



Estado de Rondônia
PREFEITURA MUNICIPAL DE JI-PARANÁ
SECRETARIA MUNICIPAL DE ADMINISTRAÇÃO
FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL – FPS



RELATÓRIO ANALÍTICO DOS INVESTIMENTOS FPS – FUNDO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL

Publicação do resultado da Carteira de Investimento do Fundo de Previdência Social de Ji-Paraná no mês de **Novembro de 2021**, disponibilizado pela Consultoria de Investimentos Crédito & Mercado Gestão de Valores Mobiliários LTDA, certificada pela Comissão de Valores Mobiliários – CVM, contratada pelo FPS através do Contrato nº 002/FPS/PMJP/2021.

AGOSTINHO CASTELLO BRANCO FILHO

Certificação APIMEC – CGRPPS n. 4873

Diretor-Presidente do FPS

Decreto n. 13.776/GAB/PM/JP/2021

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	176.097,58	0,09%	254	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.459.721,80	1,30%	635	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	29.935,57	0,02%	1.122	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	850.201,77	0,45%	542	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	35.286.403,42	18,67%	952	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	34.057.782,39	18,02%	1.061	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	19.741.339,21	10,44%	1.021	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	8.977.921,97	4,75%	298	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.784.677,07	2,53%	1.240	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.456.676,84	2,36%	265	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	120.290,71	0,06%	338	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	18.562.328,41	9,82%	588	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.727.793,63	3,56%	181	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	4.223,96	0,00%	306	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.497.302,32	2,91%	841	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	13.884.699,70	7,35%	18	15,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ASG BRASIL FIC AÇÕES	D+2 du	Não há	718.143,29	0,38%	846	7,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.282.442,37	0,68%	5.399	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.784.383,36	0,94%	27.327	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	4.625.630,85	2,45%	53.508	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

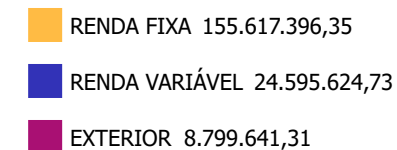
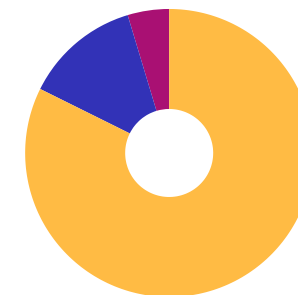
Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.309.146,63	1,75%	148	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	669.155,02	0,35%	2.871	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	2.539.166,14	1,34%	136.442	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.986.041,02	1,58%	131	0,26%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	5.420.489,95	2,87%	19.656	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	0,02	0,00%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	Não se ...	Não se aplica	1.261.026,08	0,67%		2,90%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	2.665.730,94	1,41%	1.470	1,17%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	1.490.929,55	0,79%	37.778	0,20%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	4.642.980,82	2,46%	518	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		2,43	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			189.012.662,39				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2,43				Artigo 6º
PL Total			189.012.664,82				



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 2021)

