

# Relatório Analítico dos Investimentos

## em janeiro 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 (Janeiro / 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     | 4.162.095,48  | 4,98%              | 549      | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+1     | Não há     | 5.230.846,12  | 6,25%              | 1.032    | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP               | D+1     | Não há     | 5.067.035,88  | 6,06%              | 787      | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0     | Não há     | 1.779.096,87  | 2,13%              | 1.126    | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | D+0     | 2024-08-15 | 996.337,25    | 1,19%              | 114      | 0,11%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA            | D+0     | Não há     | 3.852.224,15  | 4,61%              | 941      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA  | D+0     | Não há     | 5.894.944,38  | 7,05%              | 1.059    | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | D+0     | Não há     | 1.594.246,99  | 1,91%              | 1.021    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | D+0     | Não há     | 322.382,53    | 0,39%              | 1.237    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA      | D+0     | Não há     | 1.338.345,11  | 1,60%              | 254      | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0     | Não há     | 323.774,86    | 0,39%              | 325      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PESADA     | D+3     | Não há     | 8.331.974,26  | 9,96%              | 583      | 0,20%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO            | D+0     | Não há     | 10.011.901,03 | 11,97%             | 821      | 0,32%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA                            | D+0     | Não há     | 1.677.656,98  | 2,01%              | 92       | 0,16%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO                  | D+0     | Não há     | 619,50        | 0,00%              | 16.086   | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA       | D+1     | Não há     | 2.876.079,67  | 3,44%              | 248      | 0,11%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                                | D+4     | Não há     | 905.063,94    | 1,08%              | 836      | 0,19%            | Artigo 8º, Inciso I                 |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES                         | D+3     | Não há     | 7.515.044,60  | 8,99%              | 47.255   | 0,29%            | Artigo 8º, Inciso I                 |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                                  | D+33    | Não há     | 1.409.283,87  | 1,69%              | 2.508    | 0,12%            | Artigo 8º, Inciso I                 |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES                                 | D+4     | Não há     | 2.709.007,35  | 3,24%              | 2.117    | 0,26%            | Artigo 8º, Inciso I                 |



**CRÉDITO  
& MERCADO**

**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2022)**

| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência | Saldo                | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento         |
|---|---------|----------|----------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                       | D+3     | Não há   | 1.962.159,61         | 2,35%              | 27.194   | 0,13%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                             | D+4     | Não há   | 1.316.883,89         | 1,57%              | 16.095   | 0,30%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES                    | D+4     | Não há   | 862.058,92           | 1,03%              | 1.130    | 0,06%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                   | D+25    | Não há   | 357.693,55           | 0,43%              | 1.937    | 0,04%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES                       | D+4     | Não há   | 246.074,05           | 0,29%              | 5.138    | 0,07%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                | D+24    | Não há   | 1.943.973,43         | 2,32%              | 105      | 0,24%            | Artigo 8º, Inciso I   |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI... | D+5 du  | Não há   | 1.905.332,52         | 2,28%              | 80       | 0,21%            | Artigo 9º, Inciso II  |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I       | D+5     | Não há   | 3.869.553,83         | 4,63%              | 24.831   | 0,31%            | Artigo 9º, Inciso III |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO          | D+5 du  | Não há   | 5.171.517,91         | 6,18%              | 103      | 4,37%            | Artigo 10º, Inciso I  |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>  |         |          | <b>83.633.208,53</b> |                    |          |                  |                       |



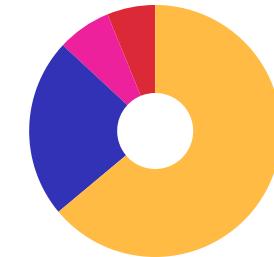
**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 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%         | <b>49.544.312,73</b> |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 100,00%        | 30.561.329,62        | 36,54%        | 13,81%                        | 18,41%        | 100,00%        | <b>53.071.878,91</b> |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 60,00%         | 22.898.231,44        | 27,38%        | 12,62%                        | 16,83%        | 50,00%         | <b>18.918.372,83</b> |
| Artigo 7º, Inciso IV              | 20,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 16,83%        | 20,00%         | <b>16.726.641,71</b> |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 2,79%         | 5,00%          | <b>4.181.660,43</b>  |
| <b>Total Renda Fixa</b>           | <b>100,00%</b> | <b>53.459.561,06</b> | <b>63,92%</b> | <b>26,43%</b>                 | <b>73,27%</b> | <b>234,24%</b> |                      |



