

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre 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 (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.243.949,98	4,90%	515	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.429.992,41	6,27%	1.034	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.252.501,67	6,06%	793	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.807.753,60	2,09%	1.110	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.057.886,42	2,38%	181	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	1.004.563,48	1,16%	126	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.915.268,62	4,52%	921	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.119.118,67	7,06%	1.062	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.695.507,70	1,96%	1.024	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	317.440,81	0,37%	1.220	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.355.372,53	1,56%	237	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	328.468,20	0,38%	294	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	8.501.869,09	9,82%	568	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.275.667,04	10,71%	831	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.707.414,73	1,97%	96	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	99.367,25	0,11%	16.467	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.936.551,70	3,39%	247	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	955.653,89	1,10%	799	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	7.668.375,79	8,85%	40.269	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.477.765,31	1,71%	2.389	0,12%	Artigo 8º, Inciso I



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.897.197,08	3,34%	1.997	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.054.566,27	2,37%	27.244	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.361.167,62	1,57%	14.932	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	926.911,06	1,07%	979	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	370.971,91	0,43%	1.789	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	266.320,43	0,31%	4.466	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.053.526,68	2,37%	103	0,25%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	1.745.936,33	2,02%	67	0,23%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.486.499,11	4,03%	20.585	0,36%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	5.304.187,83	6,12%	101	4,46%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			86.617.773,21				



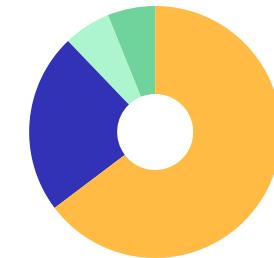
**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA 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%	18,41%	59,24%	51.312.368,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	33.527.824,09	38,71%	13,81%	18,41%	100,00%	53.089.949,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	22.520.869,81	26,00%	12,62%	16,83%	50,00%	20.788.016,80
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	16,83%	20,00%	17.323.554,64
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,79%	5,00%	4.330.888,66
Total Renda Fixa	100,00%	56.048.693,90	64,71%	26,43%	73,27%	234,24%	



- █ RENDA FIXA 56.048.693,90
- █ RENDA VARIÁVEL 20.032.456,04
- █ EXTERIOR 5.232.435,44
- █ ESTRUTURADOS 5.304.187,83



**CRÉDITO
& MERCADO**

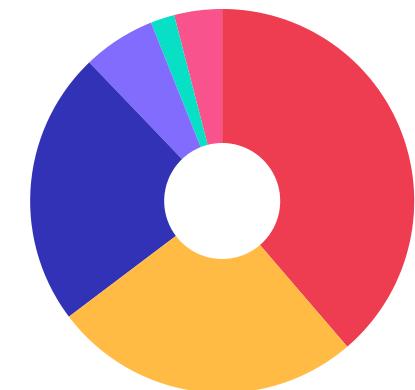
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	20.032.456,04	23,13%	0,00%	16,11%	20,00%	-2.708.901,40
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,84%	20,00%	17.323.554,64
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.304.187,83	6,12%	2,09%	2,78%	10,00%	3.357.589,49
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	25.336.643,87	29,25%	2,09%	21,73%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	1.745.936,33	2,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.745.936,33
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.486.499,11	4,03%	0,00%	5,00%	10,00%	5.175.278,21
Total Exterior	10,00%	5.232.435,44	6,04%	0,00%	5,00%	10,00%	



