

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2022

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	11.903.992,39	12,14%	706	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	4.669.616,48	4,76%	356	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	19.993.097,98	20,39%	320	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	7.927.824,45	8,09%	287	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.236.114,44	4,32%	810	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	352.271,36	0,36%	297	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.754.318,93	5,87%	10.964	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.447.554,71	4,54%	895	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	95.778,38	0,10%	16.265	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.761.461,77	4,86%	233	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	12.365.786,26	12,61%	980	0,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	6.886.119,10	7,02%	26.076	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.312.039,37	1,34%	1.739	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.828.744,89	1,87%	25.252	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.061.842,06	1,08%	11.935	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	760.790,55	0,78%	653	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	332.278,13	0,34%	1.302	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	D+3 du	Não há	186.583,58	0,19%	14.062	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	249.634,02	0,25%	2.914	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.208.201,91	3,27%	13.917	0,48%	Artigo 9º, Inciso III



CRÉDITO
& MERCADO

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 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	5.694.988,17	5,81%	99	4,58%	Artigo 10º, Inciso I		
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	10.191,25	0,01%	186	0,00%	Artigo 10º, Inciso I		
Total para cálculo dos limites da Resolução			98.039.230,18						



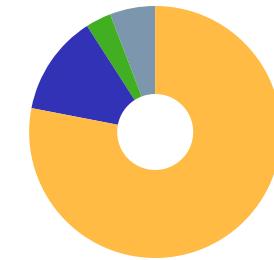
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 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%	18,41%	59,24%	58.078.439,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	54.837.236,03	55,93%	13,81%	18,41%	100,00%	43.201.994,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	21.670.581,12	22,10%	12,62%	16,83%	50,00%	27.349.033,97
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	16,83%	20,00%	19.607.846,04
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,79%	5,00%	4.901.961,51
Total Renda Fixa	100,00%	76.507.817,15	78,04%	26,43%	73,27%	234,24%	



- █ RENDA FIXA 76.507.817,15
- █ RENDA VARIÁVEL 12.618.031,70
- █ EXTERIOR 3.208.201,91
- █ ESTRUTURADOS 5.705.179,42



**CRÉDITO
& MERCADO**

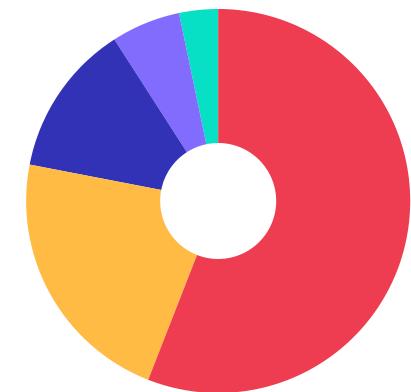
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	12.618.031,70	12,87%	0,00%	16,11%	20,00%	6.989.814,34
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,84%	20,00%	19.607.846,04
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.705.179,42	5,82%	2,09%	2,78%	10,00%	4.098.743,60
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	18.323.211,12	18,69%	2,09%	21,73%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.208.201,91	3,27%	0,00%	5,00%	10,00%	6.595.721,11
Total Exterior	10,00%	3.208.201,91	3,27%	0,00%	5,00%	10,00%	



■ 7º I b ■ 7º III a ■ 8º I ■ 10º I
■ 9º III



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	61.016.388,31	62,24	-
SICREDI	18.120.105,19	18,48	0,02
CAIXA DTVM	13.380.484,36	13,65	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	4.761.461,77	4,86	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	760.790,55	0,78	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'	54.837.236,03	55,93	13,81	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	9.304.794,86	9,49	12,62	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	12.618.031,70	12,87	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.208.201,91	3,27	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.705.179,42	5,82	2,09	10,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	1,48%	8,82%	1,74%	6,49%	8,82%	6,66%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	8,72%	1,76%	6,44%	8,72%	6,35%	1,73%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,89%	9,62%	2,54%	5,25%	9,62%	12,23%	0,00%	0,00%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	1,10%	12,27%	3,16%	6,56%	12,27%	17,10%	0,01%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	11,41%	3,98%	4,00%	11,41%	16,36%	0,60%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,03%	11,26%	2,95%	6,09%	11,26%	14,90%	0,00%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	-	2,71%	2,69%	-	-	0,99%	-
IPCA (Benchmark)	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14%	10,70%	2,23%	5,84%	10,70%	10,58%	0,37%	0,01%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,37%	7,83%	-0,53%	2,43%	7,83%	12,71%	1,53%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	9,30%	1,67%	4,80%	9,30%	9,89%	1,26%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	-	0,83%	0,84%	-	-	0,60%	-