- █ RENDA FIXA 53.459.561,06
- █ RENDA VARIÁVEL 19.227.243,21
- █ EXTERIOR 5.774.886,35
- █ ESTRUTURADOS 5.171.517,91



**CRÉDITO  
& MERCADO**

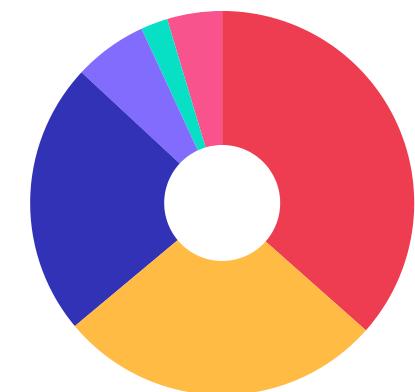
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução | Carteira \$   | Carteira | Estratégia de Alocação - 2022 |        |        | GAP Superior  |
|--|-----------|---------------|----------|-------------------------------|--------|--------|---------------|
|  |           |               |          | Inf                           | Alvo   | Sup    |               |
| Artigo 8º, Inciso I                                  | 30,00%    | 19.227.243,21 | 22,99%   | 0,00%                         | 16,11% | 20,00% | -2.500.601,50 |
| Artigo 8º, Inciso II                                 | 30,00%    | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 2,84%  | 20,00% | 16.726.641,71 |
| Artigo 10º, Inciso I                                 | 10,00%    | 5.171.517,91  | 6,18%    | 2,09%                         | 2,78%  | 10,00% | 3.191.802,94  |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário     | 30,00%    | 24.398.761,12 | 29,17%   | 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%    | 1.905.332,52 | 2,28%    | 0,00%                                  | 0,00% | 0,00%    | -1.905.332,52 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%    | 3.869.553,83 | 4,63%    | 0,00%                                  | 5,00% | 10,00%   | 4.493.767,02  |
| Total Exterior        | 10,00%    | 5.774.886,35 | 6,91%    | 0,00%                                  | 5,00% | 10,00%   |               |



|   |  |  |   |
|---|--|--|---|
| <span style="color: red;">■</span> 7º I b | <span style="color: orange;">■</span> 7º III a | <span style="color: blue;">■</span> 8º I | <span style="color: purple;">■</span> 10º I |
| <span style="color: cyan;">■</span> 9º II | <span style="color: pink;">■</span> 9º III     |  |   |



**Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2022)**

| Gestão                     | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 64.020.791,39 | 76,55         | 0,00           |
| CAIXA DTVM                 | 13.930.305,12 | 16,66         | -              |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT      | 2.876.079,67  | 3,44          | -              |
| ITAÚ UNIBANCO              | 1.943.973,43  | 2,32          | 0,00           |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT  | 862.058,92    | 1,03          | 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'   | 30.561.329,62                 | 36,54      | 13,81               | 100,00              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 14.566.257,18                 | 17,42      | 12,62               | 50,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I               | 19.227.243,21                 | 22,99      | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso II              | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 9º, Inciso III             | 3.869.553,83                  | 4,63       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 10º, Inciso I              | 5.171.517,91                  | 6,18       | 2,09                | 10,00               |