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



Enquadramento por Gestores - base (Março / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	66.232.947,65	76,47	0,00
CAIXA DTVM	14.467.836,12	16,70	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.936.551,70	3,39	-
ITAÚ UNIBANCO	2.053.526,68	2,37	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	926.911,06	1,07	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'	33.527.824,09	38,71	13,81	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	14.019.000,72	16,18	12,62	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	20.032.456,04	23,13	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	3.486.499,11	4,03	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	5.304.187,83	6,12	2,09	10,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,81%	0,79%	0,79%	1,73%	0,56%	2,39%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	0,73%	0,73%	1,59%	0,17%	1,78%	3,01%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,89%	2,28%	2,28%	3,43%	5,14%	7,77%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	2,24%	2,24%	3,36%	4,88%	7,10%	0,33%	0,01%
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%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,58%	3,74%	3,74%	5,75%	8,38%	17,29%	1,35%	0,04%
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%
IRF-M (Benchmark)	0,84%	1,35%	1,35%	2,35%	2,19%	4,49%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,85%	1,38%	1,38%	2,36%	2,00%	4,12%	1,92%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,83%	2,18%	2,18%	3,79%	5,27%	6,45%	0,01%	0,01%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	2,01%	2,01%	3,02%	3,54%	8,04%	1,24%	0,03%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,97%	2,54%	2,54%	4,56%	6,94%	9,72%	0,04%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,41%	3,92%	3,92%	5,51%	8,74%	18,49%	1,03%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,66%	-	-	-	-	-	1,63%	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,71%	1,82%	1,82%	3,11%	4,18%	4,34%	0,01%	0,01%

IPCA (Benchmark)	1,62%	3,20%	3,20%	6,25%	11,30%	18,09%	-	-
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,16%	2,64%	2,64%	4,85%	6,92%	9,12%	0,19%	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%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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
CDI (Benchmark)	0,92%	2,42%	2,42%	4,31%	6,41%	8,78%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1,55%	3,31%	3,31%	5,29%	5,84%	8,54%	0,94%	0,02%
Ibovespa (Benchmark)	6,06%	14,48%	14,48%	8,13%	2,89%	64,34%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5,25%	8,72%	8,72%	5,96%	6,30%	67,64%	9,70%	0,12%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	5,06%	11,50%	11,50%	8,04%	6,30%	87,48%	9,74%	0,14%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	6,10%	14,11%	14,11%	6,82%	1,59%	63,59%	9,95%	0,17%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5,00%	12,71%	12,71%	6,59%	0,34%	55,80%	9,07%	0,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6,02%	11,09%	11,09%	-4,34%	-4,31%	35,59%	11,67%	0,20%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	8,08%	12,77%	12,77%	8,15%	7,33%	63,80%	12,58%	0,16%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5,11%	9,65%	9,65%	-1,69%	-5,16%	46,39%	11,20%	0,18%
S&P 500 (Benchmark)	3,32%	-4,95%	-4,95%	5,17%	14,03%	75,29%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	4,72%	-3,48%	-3,48%	8,33%	18,36%	-	10,18%	0,14%
SMALL (Benchmark)	8,81%	6,69%	6,69%	-5,35%	-9,80%	48,46%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	9,42%	7,84%	7,84%	-5,11%	-10,62%	42,27%	15,01%	0,24%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	9,09%	11,78%	11,78%	-1,64%	1,21%	54,57%	13,47%	0,21%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-4,97%	-20,36%	-20,36%	-10,46%	-7,39%	65,84%	-	-



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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



CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-4,97%	-20,36%	-20,36%	-10,46%	-7,39%	65,84%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-	-19,47%	-19,47%	-9,63%	-6,05%	47,37%	11,07%	0,19%
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,56%	-19,79%	-19,79%	-11,55%	-9,70%	50,18%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	-22,59%	-22,59%	-14,02%	-10,17%	68,05%	8,09%	0,22%