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	-11,33%	-	-2,09%	-9,02%	-	-	12,91%	-
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	11,78%	2,78%	6,52%	11,78%	15,73%	0,56%	0,01%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,95%	10,93%	2,66%	5,54%	10,93%	12,48%	0,66%	0,01%
Ibovespa (Benchmark)	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,69%	5,71%	-2,56%	7,18%	5,71%	-2,92%	12,64%	0,24%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-3,65%	-1,79%	-4,24%	6,84%	-1,79%	-16,98%	10,34%	0,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,57%	-0,76%	-2,39%	7,00%	-0,76%	-6,97%	9,73%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,48%	-3,47%	-1,99%	5,53%	-3,47%	-8,07%	9,73%	0,19%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-7,51%	-26,51%	3,02%	0,69%	-26,51%	-1,18%	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-5,90%	-19,44%	7,08%	1,43%	-19,44%	2,22%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-4,58%	-13,32%	8,56%	5,47%	-13,32%	12,94%	8,14%	0,22%
SMALL (Benchmark)	-3,01%	-15,06%	-7,61%	5,76%	-15,06%	-28,82%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-2,62%	-8,25%	-5,64%	5,28%	-8,25%	-17,28%	13,45%	0,28%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-2,93%	-15,88%	-8,88%	4,16%	-15,88%	-32,57%	14,02%	0,30%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-7,51%	-26,51%	3,02%	0,69%	-26,51%	-1,18%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,87%	-25,89%	5,52%	2,03%	-25,89%	-2,06%	10,03%	0,20%