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

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

|   | Mês    | Ano    | 3M    | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|--------|-------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                         | 0,05%  | 0,05%  | 3,41% | 3,29%  | 4,87%  | 13,47% | -       | -                |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,01%  | 0,01%  | 3,16% | 3,11%  | 4,47%  | 12,51% | 1,06%   | 0,03%            |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,02%  | 0,02%  | 3,17% | 3,14%  | 4,54%  | 12,58% | 1,11%   | 0,03%            |
| <b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>                                 | -0,50% | -0,50% | 4,01% | -1,41% | -4,13% | 1,40%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | -0,54% | -0,54% | 3,95% | -1,62% | -4,49% | 0,83%  | 2,56%   | 0,06%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                  | 0,63%  | 0,63%  | 2,31% | 2,54%  | 3,53%  | 7,08%  | -       | -                |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,61%  | 0,61%  | 2,25% | 2,43%  | 3,24%  | 6,41%  | 0,38%   | 0,01%            |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 0,61%  | 0,61%  | 2,25% | 2,44%  | 3,30%  | 6,63%  | 0,37%   | 0,01%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                  | 0,11%  | 0,11%  | 3,42% | 3,32%  | 4,57%  | 12,47% | -       | -                |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                 | 0,08%  | 0,08%  | 3,33% | 3,12%  | 4,25%  | 11,85% | 1,00%   | 0,03%            |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 0,09%  | 0,09%  | 3,35% | 3,20%  | 4,32%  | 11,89% | 0,99%   | 0,03%            |
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                                    | -0,08% | -0,08% | 3,63% | -0,03% | -1,28% | 3,58%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | -0,07% | -0,07% | 3,64% | -0,11% | -1,50% | 3,17%  | 1,65%   | 0,04%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                      | 0,73%  | 0,73%  | 2,10% | 3,47%  | 5,00%  | 7,66%  | -       | -                |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO              | 0,65%  | 0,65%  | 1,84% | 2,91%  | 3,86%  | 5,35%  | 0,00%   | 0,01%            |



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

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

|  | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 0,04% | 0,04% | 2,70% | 0,57% | 0,19%  | 4,21%  | 1,02%   | 0,03%            |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -     | -     | -     | -     | -      | -      | 0,00%   | -                |
| BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA                       | 0,76% | 0,76% | 2,23% | 3,73% | 5,47%  | 7,84%  | 0,02%   | 0,01%            |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO             | 0,53% | 0,53% | 1,49% | 2,32% | 2,92%  | 3,05%  | 0,00%   | 0,01%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                              | 0,54% | 0,54% | 2,24% | 5,63% | 10,38% | 15,41% | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA  | 0,52% | 0,52% | 3,06% | 3,87% | 4,94%  | 7,72%  | 0,38%   | 0,02%            |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA       | 0,67% | 0,67% | 2,42% | 0,62% | 0,53%  | 6,39%  | 0,36%   | 0,03%            |



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

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

|  | Mês    | Ano    | 3M     | 6M      | 12M     | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|--------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| <b>Ibovespa (Benchmark)</b>                    | 6,98%  | 6,98%  | 8,35%  | -7,93%  | -2,54%  | -1,42%  | -       | -                |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                       | 3,68%  | 3,68%  | 6,98%  | -3,28%  | 4,59%   | 6,18%   | 6,86%   | 0,15%            |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES                  | 6,49%  | 6,49%  | 8,64%  | -2,97%  | 5,03%   | 11,07%  | 8,38%   | 0,16%            |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES                      | 6,70%  | 6,70%  | 8,41%  | -9,80%  | -2,87%  | -2,40%  | 9,12%   | 0,17%            |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                     | 6,74%  | 6,74%  | 8,20%  | -9,31%  | -3,83%  | -7,73%  | 7,95%   | 0,16%            |
| ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES           | 5,16%  | 5,16%  | 2,66%  | -20,19% | -10,21% | -32,32% | 10,97%  | 0,20%            |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES                  | 4,20%  | 4,20%  | 10,66% | -3,67%  | -0,19%  | -4,83%  | 11,97%  | 0,16%            |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES              | 5,72%  | 5,72%  | 5,48%  | -12,94% | -8,27%  | -12,37% | 11,30%  | 0,17%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                         | 0,73%  | 0,73%  | 2,10%  | 3,47%   | 5,00%   | 7,66%   | -       | -                |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO     | 0,73%  | 0,73%  | 2,73%  | 1,75%   | 1,65%   | -       | 1,13%   | 0,03%            |
| <b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>                 | -5,26% | -5,26% | -1,95% | 2,74%   | 21,57%  | 39,99%  | -       | -                |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES              | -5,41% | -5,41% | -0,96% | 4,38%   | 23,74%  | -       | 8,81%   | 0,13%            |
| <b>SMALL (Benchmark)</b>                       | 3,42%  | 3,42%  | 4,89%  | -17,43% | -10,25% | -14,29% | -       | -                |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES                        | 4,33%  | 4,33%  | 5,26%  | -18,84% | -12,25% | -21,46% | 16,10%  | 0,21%            |
| BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES               | 3,96%  | 3,96%  | 4,59%  | -14,52% | -3,69%  | -9,51%  | 14,13%  | 0,19%            |
| <b>MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)</b> | -9,77% | -9,77% | -8,63% | 5,47%   | 15,92%  | 77,11%  | -       | -                |



