

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,83%	4,97%	1,84%	3,05%	4,97%	14,02%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,65%	1,86%	3,18%	4,65%	12,93%	1,05%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,72%	4,66%	1,82%	3,05%	4,66%	13,07%	1,10%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,88%	2,93%	1,13%	2,10%	2,93%	6,88%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	2,70%	1,09%	1,99%	2,70%	6,43%	0,20%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,79%	4,57%	2,03%	3,24%	4,57%	12,97%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	4,31%	1,97%	3,12%	4,31%	12,39%	1,02%	0,03%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,75%	3,51%	1,82%	2,71%	3,51%	11,05%	1,06%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,22%	-1,26%	1,06%	-0,55%	-1,26%	5,06%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	-2,20%	2,04%	0,10%	-2,20%	1,53%	1,23%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,21%	-1,53%	1,00%	-0,70%	-1,53%	4,44%	2,16%	0,05%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,16%	-2,34%	0,83%	-0,99%	-2,34%	3,82%	2,09%	0,05%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,09%	-1,47%	0,38%	-0,61%	-1,47%	5,95%	2,27%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,75%	4,60%	1,89%	3,40%	4,60%	7,12%	0,04%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	4,34%	1,90%	3,14%	4,34%	6,90%	0,04%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,80%	4,62%	1,93%	3,26%	4,62%	7,13%	0,03%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	-0,01%	6,77%	1,82%	5,44%	6,77%	13,94%	0,90%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,46%	6,00%	2,19%	4,92%	6,00%	10,36%	0,21%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,73%	10,06%	2,96%	6,07%	10,06%	15,03%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,74%	0,70%	1,52%	-0,02%	0,70%	-	0,06%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,78%	-0,16%	1,52%	0,65%	-0,16%	4,50%	0,70%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	0,54%	1,40%	0,93%	0,54%	-	0,79%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,77%	3,23%	1,57%	2,40%	3,23%	6,02%	0,64%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,86%	4,53%	2,16%	3,49%	4,53%	7,52%	0,23%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,83%	-0,11%	1,07%	-0,82%	-0,11%	6,55%	0,23%	0,02%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	4,36%	26,89%	10,65%	10,91%	26,89%	47,52%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5,55%	32,74%	13,02%	14,31%	32,74%	49,91%	7,93%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,13%	-5,09%	-9,21%	-15,33%	-5,09%	7,63%	9,64%	0,14%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	3,41%	-6,84%	-6,92%	-14,76%	-6,84%	-7,42%	8,89%	0,17%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4,08%	-4,76%	-2,54%	-8,88%	-4,76%	0,93%	9,34%	0,16%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	3,51%	-10,06%	-10,01%	-21,42%	-10,06%	-12,83%	11,67%	0,18%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	-0,29%	-20,61%	-12,80%	-23,75%	-20,61%	-16,62%	9,02%	0,15%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9,61%	42,30%	-6,04%	-7,90%	42,30%	-	11,29%	0,26%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,90%	-	-2,74%	-3,82%	-	-	10,17%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	0,39%	-17,09%	-13,89%	-24,60%	-17,09%	-34,69%	9,18%	0,19%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,97%	-8,51%	-7,99%	-18,47%	-8,51%	-12,97%	6,70%	0,14%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,40%	-7,65%	-0,39%	-8,97%	-7,65%	-10,45%	7,89%	0,14%
ITAÚ PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	2,93%	-11,89%	-5,47%	-17,28%	-11,89%	-9,44%	9,11%	0,15%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2,02%	-16,53%	-8,86%	-21,30%	-16,53%	-14,74%	7,56%	0,15%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2,86%	-12,11%	-5,59%	-17,34%	-12,11%	-9,70%	8,95%	0,15%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5,78%	5,61%	-1,11%	-11,93%	5,61%	8,48%	8,04%	0,19%
CDI (Benchmark)	0,76%	4,40%	1,84%	3,09%	4,40%	7,28%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,27%	-0,83%	-0,10%	-3,05%	-0,83%	1,68%	2,65%	0,04%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	2,36%	0,91%	-0,98%	2,36%	5,50%	2,21%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,71%	33,65%	12,29%	21,44%	33,65%	105,84%	-	-
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4,58%	20,60%	8,21%	7,41%	20,60%	-	6,94%	0,10%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	3,45%	33,92%	12,50%	21,19%	33,92%	93,45%	8,58%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	2,85%	-11,93%	-5,55%	-17,33%	-11,93%	-9,36%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,13%	-5,09%	-9,21%	-15,33%	-5,09%	7,63%	9,64%	0,14%

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.