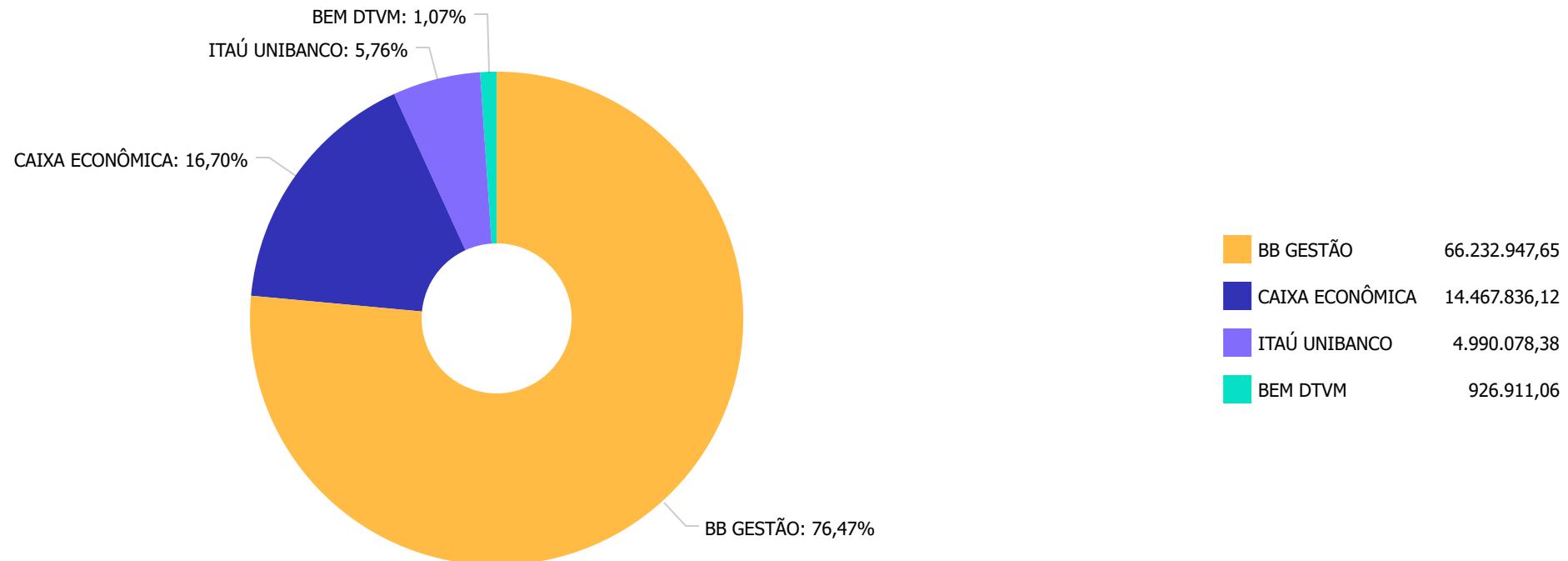


CRÉDITO
& MERCADO

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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



