

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
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 JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.617.234,28	2,79%	171.578	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.203.686,22	1,28%	135	0,12%	Artigo 10º, Inciso I
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.679.539,37	1,79%	536	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.871.072,49	6,27%	1.027	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	8.930.772,03	9,53%	789	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	449.756,02	0,48%	624	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.074.086,42	7,55%	1.120	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	125.537,00	0,13%	310	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	16.016.777,48	17,10%	931	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	9.635.839,09	10,28%	1.058	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.198.281,25	5,55%	1.018	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.587.593,77	2,76%	829	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.954.696,06	2,09%	581	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.695.007,23	1,81%	822	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	332,56	0,00%	895	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.477.619,42	3,71%	192	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.918.350,51	2,05%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.428.507,66	1,52%	247	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.181.764,58	1,26%	6.729	0,29%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.181.764,58	1,26%	6.729	0,29%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.271.129,12	2,42%	5.169	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.271.129,12	2,42%	5.169	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	1.667.433,04	1,78%	34	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	1.667.433,04	1,78%	34	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	1.537.903,23	1,64%	43.456	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.278.754,71	1,36%	2.052	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.407.191,50	1,50%	161	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	2.032.795,61	2,17%	104	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.374.514,79	1,47%	48	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.083.608,99	1,16%	105	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	2.869.213,27	3,06%	40.740	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		62.558,58	0,07%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			93.689.324,44				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			62.558,58				Artigo 6º
PL Total			93.751.883,02				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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 (RENDA 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)

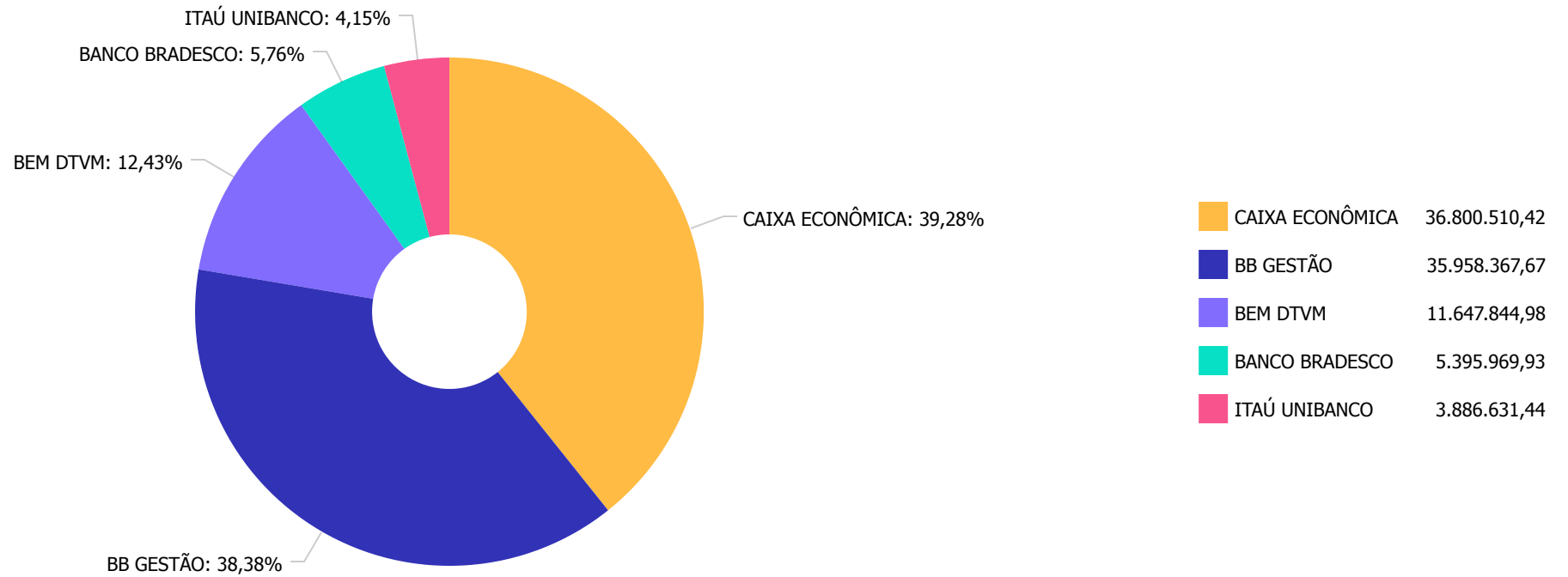
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	36.800.510,42	39,28	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.958.367,67	38,38	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	10.240.653,48	10,93	0,03
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.803.161,43	7,26	0,00
ITAÚ UNIBANCO	2.512.116,65	2,68	0,00
ITAÚ DTVM	1.374.514,79	1,47	0,00