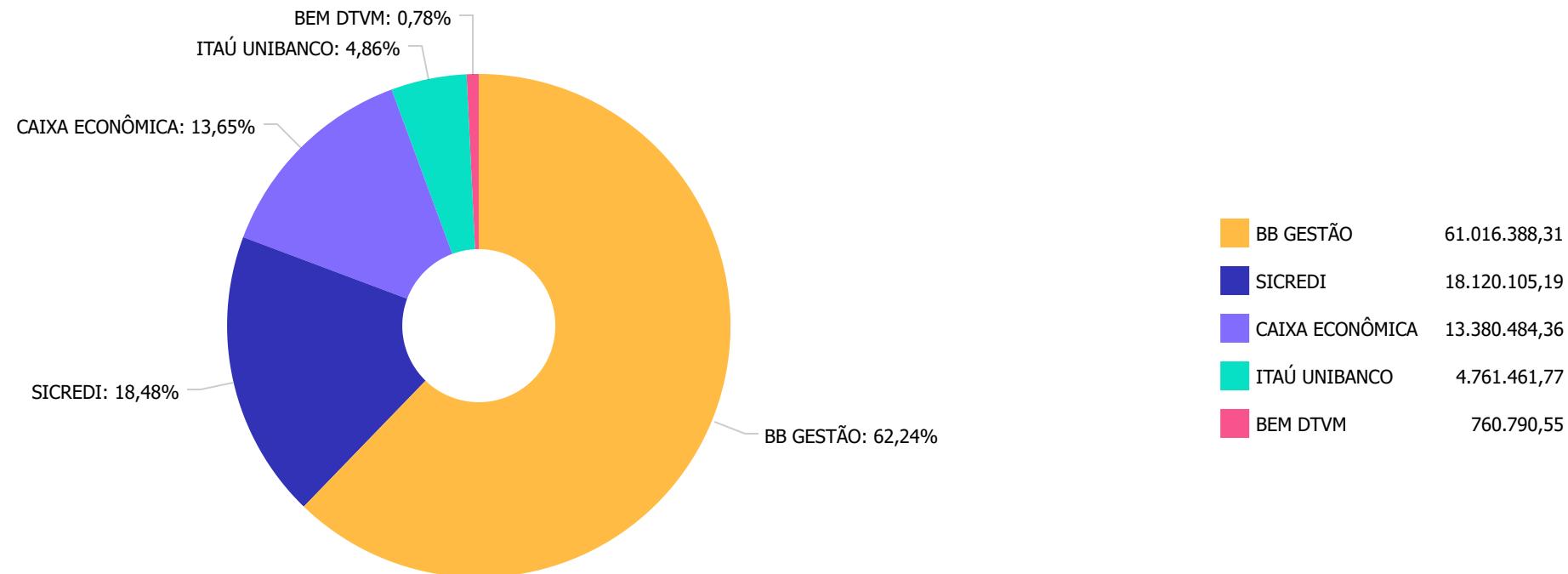


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022



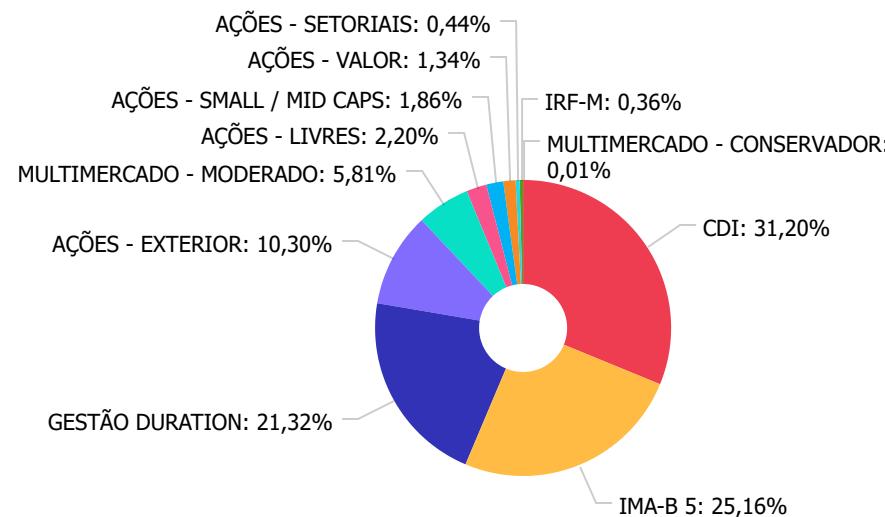


CRÉDITO
& MERCADO

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022



■ CDI	30.591.262,73	■ IMA-B 5	24.662.714,46	■ GESTÃO DURATION	20.901.568,60
■ AÇÕES - EXTERIOR	10.094.321,01	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.694.988,17	■ AÇÕES - LIVRES	2.161.023,02
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.822.632,61	■ AÇÕES - VALOR	1.312.039,37	■ AÇÕES - SETORIAIS	436.217,60
■ IRF-M	352.271,36	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	10.191,25		