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/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: 31/01/2022

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

|  | Mês     | Ano     | 3M     | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|---------|---------|--------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)                              | -9,77%  | -9,77%  | -8,63% | 5,47% | 15,92% | 77,11% | -       | -                |
| BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I                        | -10,62% | -10,62% | -      | -     | -      | 68,78% | 10,14%  | 0,18%            |
| MSCI WORLD (Benchmark)   | -9,13%  | -9,13%  | -8,52% | 4,26% | 12,44% | 63,87% | -       | -                |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR... | -15,52% | -15,52% | -      | -     | -      | 73,67% | 9,88%   | 0,22%            |

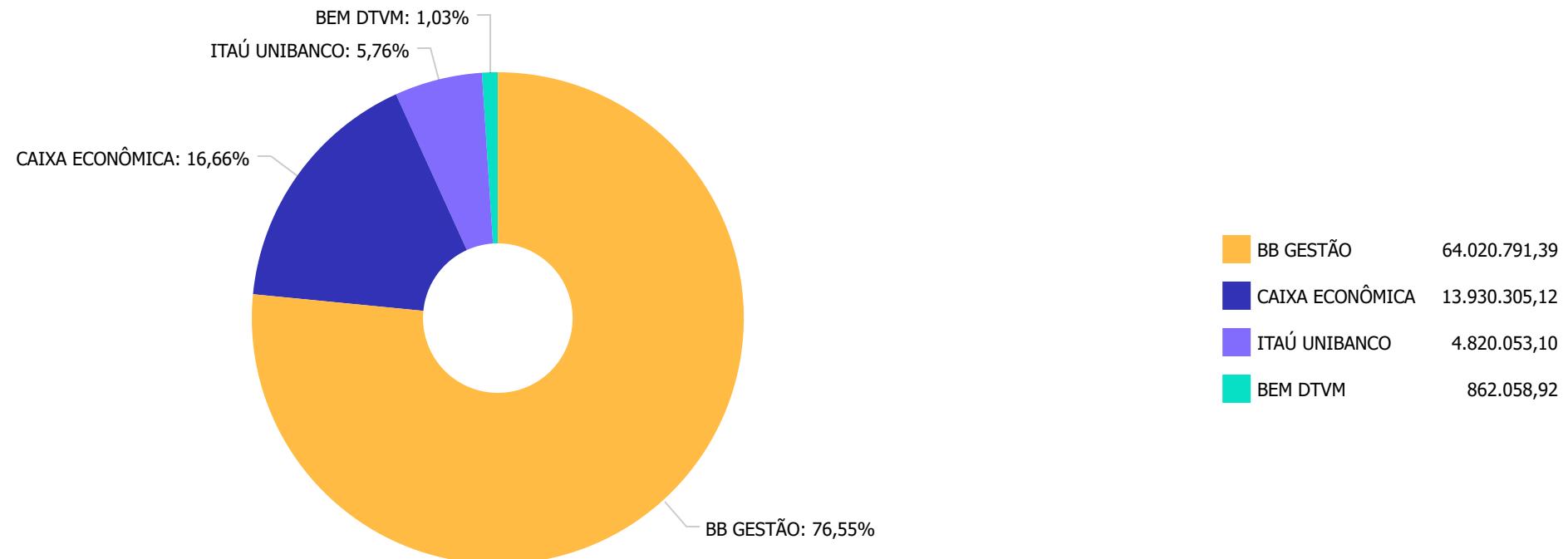


CRÉDITO  
& MERCADO

## Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2022)