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)

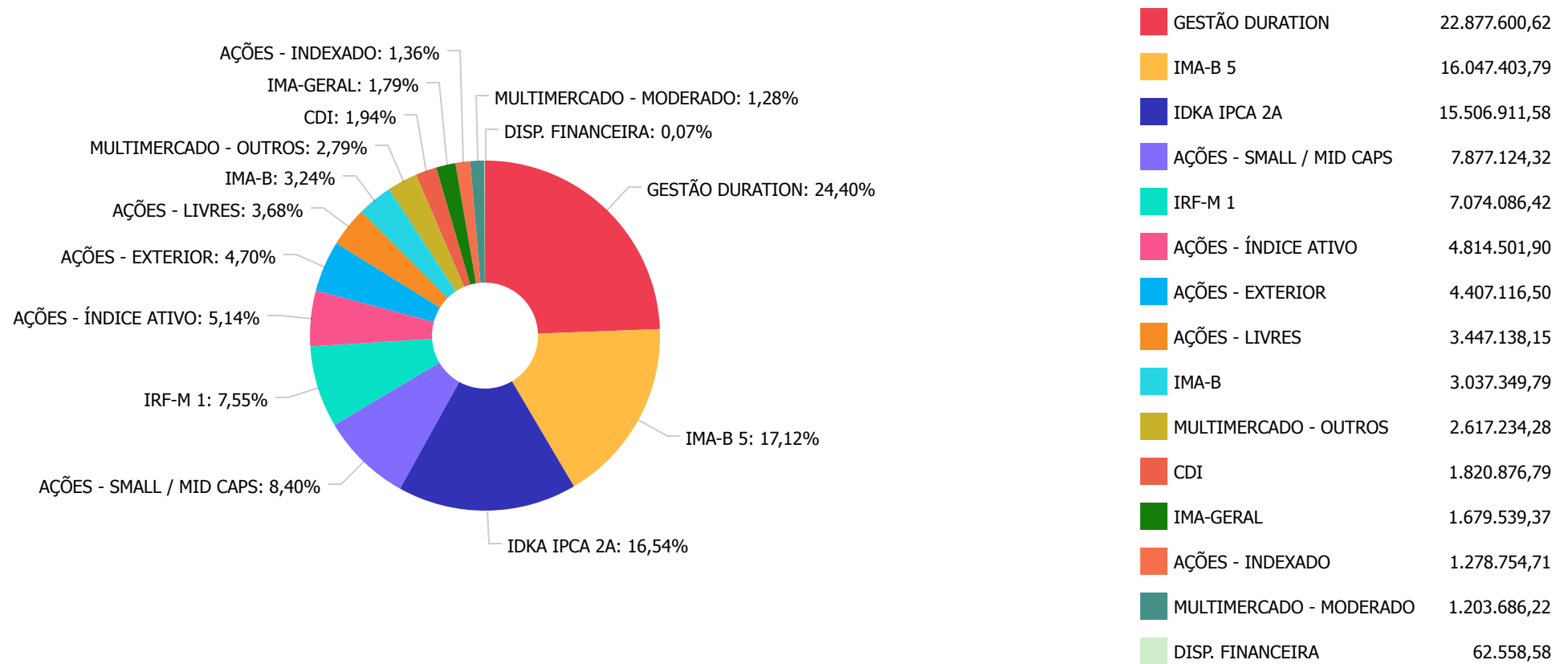
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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