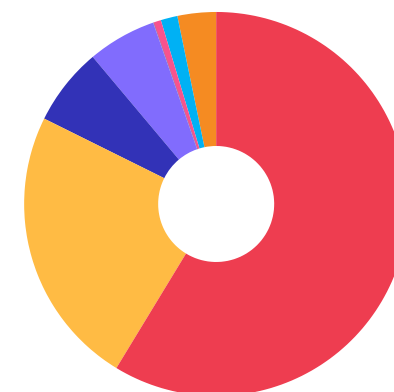
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	110.941.048,33	58,70%	10,60%	53,01%	66,26%	14.298.741,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	44.676.348,02	23,64%	4,06%	20,32%	40,00%	30.928.716,94
Total Renda Fixa	100,00%	155.617.396,35	82,33%	14,66%	73,33%	106,26%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	12.388.901,52	6,55%	3,69%	18,45%	20,00%	25.413.630,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.945.697,11	5,79%	3,07%	3,07%	10,00%	7.955.569,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,02	0,00%	0,00%	2,33%	5,00%	9.450.633,10
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.261.026,08	0,67%	0,00%	2,20%	5,00%	8.189.607,04
Total Renda Variável	30,00%	24.595.624,73	13,01%	6,76%	26,05%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.665.730,94	1,41%	0,00%	0,31%	5,00%	6.784.902,18
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.133.910,37	3,25%	0,00%	0,31%	5,00%	3.316.722,75
Total Exterior	10,00%	8.799.641,31	4,66%	0,00%	0,62%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	139.347.955,90	73,72	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.518.980,69	18,26	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	13.884.699,70	7,35	0,46
REDITUS INVESTIMENTOS	1.261.026,08	0,67	-
ÍNDIGO DTVM	0,02	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 - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	10,60	66,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	4,06	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	18,45	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,07	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	2,51%	4,11%	2,12%	1,88%	5,91%	14,44%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,42%	3,91%	2,18%	2,03%	5,63%	13,50%	1,10%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	2,19%	-7,11%	-2,04%	-3,73%	-4,28%	1,46%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,19%	-7,41%	-2,15%	-3,96%	-4,60%	0,90%	2,48%	0,06%
IMA-B 5+ (Benchmark)	4,47%	-6,23%	-0,84%	-2,98%	0,81%	1,50%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,44%	-6,47%	-0,97%	-3,21%	0,52%	0,94%	6,27%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,35%	-6,68%	-1,07%	-3,40%	0,37%	0,71%	6,09%	0,11%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,79%	2,03%	0,65%	1,42%	2,35%	6,40%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,78%	0,62%	1,30%	2,10%	5,73%	0,32%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,78%	1,84%	0,62%	1,32%	2,13%	5,96%	0,32%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,50%	3,75%	2,25%	2,30%	5,65%	13,47%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,47%	3,52%	2,19%	2,18%	5,40%	12,88%	1,20%	0,04%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,08%	-45,95%	-2,60%	-44,55%	-48,08%	-52,29%	1,17%	0,41%
IMA-B (Benchmark)	3,47%	-1,49%	0,70%	-0,35%	3,30%	6,93%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,44%	-1,72%	0,62%	-0,53%	3,04%	6,38%	3,64%	0,07%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IRF-M (Benchmark)	1,79%	-3,81%	-1,21%	-2,06%	-1,93%	3,27%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,80%	-4,08%	-1,30%	-2,26%	-2,20%	2,67%	1,82%	0,04%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,81%	-3,98%	-1,25%	-2,16%	-2,10%	2,82%	1,83%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,34%	1,46%	2,54%	3,61%	6,55%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,48%	2,64%	1,19%	2,01%	2,74%	4,91%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,62%	3,81%	1,66%	2,94%	4,19%	6,69%	0,06%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,95%	9,26%	3,40%	5,86%	10,74%	15,51%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,91%	-0,93%	0,60%	-1,64%	0,38%	6,30%	0,40%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	-0,22%	0,74%	0,22%	2,47%	-	1,19%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,67%	31,40%	10,22%	19,05%	32,63%	99,29%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,89%	28,32%	9,66%	17,02%	29,21%	95,10%	9,33%	0,14%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,61%	17,63%	5,46%	10,26%	20,07%	35,81%	-	-
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-1,53%	-14,37%	-14,20%	-19,25%	-6,41%	-5,84%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-0,52%	-0,16%	-10,02%	-17,47%	6,32%	13,57%	10,18%	0,19%
BB ASG BRASIL FIC AÇÕES	-2,31%	-	-12,64%	-18,60%	-	-	10,94%	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-2,24%	-9,91%	-13,55%	-18,48%	-3,92%	-0,90%	12,15%	0,18%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-1,49%	-9,49%	-10,16%	-15,14%	-0,06%	13,16%	9,51%	0,19%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-3,26%	-14,33%	-18,31%	-24,38%	-7,49%	-9,26%	10,49%	0,20%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-3,22%	-17,26%	-16,48%	-22,79%	-10,20%	-13,81%	10,79%	0,19%
CDI (Benchmark)	0,59%	3,60%	1,51%	2,62%	3,77%	6,87%	-	-
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,69%	3,61%	1,54%	2,59%	3,94%	8,38%	0,24%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,77%	0,92%	-1,30%	-2,37%	2,21%	6,53%	2,27%	0,03%
MSCI ACWI (Benchmark)	-2,91%	21,57%	7,09%	9,69%	23,86%	76,81%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-0,49%	25,83%	2,15%	11,27%	29,78%	43,53%	7,09%	0,11%

