,00	0,00	4.255.907,27	108.919,23	2,63%	2,63%	1,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.433.496,38	1.060,68	30.000,00	3.493.983,09	89.426,03	2,60%	2,62%	1,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	2.210.446,11	0,00	0,00	2.267.681,02	57.234,91	2,59%	2,59%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.787.574,13	29.084,03	0,00	4.940.425,94	123.767,78	2,57%	2,59%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	46.781,93	0,00	0,00	47.509,67	727,74	1,56%	1,56%	1,34%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.495.094,83	0,00	0,00	1.516.375,23	21.280,40	1,42%	1,42%	0,99%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.369.501,79	104.736,72	0,00	2.506.468,37	32.229,86	1,30%	1,36%	0,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.541.207,98	0,00	0,00	5.605.666,25	64.458,27	1,16%	1,16%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	229.207,32	0,00	0,00	231.847,69	2.640,37	1,15%	1,15%	0,57%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.282.007,31	0,00	0,00	4.319.731,54	37.724,23	0,88%	0,88%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.343.634,93	0,00	0,00	2.363.925,75	20.290,82	0,87%	0,87%	0,33%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.168.090,62	470.777,75	500.000,00	4.177.822,59	38.954,22	0,84%	0,93%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.334.174,77	0,00	0,00	7.394.622,16	60.447,39	0,82%	0,82%	0,34%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	387.577,92	0,00	0,00	390.736,38	3.158,46	0,81%	0,81%	0,07%
Total Renda Fixa	47.683.240,38	906.247,18	530.000,00	48.870.869,46	811.381,90	1,69%		0,90%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	427.574,38	0,00	0,00	464.200,59	36.626,21	8,57%	8,57%	14,90%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	162.346,42	0,00	0,00	175.461,55	13.115,13	8,08%	8,08%	12,58%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	434.349,10	0,00	0,00	467.488,98	33.139,88	7,63%	7,63%	22,43%
META VALOR FI AÇÕES	1.061.408,53	0,00	0,00	1.140.396,77	78.988,24	7,44%	7,44%	12,84%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	649.997,89	0,00	0,00	696.182,68	46.184,79	7,11%	7,11%	12,11%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	285.316,96	0,00	0,00	305.489,98	20.173,02	7,07%	7,07%	9,88%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	186.940,09	0,00	0,00	199.414,85	12.474,76	6,67%	6,67%	9,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.750.619,51	0,00	0,00	1.856.072,28	105.452,77	6,02%	6,02%	11,67%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	329.307,14	0,00	0,00	349.036,22	19.729,08	5,99%	5,99%	9,77%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	449.411,02	0,00	0,00	475.445,76	26.034,74	5,79%	5,79%	9,45%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	60.509,61	0,00	0,00	63.904,50	3.394,89	5,61%	5,61%	9,98%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	514.574,47	0,00	0,00	543.093,83	28.519,36	5,54%	5,54%	11,29%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	223.425,91	0,00	0,00	235.807,30	12.381,39	5,54%	5,54%	15,01%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	115.680,11	0,00	0,00	122.027,92	6.347,81	5,49%	5,49%	20,74%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.679.234,33	0,00	0,00	2.816.100,45	136.866,12	5,11%	5,73%	11,20%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	507.773,87	0,00	0,00	532.920,67	25.146,80	4,95%	4,95%	10,99%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	568.623,36	0,00	0,00	594.675,58	26.052,22	4,58%	4,58%	10,49%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.623.758,42	0,00	0,00	1.667.134,94	43.376,52	2,67%	2,67%	2,89%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.435.758,20	0,00	0,00	1.467.138,54	31.380,34	2,19%	2,19%	1,85%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	446.045,38	0,00	0,00	454.552,26	8.506,88	1,91%	1,91%	1,52%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI AÇÕES	118.965,22	0,00	0,00	120.712,50	1.747,28	1,47%	1,47%	14,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	150.314,82	0,00	0,00	152.048,75	1.733,93	1,15%	1,15%	0,12%
Total Renda Variável	14.181.934,74	0,00	0,00	14.899.306,90	717.372,16	5,06%		9,64%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	903.145,76	0,00	0,00	866.963,85	-36.181,91	-4,01%	-4,01%	10,90%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.271.371,84	0,00	0,00	3.136.859,80	-134.512,04	-4,11%	-4,11%	12,22%