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



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...	5.803.939,31	0,00	0,00	5.871.072,49	67.133,18	1,16%	1,16%	1,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.332.215,59	195.447,51	0,00	9.635.839,09	108.175,99	1,14%	1,15%	1,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.837.591,88	0,00	0,00	8.930.772,03	93.180,15	1,05%	1,05%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.144.219,38	0,00	0,00	5.198.281,25	54.061,87	1,05%	1,05%	1,06%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1.898.563,99	0,00	0,00	1.918.350,51	19.786,52	1,04%	1,04%	1,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.415.365,56	0,00	0,00	1.428.507,66	13.142,10	0,93%	0,93%	0,45%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.888.754,78	0,00	0,00	16.016.777,48	128.022,70	0,81%	0,81%	0,35%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	329,92	0,00	0,00	332,56	2,64	0,80%	0,80%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	7.022.320,35	0,00	0,00	7.074.086,42	51.766,07	0,74%	0,74%	0,32%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.454.447,07	0,00	0,00	3.477.619,42	23.172,35	0,67%	0,67%	0,61%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.941.706,66	0,00	0,00	1.954.696,06	12.989,40	0,67%	0,67%	0,60%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	120.843,54	3.908,45	0,00	125.537,00	785,01	0,63%	0,63%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.669.256,55	0,00	0,00	1.679.539,37	10.282,82	0,62%	0,62%	0,87%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.531.379,20	743.374,60	591.972,82	1.695.007,23	12.226,25	0,54%	0,68%	0,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	447.368,98	0,00	0,00	449.756,02	2.387,04	0,53%	0,53%	1,77%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.574.027,63	0,00	0,00	2.587.593,77	13.566,14	0,53%	0,53%	1,78%
Total Renda Fixa	67.082.330,39	942.730,56	591.972,82	68.043.768,36	610.680,23	0,91%		0,79%

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
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	2.011.100,13	0,00	0,00	2.032.795,61	21.695,48	1,08%	1,08%	6,75%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.361.425,08	0,00	0,00	1.374.514,79	13.089,71	0,96%	0,96%	6,02%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.192.602,26	0,00	0,00	1.203.686,22	11.083,96	0,93%	0,93%	1,56%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.268.582,07	0,00	0,00	1.278.754,71	10.172,64	0,80%	0,80%	6,02%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.598.696,75	0,00	0,00	2.617.234,28	18.537,53	0,71%	0,71%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.087.591,22	0,00	0,00	1.083.608,99	-3.982,23	-0,37%	-0,37%	7,05%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.193.270,82	0,00	0,00	1.181.764,58	-11.506,24	-0,96%	-0,96%	5,38%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.193.270,82	0,00	0,00	1.181.764,58	-11.506,24	-0,96%	-0,96%	5,38%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.689.595,00	0,00	0,00	1.667.433,04	-22.161,96	-1,31%	-1,31%	5,83%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.689.595,00	0,00	0,00	1.667.433,04	-22.161,96	-1,31%	-1,31%	5,83%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.305.094,02	0,00	0,00	2.271.129,12	-33.964,90	-1,47%	-1,47%	6,78%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.305.094,02	0,00	0,00	2.271.129,12	-33.964,90	-1,47%	-1,47%	6,78%
BRASESCO SELECTION FI AÇÕES	1.435.105,46	0,00	0,00	1.407.191,50	-27.913,96	-1,95%	-1,95%	6,08%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	1.578.348,19	0,00	0,00	1.537.903,23	-40.444,96	-2,56%	-2,56%	10,39%
Total Renda Variável	22.909.370,84	0,00	0,00	22.776.342,81	-133.028,03	-0,58%		5,57%

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 BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	2.929.521,94	0,00	0,00	2.869.213,27	-60.308,67	-2,06%	-2,06%	11,50%
Total Exterior	2.929.521,94	0,00	0,00	2.869.213,27	-60.308,67	-2,06%		11,50%

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.