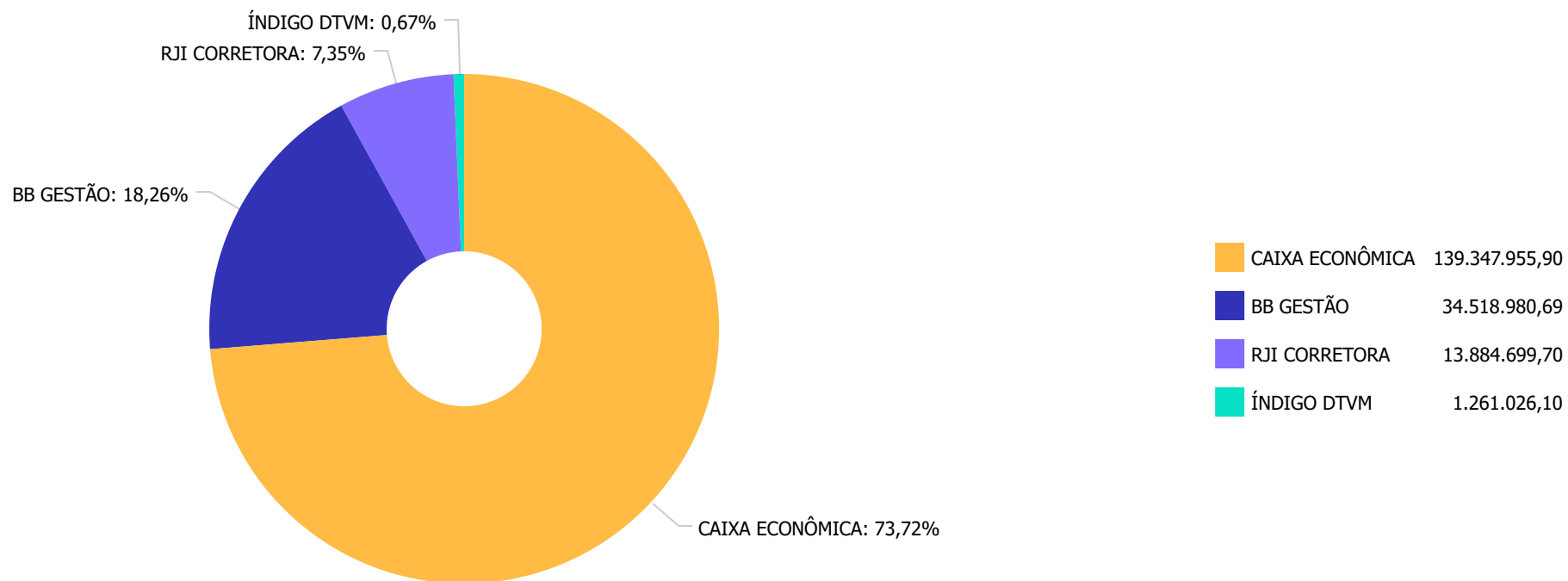
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IFIX (Benchmark)	-3,64%	-10,16%	-6,23%	-8,45%	-8,19%	-10,79%	-	-
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%

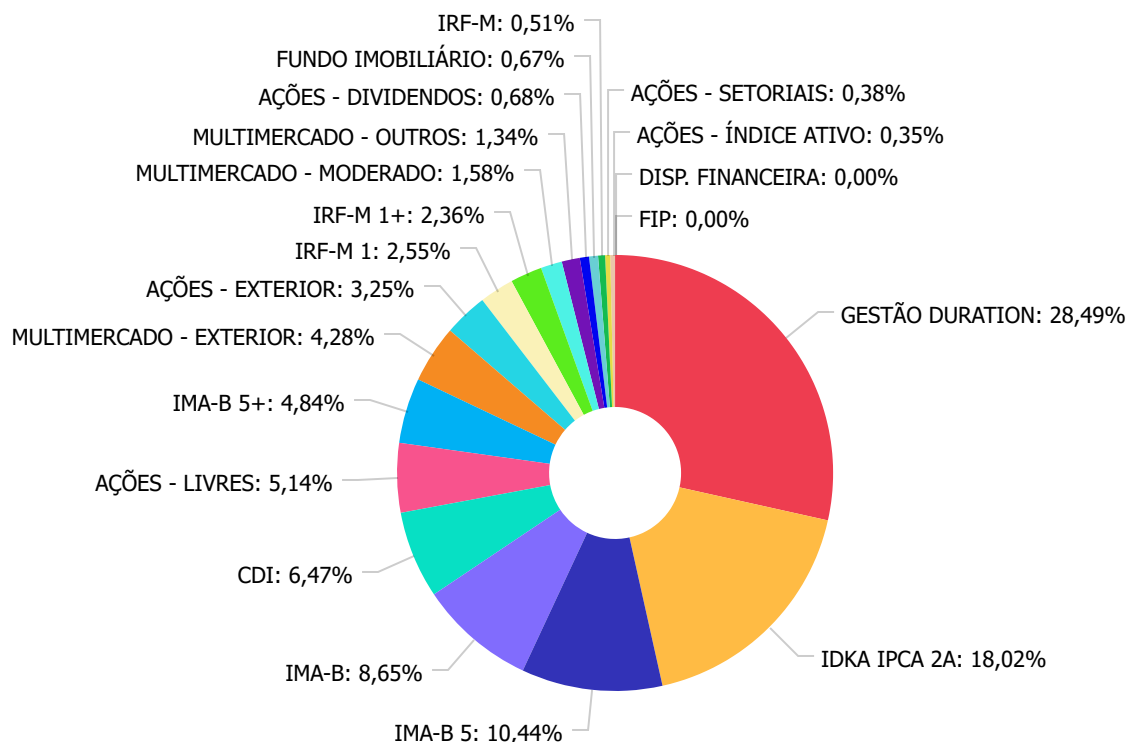
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2021 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-0,67%	31,40%	10,22%	19,05%	32,63%	99,29%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,30%	15,32%	-0,62%	3,24%	19,43%	-	4,84%	0,09%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,89%	28,32%	9,66%	17,02%	29,21%	95,10%	9,33%	0,14%
MSCI WORLD (Benchmark)	-2,70%	24,70%	7,89%	11,96%	26,57%	80,03%	-	-
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-1,80%	13,30%	4,84%	10,20%	14,95%	-	7,44%	0,11%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Novembro / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Novembro / 2021)