Total Exterior	4.174.517,60	0,00	0,00	4.003.823,65	-170.693,95	-4,09%		11,94%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.676.713,91	1.208.879,05	1.121.626,96	4.940.425,94	176.459,94	3,00%	3,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.227.302,48	0,00	0,00	7.394.622,16	167.319,68	2,32%	2,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.099.220,66	0,00	0,00	4.255.907,27	156.686,61	3,82%	3,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.377.236,41	84.635,30	0,00	5.605.666,25	143.794,54	2,63%	2,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.473.224,77	201.708,01	308.998,53	3.493.983,09	128.048,84	3,48%	3,82%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.097.354,51	470.777,75	500.000,00	4.177.822,59	109.690,33	2,40%	2,67%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.930.346,35	300.000,00	15.400,00	4.319.731,54	104.785,19	2,48%	2,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	3.471.820,47	0,00	1.300.000,00	2.267.681,02	95.860,55	2,76%	3,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.214.193,11	330.000,00	0,00	2.617.530,90	73.337,79	2,88%	2,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.372.887,75	300.588,00	0,00	2.740.635,61	67.159,86	2,51%	2,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.554.268,86	562.239,62	665.000,00	2.506.468,37	54.959,89	1,76%	2,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.312.686,38	0,00	0,00	2.363.925,75	51.239,37	2,22%	2,22%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.481.610,70	0,00	0,00	1.516.375,23	34.764,53	2,35%	2,35%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	380.939,61	0,00	0,00	390.736,38	9.796,77	2,57%	2,57%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.422.259,27	0,00	1.200.000,00	231.847,69	9.588,42	0,67%	2,48%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	46.431,13	0,00	0,00	47.509,67	1.078,54	2,32%	2,32%
Total Renda Fixa					1.384.570,85	2,63%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.568.363,55	0,00	0,00	2.816.100,45	247.736,90	9,65%	9,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.670.852,94	0,00	0,00	1.856.072,28	185.219,34	11,09%	11,09%
META VALOR FI AÇÕES	988.014,29	0,00	0,00	1.140.396,77	152.382,48	15,42%	15,42%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.566.451,79	0,00	0,00	1.667.134,94	100.683,15	6,43%	6,43%
CAIXA VALE DO RIO DOCE FI AÇÕES	368.299,50	0,00	0,00	467.488,98	99.189,48	26,93%	26,93%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	406.578,80	0,00	0,00	475.445,76	68.866,96	16,94%	16,94%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.402.508,64	0,00	0,00	1.467.138,54	64.629,90	4,61%	4,61%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	485.537,25	150.000,00	0,00	696.182,68	60.645,43	9,54%	7,84%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	475.037,11	0,00	0,00	532.920,67	57.883,56	12,19%	12,19%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	305.389,24	0,00	0,00	349.036,22	43.646,98	14,29%	14,29%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	264.073,92	0,00	0,00	305.489,98	41.416,06	15,68%	15,68%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	433.780,89	0,00	0,00	464.200,59	30.419,70	7,01%	7,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	513.989,10	0,00	0,00	543.093,83	29.104,73	5,66%	5,66%
BB FI AÇÕES	97.861,65	0,00	0,00	120.712,50	22.850,85	23,35%	23,35%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	155.586,49	0,00	0,00	175.461,55	19.875,06	12,77%	12,77%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	436.772,85	0,00	0,00	454.552,26	17.779,41	4,07%	4,07%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	185.060,16	0,00	0,00	199.414,85	14.354,69	7,76%	7,76%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	224.935,48	0,00	0,00	235.807,30	10.871,82	4,83%	4,83%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	112.907,94	0,00	0,00	122.027,92	9.119,98	8,08%	8,08%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	55.483,48	0,00	0,00	63.904,50	8.421,02	15,18%	15,18%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	147.865,06	0,00	0,00	152.048,75	4.183,69	2,83%	2,83%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	613.766,02	0,00	0,00	594.675,58	-19.090,44	-3,11%	-3,11%
Total Renda Variável					1.270.190,75	9,32%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.073.942,04	0,00	0,00	866.963,85	-206.978,19	-19,27%	-19,27%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3.902.353,17	0,00	0,00	3.136.859,80	-765.493,37	-19,62%	-19,62%
Total Exterior					-972.471,56	-19,54%	

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.