**CRÉDITO
& MERCADO**

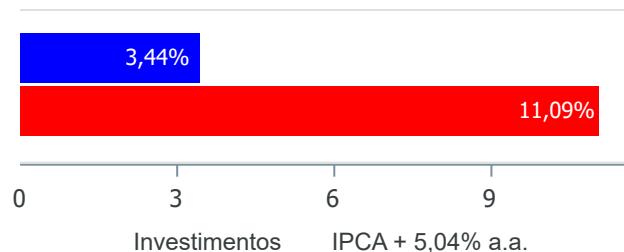
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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
Janeiro	85.552.823,02	2.390.023,42	3.876.712,66	83.633.208,53	-432.925,25	-432.925,25	-0,51%	-0,51%	0,95%	0,95%	-53,11%	3,43%
Fevereiro	83.633.208,53	5.472.725,52	4.923.698,75	84.095.637,06	-86.598,24	-519.523,49	-0,10%	-0,61%	1,39%	2,35%	-25,88%	3,11%
Março	84.095.637,06	3.542.424,26	2.889.784,60	86.617.773,21	1.869.496,49	1.349.973,00	2,21%	1,58%	2,06%	4,46%	35,54%	3,72%
Abril	86.617.773,21	2.208.180,40	1.591.525,10	86.678.063,63	-556.364,88	793.608,12	-0,64%	0,94%	1,44%	5,96%	15,72%	3,40%
Maio	86.678.063,63	6.075.734,39	3.046.659,83	89.548.810,97	-158.327,22	635.280,90	-0,18%	0,76%	0,90%	6,91%	10,97%	3,55%
Junho	89.548.810,97	36.056.844,98	38.965.012,15	84.988.820,62	-1.651.823,18	-1.016.542,28	-1,84%	-1,10%	1,08%	8,07%	-13,64%	3,52%
Julho	84.988.820,62	7.292.344,15	4.582.591,90	89.338.953,87	1.640.381,00	623.838,72	1,87%	0,75%	-0,27%	7,78%	9,64%	2,75%
Agosto	89.338.953,87	2.200.880,97	3.336.410,64	88.857.430,74	654.006,54	1.277.845,26	0,73%	1,49%	0,09%	7,87%	18,89%	3,05%
Setembro	88.857.430,74	16.854.630,33	14.682.918,91	90.751.247,42	-277.894,74	999.950,52	-0,31%	1,18%	0,12%	8,00%	14,71%	2,93%
Outubro	90.751.247,42	2.702.012,52	3.096.951,64	92.521.717,74	2.165.409,44	3.165.359,96	2,39%	3,59%	0,98%	9,06%	39,63%	3,46%
Novembro	92.521.717,74	4.439.623,58	3.077.076,60	93.872.375,51	-11.889,21	3.153.470,75	-0,01%	3,58%	0,80%	9,94%	36,01%	4,52%
Dezembro	93.872.375,51	14.530.063,53	10.231.040,94	98.039.230,18	-132.167,92	3.021.302,83	-0,13%	3,44%	1,05%	11,09%	30,99%	2,13%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO
& MERCADO

Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

ANO

36M

Evolução do Patrimônio



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



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	347.257,34	0,00	0,00	352.271,36	5.014,02	1,44%	1,44%	1,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.793.842,28	5.955.990,57	0,00	19.993.097,98	243.265,13	1,23%	1,32%	0,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.188.397,25	0,00	0,00	4.236.114,44	47.717,19	1,14%	1,14%	0,37%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	5.385.626,64	307.944,34	0,00	5.754.318,93	60.747,95	1,07%	1,10%	0,01%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	10.083.361,40	2.152.806,02	0,00	12.365.786,26	129.618,84	1,06%	1,10%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.625.445,00	0,00	0,00	4.669.616,48	44.171,48	0,95%	0,95%	0,60%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.853.112,75	0,00	0,00	7.927.824,45	74.711,70	0,95%	0,95%	0,60%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.813.327,12	0,00	0,00	11.903.992,39	90.665,27	0,77%	0,77%	1,26%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	30.574,69	64.682,34	0,00	95.778,38	521,35	0,55%	0,89%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.242.864,18	6.048.640,26	6.892.904,44	4.447.554,71	48.954,71	0,43%	1,03%	0,00%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.779.134,30	0,00	0,00	4.761.461,77	-17.672,53	-0,37%	-0,37%	1,53%
Total Renda Fixa	68.142.942,95	14.530.063,53	6.892.904,44	76.507.817,15	727.715,11	0,96%		0,68%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.345.345,96	0,00	0,00	1.312.039,37	-33.306,59	-2,48%	-2,48%	9,73%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.876.911,85	0,00	0,00	1.828.744,89	-48.166,96	-2,57%	-2,57%	9,73%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	781.216,74	0,00	0,00	760.790,55	-20.426,19	-2,61%	-2,61%	13,45%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.093.854,93	0,00	0,00	1.061.842,06	-32.012,87	-2,93%	-2,93%	14,02%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	344.869,16	0,00	0,00	332.278,13	-12.591,03	-3,65%	-3,65%	10,34%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.216.861,57	0,00	0,00	6.886.119,10	-330.742,47	-4,58%	-4,58%	8,14%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	261.920,54	0,00	0,00	249.634,02	-12.286,52	-4,69%	-4,69%	12,64%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	903.421,03	0,00	847.787,88	0,00	-55.633,15	-6,16%	-2,71%	9,33%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.670.622,23	0,00	2.490.348,62	0,00	-180.273,61	-6,75%	-2,62%	10,03%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	210.430,28	0,00	0,00	186.583,58	-23.846,70	-11,33%	-11,33%	12,91%
Total Renda Variável	16.705.454,29	0,00	3.338.136,50	12.618.031,70	-749.286,09	-4,49%		9,57%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.372.481,48	0,00	0,00	3.208.201,91	-164.279,57	-4,87%	-4,87%	10,03%
Total Exterior	3.372.481,48	0,00	0,00	3.208.201,91	-164.279,57	-4,87%		10,03%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	13.459.262,75	6.105.776,22	0,00	19.993.097,98	428.059,01	2,19%	2,71%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	8.569.891,70	3.491.200,38	0,00	12.365.786,26	304.694,18	2,53%	3,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	11.708.170,44	0,00	0,00	11.903.992,39	195.821,95	1,67%	1,67%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	8.424.308,34	8.612.305,90	12.782.038,46	4.447.554,71	192.978,93	1,13%	2,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.623.221,14	0,00	135.866,74	4.669.616,48	182.262,08	3,94%	3,98%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	2.494.029,67	3.108.426,31	0,00	5.754.318,93	151.862,95	2,71%	3,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.143.893,65	0,00	0,00	4.236.114,44	92.220,79	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.625.861,22	236.399,93	0,00	7.927.824,45	65.563,30	0,83%	0,83%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	346.179,07	0,00	0,00	352.271,36	6.092,29	1,76%	1,76%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	136.135,25	107.590,89	149.027,48	95.778,38	1.079,72	0,44%	2,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.786.795,42	0,00	0,00	4.761.461,77	-25.333,65	-0,53%	-0,53%
Total Renda Fixa	66.317.748,65	21.661.699,63	13.066.932,68	76.507.817,15	1.595.301,55	2,13%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	6.343.341,25	0,00	0,00	6.886.119,10	542.777,85	8,56%	8,56%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.547.291,17	0,00	0,00	5.694.988,17	147.697,00	2,66%	2,66%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	10.000,00	0,00	10.191,25	191,25	1,91%	2,77%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	190.558,78	0,00	0,00	186.583,58	-3.975,20	-2,09%	-2,09%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	256.180,48	0,00	0,00	249.634,02	-6.546,46	-2,56%	-2,56%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	346.981,61	0,00	0,00	332.278,13	-14.703,48	-4,24%	-4,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.338.658,58	0,00	0,00	1.312.039,37	-26.619,21	-1,99%	-1,99%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.873.479,45	0,00	0,00	1.828.744,89	-44.734,56	-2,39%	-2,39%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	806.300,27	0,00	0,00	760.790,55	-45.509,72	-5,64%	-5,64%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	895.057,79	0,00	847.787,88	0,00	-47.269,91	-5,28%	-1,81%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.165.352,09	0,00	0,00	1.061.842,06	-103.510,03	-8,88%	-8,88%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.630.000,57	0,00	2.490.348,62	0,00	-139.651,95	-5,31%	-1,12%
Total Renda Variável	21.393.202,04	10.000,00	3.338.136,50	18.323.211,12	258.145,58	1,21%	