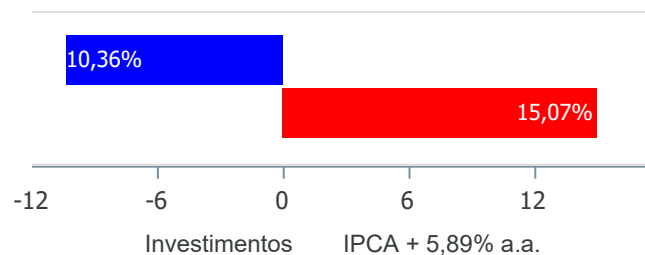


GESTÃO DURATION	53.848.731,83
IDKA IPCA 2A	34.057.782,39
IMA-B 5	19.741.339,21
IMA-B	16.344.421,50
CDI	12.229.319,91
AÇÕES - LIVRES	9.719.160,84
IMA-B 5+	9.154.019,55
MULTIMERCADO - EXTERIOR	8.086.220,89
AÇÕES - EXTERIOR	6.133.910,37
IRF-M 1	4.814.612,64
IRF-M 1+	4.456.676,84
MULTIMERCADO - MODERADO	2.986.041,02
MULTIMERCADO - OUTROS	2.539.166,14
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.282.442,37
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.261.026,08
IRF-M	970.492,48
AÇÕES - SETORIAIS	718.143,29
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	669.155,02
DISP. FINANCEIRA	2,43

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2021

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	196.621.059,54	225.232,77	793.807,25	195.075.703,07	-976.781,99	-976.781,99	-0,50%	-0,50%	0,71%	0,71%	-70,33%	1,84%
Fevereiro	195.075.703,07	2.899.696,77	1.613.708,56	194.460.140,17	-1.901.551,11	-2.878.333,10	-0,97%	-1,46%	1,27%	1,99%	-73,44%	1,68%
Março	194.460.140,17	51.155.593,18	50.201.642,13	195.074.848,95	-339.242,27	-3.217.575,37	-0,17%	-1,63%	1,46%	3,48%	-46,93%	2,36%
Abril	195.074.848,95	2.685.560,90	1.733.139,02	197.277.761,37	1.250.490,54	-1.967.084,83	0,64%	-1,00%	0,77%	4,27%	-23,51%	1,70%
Mai	197.277.761,37	5.003.421,99	3.148.124,73	199.155.015,51	21.956,88	-1.945.127,95	0,01%	-0,99%	1,31%	5,64%	-17,61%	2,05%
Junho	199.155.015,51	3.620.185,46	2.352.071,75	200.443.791,47	20.662,25	-1.924.465,70	0,01%	-0,98%	1,01%	6,71%	-14,66%	1,78%
Julho	200.443.791,47	15.611.968,22	14.195.229,37	200.379.339,65	-1.481.190,67	-3.405.656,37	-0,73%	-1,71%	1,47%	8,27%	-20,67%	2,14%
Agosto	200.379.339,65	13.191.199,55	11.255.768,89	184.757.410,56	-17.557.359,75	-20.963.016,12	-8,68%	-10,24%	1,38%	9,76%	-104,93%	6,64%
Setembro	184.757.410,56	3.139.291,36	1.821.927,47	185.703.738,16	-371.036,29	-21.334.052,41	-0,20%	-10,42%	1,64%	11,56%	-90,11%	2,13%
Outubro	185.703.738,16	5.043.895,43	3.257.412,79	185.463.968,83	-2.026.251,97	-23.360.304,38	-1,08%	-11,39%	1,71%	13,47%	-84,53%	3,20%
Novembro	185.463.968,83	4.213.606,95	2.832.364,58	189.012.662,39	2.167.451,19	-21.192.853,19	1,16%	-10,36%	1,41%	15,07%	-68,73%	2,32%