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022



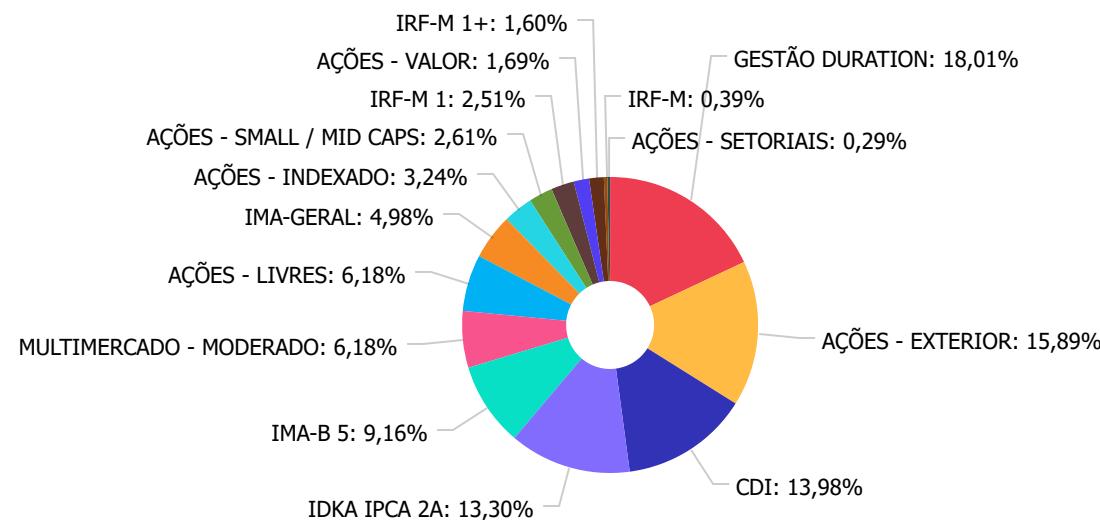


**CRÉDITO  
& MERCADO**

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

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022



|                    |               |                            |               |                     |               |                 |               |
|--------------------|---------------|----------------------------|---------------|---------------------|---------------|-----------------|---------------|
| ■ GESTÃO DURATION  | 15.060.278,08 | ■ AÇÕES - EXTERIOR         | 13.289.930,95 | ■ CDI               | 11.690.177,51 | ■ IDKA IPCA 2A  | 11.125.790,50 |
| ■ IMA-B 5          | 7.657.620,12  | ■ MULTIMERCADO - MODERADO  | 5.171.517,91  | ■ AÇÕES - LIVRES    | 5.168.890,53  | ■ IMA-GERAL     | 4.162.095,48  |
| ■ AÇÕES - INDEXADO | 2.709.007,35  | ■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS | 2.178.942,81  | ■ IRF-M 1           | 2.101.479,40  | ■ AÇÕES - VALOR | 1.409.283,87  |
| ■ IRF-M 1+         | 1.338.345,11  | ■ IRF-M                    | 323.774,86    | ■ AÇÕES - SETORIAIS | 246.074,05    |                 |               |



CRÉDITO  
& MERCADO

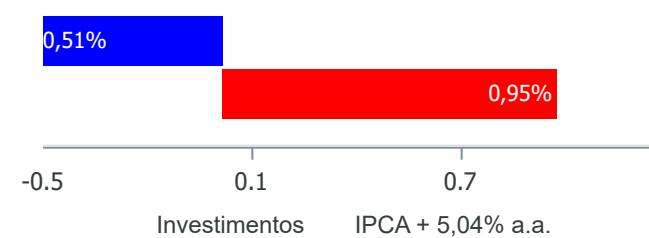
FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