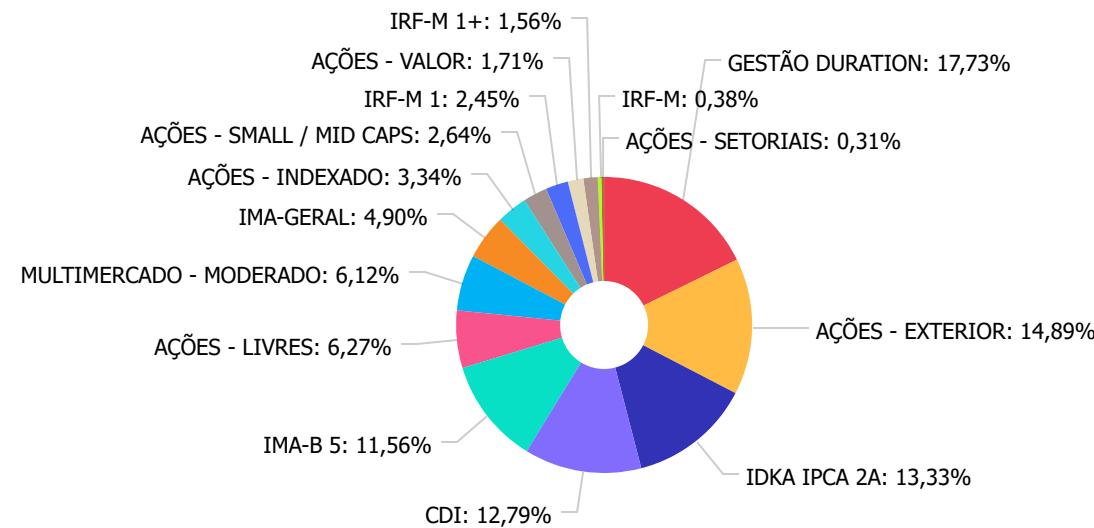


**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022



■ GESTÃO DURATION	15.353.689,41	■ AÇÕES - EXTERIOR	12.900.811,23	■ IDKA IPCA 2A	11.549.111,08	■ CDI	11.082.449,02
■ IMA-B 5	10.010.459,27	■ AÇÕES - LIVRES	5.434.718,75	■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.304.187,83	■ IMA-GERAL	4.243.949,98
■ AÇÕES - INDEXADO	2.897.197,08	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.288.078,68	■ IRF-M 1	2.125.194,41	■ AÇÕES - VALOR	1.477.765,31
■ IRF-M 1+	1.355.372,53	■ IRF-M	328.468,20	■ AÇÕES - SETORIAIS	266.320,43		



**CRÉDITO
& MERCADO**

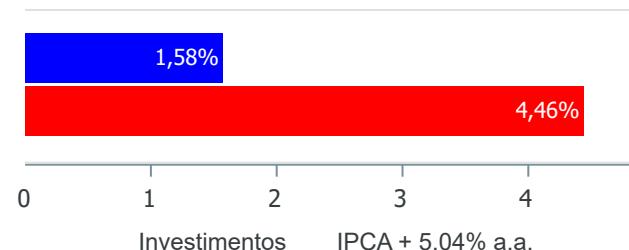
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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%