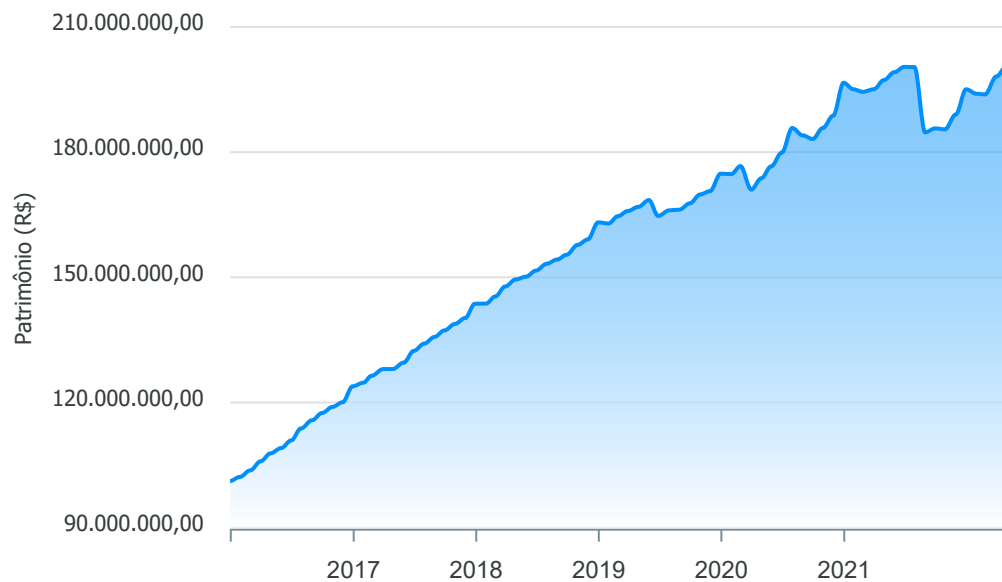
Investimentos x Meta de Rentabilidade



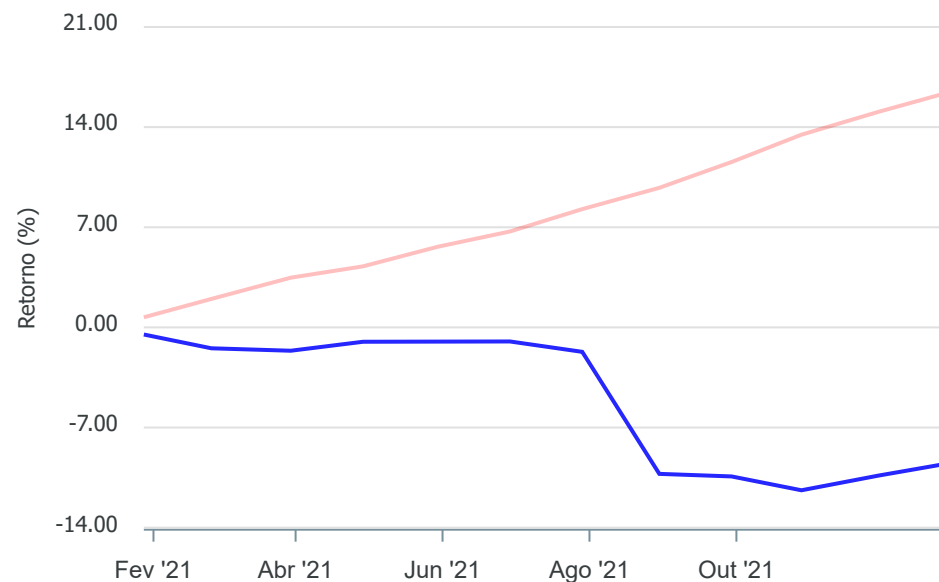
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