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.040.296,73	0,00	0,00	3.208.201,91	167.905,18	5,52%	5,52%
Total Exterior	3.040.296,73	0,00	0,00	3.208.201,91	167.905,18	5,52%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	12.417.672,38	47.015.629,64	56.155.568,64	4.447.554,71	1.169.821,33	1,97%	11,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.316.107,91	2.674.389,93	0,00	11.903.992,39	913.494,55	8,31%	9,30%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	0,00	11.826.383,46	0,00	12.365.786,26	539.402,80	4,56%	12,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	19.942.954,82	418.062,96	19.993.097,98	468.206,12	2,35%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.826.677,00	0,00	0,00	4.236.114,44	409.437,44	10,70%	10,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.230.342,35	0,00	5.583.207,21	0,00	352.864,86	6,75%	9,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.893.835,58	1.359.758,92	7.593.448,28	0,00	339.853,78	4,69%	9,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.063.146,73	0,00	5.400.660,63	0,00	337.513,90	6,67%	9,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	4.552.290,14	195.087,28	4.669.616,48	312.413,62	6,86%	11,41%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.861.134,10	1.638.343,99	0,00	4.761.461,77	261.983,68	5,82%	7,83%
SICREDI TAXA SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00	5.602.455,98	0,00	5.754.318,93	151.862,95	2,71%	12,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.160.514,98	0,00	4.299.247,80	0,00	138.732,82	3,33%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.592.807,45	41.631,38	1.735.612,31	0,00	101.173,48	6,19%	9,67%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	7.829.848,21	0,00	7.927.824,45	97.976,24	1,25%	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.665.056,25	0,00	1.748.842,35	0,00	83.786,10	5,03%	12,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.768.238,97	0,00	1.837.896,80	0,00	69.657,83	3,94%	11,73%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	324.007,48	0,00	0,00	352.271,36	28.263,88	8,72%	8,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.345.571,23	0,00	1.359.758,92	0,00	14.187,69	1,05%	6,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	320.431,11	0,00	333.793,12	0,00	13.362,01	4,17%	11,74%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	616,21	1.086.801,58	998.048,38	95.778,38	6.408,97	0,59%	9,61%



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Renda Fixa	54.786.159,73	103.570.488,05	87.659.234,68	76.507.817,15	5.810.404,05	8,22%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.134.021,72	0,00	0,00	5.694.988,17	560.966,45	10,93%	10,93%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	236.153,51	0,00	0,00	249.634,02	13.480,51	5,71%	5,71%
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	185.000,00	0,00	186.583,58	1.583,58	0,86%	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	10.000,00	0,00	10.191,25	191,25	1,91%	11,78%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	847.926,77	0,00	847.787,88	0,00	-138,89	-0,02%	3,65%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	338.336,90	0,00	0,00	332.278,13	-6.058,77	-1,79%	-1,79%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.842.655,23	0,00	0,00	1.828.744,89	-13.910,34	-0,75%	-0,75%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.359.207,83	0,00	0,00	1.312.039,37	-47.168,46	-3,47%	-3,47%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.538.991,46	0,00	2.490.348,62	0,00	-48.642,84	-1,92%	2,43%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	829.204,93	0,00	0,00	760.790,55	-68.414,38	-8,25%	-8,25%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.262.215,22	0,00	0,00	1.061.842,06	-200.373,16	-15,87%	-15,87%
ITAIÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.848.603,17	0,00	1.638.343,99	0,00	-210.259,18	-11,37%	-9,36%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.944.694,48	0,00	0,00	6.886.119,10	-1.058.575,38	-13,32%	-13,32%
Total Renda Variável	24.182.011,22	195.000,00	4.976.480,49	18.323.211,12	-1.077.319,61	-4,42%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/12/2022

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO FUNDAMENTALISMO SUSTENTABILIDADE E GESTÃO DE RISCOS	2.255.461,29	0,00	1.664.668,55	0,00	-590.792,74	-26,19%	-24,14%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.329.190,78	0,00	0,00	3.208.201,91	-1.120.988,87	-25,89%	-25,89%
Total Exterior	6.584.652,07	0,00	1.664.668,55	3.208.201,91	-1.711.781,61	-26,00%	



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 1.467, de 02 de junho de 2022. 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.