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: 31/03/2022

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**

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	978.568,23	0,00	0,00	1.004.563,48	25.995,25	2,66%	2,66%	1,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.962.515,19	0,00	0,00	6.119.118,67	156.603,48	2,63%	2,63%	1,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.291.350,42	0,00	0,00	5.429.992,41	138.641,99	2,62%	2,62%	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.652.761,71	0,00	0,00	1.695.507,70	42.745,99	2,59%	2,59%	1,34%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.120.460,75	0,00	0,00	5.252.501,67	132.040,92	2,58%	2,58%	1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.009.420,52	0,00	0,00	2.057.886,42	48.465,90	2,41%	2,41%	1,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.387.712,52	0,00	0,00	8.501.869,09	114.156,57	1,36%	1,36%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.187.734,50	0,00	0,00	4.243.949,98	56.215,48	1,34%	1,34%	1,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.902.784,93	0,00	0,00	2.936.551,70	33.766,77	1,16%	1,16%	0,19%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.691.075,36	0,00	0,00	1.707.414,73	16.339,37	0,97%	0,97%	0,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.792.211,74	0,00	0,00	1.807.753,60	15.541,86	0,87%	0,87%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	314.716,05	0,00	0,00	317.440,81	2.724,76	0,87%	0,87%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	325.690,03	0,00	0,00	328.468,20	2.778,17	0,85%	0,85%	1,92%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.883.263,22	0,00	0,00	3.915.268,62	32.005,40	0,82%	0,82%	0,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.344.369,26	0,00	0,00	1.355.372,53	11.003,27	0,82%	0,82%	3,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	8.634.888,37	3.443.718,18	2.889.784,60	9.275.667,04	86.845,09	0,72%	0,83%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	623,02	98.706,08	0,00	99.367,25	38,15	0,04%	0,71%	0,01%
Total Renda Fixa	54.480.145,82	3.542.424,26	2.889.784,60	56.048.693,90	915.908,42	1,66%		0,90%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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 SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.243.936,88	0,00	0,00	1.361.167,62	117.230,74	9,42%	9,42%	15,01%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	849.672,14	0,00	0,00	926.911,06	77.238,92	9,09%	9,09%	13,47%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	246.413,93	0,00	0,00	266.320,43	19.906,50	8,08%	8,08%	12,58%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.730.730,62	0,00	0,00	2.897.197,08	166.466,46	6,10%	6,10%	9,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.936.855,53	0,00	0,00	2.053.526,68	116.671,15	6,02%	6,02%	11,67%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.404.120,09	0,00	0,00	1.477.765,31	73.645,22	5,24%	5,24%	9,70%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	352.942,18	0,00	0,00	370.971,91	18.029,73	5,11%	5,73%	11,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.955.555,96	0,00	0,00	2.054.566,27	99.010,31	5,06%	5,06%	9,74%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	910.109,73	0,00	0,00	955.653,89	45.544,16	5,00%	5,00%	9,07%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.322.472,60	0,00	0,00	7.668.375,79	345.903,19	4,72%	4,72%	10,18%
Total Renda Variável	18.952.809,66	0,00	0,00	20.032.456,04	1.079.646,38	5,70%		10,70%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO FUNDAMENTALISMO SUSTENTABILIDADE E GESTÃO DE RISCOS	1.795.435,41	0,00	0,00	1.745.936,33	-49.499,08	-2,76%	-2,76%	8,09%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.644.200,06	0,00	0,00	3.486.499,11	-157.700,95	-4,33%	-4,33%	11,07%
Total Exterior	5.439.635,47	0,00	0,00	5.232.435,44	-207.200,03	-3,81%		10,07%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	12.417.672,38	8.264.835,74	11.651.965,50	9.275.667,04	245.124,42	1,19%	2,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.893.835,58	0,00	0,00	6.119.118,67	225.283,09	3,82%	3,82%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.230.342,35	0,00	0,00	5.429.992,41	199.650,06	3,82%	3,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.063.146,73	0,00	0,00	5.252.501,67	189.354,94	3,74%	3,74%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	8.316.107,91	0,00	0,00	8.501.869,09	185.761,18	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.826.677,00	0,00	0,00	3.915.268,62	88.591,62	2,32%	2,32%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.160.514,98	0,00	0,00	4.243.949,98	83.435,00	2,01%	2,01%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.861.134,10	0,00	0,00	2.936.551,70	75.417,60	2,64%	2,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.592.807,45	41.631,38	0,00	1.695.507,70	61.068,87	3,74%	3,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.057.886,42	57.886,42	2,89%	3,92%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.665.056,25	0,00	0,00	1.707.414,73	42.358,48	2,54%	2,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.768.238,97	0,00	0,00	1.807.753,60	39.514,63	2,23%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	1.000.000,00	28.230,51	1.004.563,48	32.793,99	3,28%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.345.571,23	0,00	0,00	1.355.372,53	9.801,30	0,73%	0,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	320.431,11	0,00	10.000,00	317.440,81	7.009,70	2,19%	2,22%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	324.007,48	0,00	0,00	328.468,20	4.460,72	1,38%	1,38%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	616,21	98.706,08	0,00	99.367,25	44,96	0,05%	1,82%
Total Renda Fixa	54.786.159,73	11.405.173,20	11.690.196,01	56.048.693,90	1.547.556,98	2,34%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	2.538.991,46	0,00	0,00	2.897.197,08	358.205,62	14,11%	14,11%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.842.655,23	0,00	0,00	2.054.566,27	211.911,04	11,50%	11,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.848.603,17	0,00	0,00	2.053.526,68	204.923,51	11,09%	11,09%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	5.134.021,72	0,00	0,00	5.304.187,83	170.166,11	3,31%	3,31%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.359.207,83	0,00	0,00	1.477.765,31	118.557,48	8,72%	8,72%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	847.926,77	0,00	0,00	955.653,89	107.727,12	12,70%	12,70%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.262.215,22	0,00	0,00	1.361.167,62	98.952,40	7,84%	7,84%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	829.204,93	0,00	0,00	926.911,06	97.706,13	11,78%	11,78%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	338.336,90	0,00	0,00	370.971,91	32.635,01	9,65%	9,65%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	236.153,51	0,00	0,00	266.320,43	30.166,92	12,77%	12,77%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	7.944.694,48	0,00	0,00	7.668.375,79	-276.318,69	-3,48%	-3,48%
Total Renda Variável	24.182.011,22	0,00	0,00	25.336.643,87	1.154.632,65	4,77%	



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/03/2022

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
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO FUNDAMENTALISMO SUSTENTABILIDADE E GESTÃO DE RISCOS	2.255.461,29	0,00	0,00	1.745.936,33	-509.524,96	-22,59%	-22,59%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.329.190,78	0,00	0,00	3.486.499,11	-842.691,67	-19,47%	-19,47%
Total Exterior	6.584.652,07	0,00	0,00	5.232.435,44	-1.352.216,63	-20,54%	



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 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.