### 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% |

### 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: 31/01/2022

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: 31/01/2022

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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior       | Aplicações          | Resgates            | Saldo Atual          | Retorno (R\$)     | Retorno (%)  | (%) Instit | Var - Mês    |
|---|----------------------|---------------------|---------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA                        | 1.665.056,25         | 0,00                | 0,00                | 1.677.656,98         | 12.600,73         | 0,76%        | 0,76%      | 0,02%        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 3.826.677,00         | 0,00                | 0,00                | 3.852.224,15         | 25.547,15         | 0,67%        | 0,67%      | 0,36%        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 1.768.238,97         | 0,00                | 0,00                | 1.779.096,87         | 10.857,90         | 0,61%        | 0,61%      | 0,38%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 320.431,11           | 0,00                | 0,00                | 322.382,53           | 1.951,42          | 0,61%        | 0,61%      | 0,37%        |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 12.417.672,38        | 1.390.023,42        | 3.876.712,66        | 10.011.901,03        | 80.917,89         | 0,59%        | 0,65%      | 0,00%        |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO              | 616,21               | 0,00                | 0,00                | 619,50               | 3,29              | 0,53%        | 0,53%      | 0,00%        |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 2.861.134,10         | 0,00                | 0,00                | 2.876.079,67         | 14.945,57         | 0,52%        | 0,52%      | 0,38%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 8.316.107,91         | 0,00                | 0,00                | 8.331.974,26         | 15.866,35         | 0,19%        | 0,19%      | 0,76%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.592.807,45         | 0,00                | 0,00                | 1.594.246,99         | 1.439,54          | 0,09%        | 0,09%      | 0,99%        |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 5.063.146,73         | 0,00                | 0,00                | 5.067.035,88         | 3.889,15          | 0,08%        | 0,08%      | 1,00%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 4.160.514,98         | 0,00                | 0,00                | 4.162.095,48         | 1.580,50          | 0,04%        | 0,04%      | 1,02%        |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 5.893.835,58         | 0,00                | 0,00                | 5.894.944,38         | 1.108,80          | 0,02%        | 0,02%      | 1,11%        |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 5.230.342,35         | 0,00                | 0,00                | 5.230.846,12         | 503,77            | 0,01%        | 0,01%      | 1,06%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 324.007,48           | 0,00                | 0,00                | 323.774,86           | -232,62           | -0,07%       | -0,07%     | 1,65%        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | 0,00                 | 1.000.000,00        | 0,00                | 996.337,25           | -3.662,75         | -0,37%       | 0,00%      | 0,00%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 1.345.571,23         | 0,00                | 0,00                | 1.338.345,11         | -7.226,12         | -0,54%       | -0,54%     | 2,56%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>54.786.159,73</b> | <b>2.390.023,42</b> | <b>3.876.712,66</b> | <b>53.459.561,06</b> | <b>160.090,57</b> | <b>0,29%</b> |            | <b>0,68%</b> |



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

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

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

| Ativos Renda Variável                | Saldo Anterior       | Aplicações  | Resgates    | Saldo Atual          | Retorno (R\$)     | Retorno (%)  | (%) Instit | Var - Mês    |
|--------------------------------------|----------------------|-------------|-------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES           | 847.926,77           | 0,00        | 0,00        | 905.063,94           | 57.137,17         | 6,74%        | 6,74%      | 7,95%        |
| BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES            | 2.538.991,46         | 0,00        | 0,00        | 2.709.007,35         | 170.015,89        | 6,70%        | 6,70%      | 9,12%        |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES        | 1.842.655,23         | 0,00        | 0,00        | 1.962.159,61         | 119.504,38        | 6,49%        | 6,49%      | 8,38%        |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES    | 338.336,90           | 0,00        | 0,00        | 357.693,55           | 19.356,65         | 5,72%        | 5,72%      | 11,30%       |
| ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 1.848.603,17         | 0,00        | 0,00        | 1.943.973,43         | 95.370,26         | 5,16%        | 5,16%      | 10,97%       |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES              | 1.262.215,22         | 0,00        | 0,00        | 1.316.883,89         | 54.668,67         | 4,33%        | 4,33%      | 16,10%       |
| CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES        | 236.153,51           | 0,00        | 0,00        | 246.074,05           | 9.920,54          | 4,20%        | 4,20%      | 11,97%       |
| BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES     | 829.204,93           | 0,00        | 0,00        | 862.058,92           | 32.853,99         | 3,96%        | 3,96%      | 14,13%       |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES             | 1.359.207,83         | 0,00        | 0,00        | 1.409.283,87         | 50.076,04         | 3,68%        | 3,68%      | 6,86%        |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES    | 7.944.694,48         | 0,00        | 0,00        | 7.515.044,60         | -429.649,88       | -5,41%       | -5,41%     | 8,81%        |
| <b>Total Renda Variável</b>          | <b>19.047.989,50</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>19.227.243,21</b> | <b>179.253,71</b> | <b>0,94%</b> |            | <b>9,67%</b> |



**CRÉDITO  
& MERCADO**

FUNDO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL DE UMUARAMA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2022

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 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            | 4.329.190,78        | 0,00        | 0,00        | 3.869.553,83        | -459.636,95        | -10,62%        | -10,62%    | 10,14%        |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO... | 2.255.461,29        | 0,00        | 0,00        | 1.905.332,52        | -350.128,77        | -15,52%        | -15,52%    | 9,88%         |
| <b>Total Exterior</b>                                    | <b>6.584.652,07</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>5.774.886,35</b> | <b>-809.765,72</b> | <b>-12,30%</b> |            | <b>10,06%</b> |



## 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.