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

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Novembro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	168.614,33	0,00	0,00	176.097,58	7.483,25	4,44%	4,44%	6,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	8.680.891,92	0,00	80.000,00	8.977.921,97	377.030,05	4,34%	4,35%	6,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.377.913,28	0,00	0,00	2.459.721,80	81.808,52	3,44%	3,44%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.025.607,62	246.000,00	0,00	19.741.339,21	469.731,59	2,44%	2,47%	1,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	33.876.885,02	43.882,69	675.000,00	34.057.782,39	812.014,68	2,39%	2,42%	1,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.361.113,76	0,00	0,00	4.456.676,84	95.563,08	2,19%	2,19%	2,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	835.156,47	0,00	0,00	850.201,77	15.045,30	1,80%	1,80%	1,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	18.280.574,10	0,00	0,00	18.562.328,41	281.754,31	1,54%	1,54%	1,19%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	34.969.601,00	0,00	0,00	35.286.403,42	316.802,42	0,91%	0,91%	0,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.792.473,75	0,00	45.000,00	4.784.677,07	37.203,32	0,78%	0,78%	0,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	29.705,99	0,00	0,00	29.935,57	229,58	0,77%	0,77%	0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	119.415,84	0,00	120.290,71	874,87	0,73%	1,81%	1,83%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.463.301,37	0,00	0,00	5.497.302,32	34.000,95	0,62%	0,62%	0,06%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.816.953,51	875.000,00	0,00	6.727.793,63	35.840,12	0,54%	0,57%	0,00%
CAIXA FÁCIL FIC RENDA FIXA SIMPLES	46,92	0,00	47,05	0,00	0,13	0,28%	0,44%	0,00%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	13.874.301,94	0,00	0,00	13.884.699,70	10.397,76	0,07%	0,07%	1,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.063,82	2.034.577,35	2.032.317,53	4.223,96	900,32	0,04%	0,47%	0,00%
Total Renda Fixa	152.554.204,80	3.318.875,88	2.832.364,58	155.617.396,35	2.576.680,25	1,68%		1,24%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Novembro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.798.596,46	166.082,98	0,00	2.986.041,02	21.361,58	0,72%	0,77%	2,27%
BB JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	2.521.748,60	0,00	0,00	2.539.166,14	17.417,54	0,69%	0,69%	0,24%
CONQUEST FIP EMPRESAS EMERGENTES - FCCQ11	0,02	0,00	0,00	0,02	0,00	0,00%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.447.179,74	0,00	0,00	5.420.489,95	-26.689,79	-0,49%	-0,49%	7,09%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.607.813,64	728.648,09	0,00	3.309.146,63	-27.315,10	-0,82%	-0,52%	10,18%
AQ3 RENDA FII - ARFI11B	1.277.856,61	0,00	0,00	1.261.026,08	-16.830,53	-1,32%	0,00%	0,00%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.811.382,40	0,00	0,00	1.784.383,36	-26.999,04	-1,49%	-1,49%	9,51%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	1.311.822,31	0,00	0,00	1.282.442,37	-29.379,94	-2,24%	-2,24%	12,15%
BB ASG BRASIL FIC AÇÕES	735.121,34	0,00	0,00	718.143,29	-16.978,05	-2,31%	-2,31%	10,94%
CAIXA IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	691.402,87	0,00	0,00	669.155,02	-22.247,85	-3,22%	-3,22%	10,79%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	4.781.362,62	0,00	0,00	4.625.630,85	-155.731,77	-3,26%	-3,26%	10,49%
Total Renda Variável	23.984.286,61	894.731,07	0,00	24.595.624,73	-283.392,95	-1,14%		7,14%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Novembro / 2021)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.684.771,98	0,00	0,00	4.642.980,82	-41.791,16	-0,89%	-0,89%	9,33%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	2.714.687,43	0,00	0,00	2.665.730,94	-48.956,49	-1,80%	-1,80%	7,44%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	1.526.018,01	0,00	0,00	1.490.929,55	-35.088,46	-2,30%	-2,30%	4,84%
Total Exterior	8.925.477,42	0,00	0,00	8.799.641,31	-125.836,11	-1,41%		8,00%

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 nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.