

## Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2022



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

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2022)

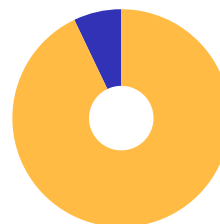
| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência      | Saldo        | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento                       |
|---|------------|---------------|--------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1        | Não há        | 5.326.532,10 | 9,81%              | 1.061    | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1        | Não há        | 1.431.047,44 | 2,63%              | 810      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2        | Não há        | 1.793.560,76 | 3,30%              | 229      | 0,23%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1        | Não há        | 1.986.514,65 | 3,66%              | 600      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0        | Não há        | 1.695.481,69 | 3,12%              | 1.084    | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1        | Não há        | 1.930.341,45 | 3,55%              | 469      | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | D+0        | 2024-08-15    | 1.543.094,97 | 2,84%              | 144      | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 2.394.272,53 | 4,41%              | 1.031    | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0        | Não há        | 4.076.607,57 | 7,51%              | 273      | 0,32%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA... | D+0        | Não há        | 2.002.773,45 | 3,69%              | 170      | 0,32%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 3.790.677,63 | 6,98%              | 1.185    | 0,07%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0        | Não há        | 6.202.443,87 | 11,42%             | 210      | 0,76%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0        | Não há        | 4.571.608,73 | 8,42%              | 958      | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR... | D+0        | Não há        | 4.469.982,56 | 8,23%              | 210      | 0,16%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM... | D+0        | Não há        | 5.226.433,69 | 9,62%              | 269      | 0,23%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F... | D+1        | Não há        | 1.152.730,18 | 2,12%              | 247      | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA     | D+1800     | Não há        | 404.655,43   | 0,75%              | 18       | 0,56%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA                             | D+31 ou... | Não há        | 405.788,11   | 0,75%              | 15       | 0,64%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                               | Não se ... | Não se aplica | 55.993,85    | 0,10%              | 98       | 0,18%            | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                        | D+4        | Não há        | 1.726.066,81 | 3,18%              | 95       | 0,21%            | Artigo 8º, Inciso I                 |

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2022)

| Produto / Fundo                                    | Resgate | Carência | Saldo                | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento       |
|--|---------|----------|----------------------|--------------------|----------|------------------|---------------------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                             | D+24    | Não há   | 1.030.384,52         | 1,90%              | 28.215   | 0,04%            | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES               | D+24    | Não há   | 1.096.257,90         | 2,02%              | 103      | 0,16%            | Artigo 8º, Inciso I |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b> |         |          | <b>54.313.249,89</b> |                    |          |                  |                     |

**Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 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%                         | 1,80%         | 30,00%         | 16.293.974,97 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 100,00%        | 34.173.348,11        | 62,92%        | 0,00%                         | 52,00%        | 90,00%         | 14.708.576,79 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00%         | 16.231.198,70        | 29,88%        | 7,00%                         | 20,00%        | 60,00%         | 16.356.751,23 |
| Artigo 7º, Inciso IV                | 20,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 2,00%          | 1.086.265,00  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '   | 5,00%          | 55.993,85            | 0,10%         | 0,00%                         | 0,20%         | 1,00%          | 487.138,65    |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '   | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 2.715.662,49  |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>50.460.540,66</b> | <b>92,91%</b> | <b>7,00%</b>                  | <b>75,00%</b> | <b>188,00%</b> |               |

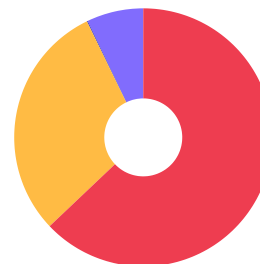


RENDA FIXA 50.460.540,66  
RENDA VARIÁVEL 3.852.709,23

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

| Artigos - Renda Variável / Estruturado    | Resolução     | Carteira \$         | Carteira     | Estratégia de Alocação - 2022 |               |               | GAP Superior  |
|---|---------------|---------------------|--------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
|   |               |                     |              | Inf                           | Alvo          | Sup           |               |
| Artigo 8º, Inciso I                       | 30,00%        | 3.852.709,23        | 7,09%        | 5,00%                         | 15,00%        | 30,00%        | 12.441.265,74 |
| Artigo 10º, Inciso I                      | 10,00%        | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 5,00%         | 10,00%        | 5.431.324,99  |
| <b>Total Renda Variável / Estruturado</b> | <b>30,00%</b> | <b>3.852.709,23</b> | <b>7,09%</b> | <b>5,00%</b>                  | <b>20,00%</b> | <b>40,00%</b> |               |

| Artigos - Exterior    | Resolução     | Carteira \$ | Carteira     | Estratégia de Alocação - Limite - 2022 |              |               | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|-------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
|                       |               |             |              | Inferior                               | Alvo         | Superior      |              |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 5,00%        | 10,00%        | 5.431.324,99 |
| <b>Total Exterior</b> | <b>10,00%</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00%</b> | <b>0,00%</b>                           | <b>5,00%</b> | <b>10,00%</b> |              |



7º I b   7º III a   7º V a   8º I

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

| Gestão                     | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM                 | 29.889.258,11 | 55,03         | -              |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 20.278.181,79 | 37,34         | 0,00           |
| ITAÚ ASSET MANAGEMENT      | 1.152.730,18  | 2,12          | -              |
| ITAÚ UNIBANCO              | 1.096.257,90  | 2,02          | 0,00           |
| ITAÚ DTVM                  | 1.030.384,52  | 1,90          | 0,00           |
| VERITAS CAPITAL MANAGEMENT | 810.443,54    | 1,49          | 0,03           |
| PETRA CAPITAL              | 55.993,85     | 0,10          | 0,01           |

**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 % |                     |                     |

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

|   | Mês    | Ano     | 3M     | 6M      | 12M     | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                       | 0,85%  | 6,35%   | 4,97%  | 7,23%   | 9,24%   | 18,49%  | -       | -                |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,78%  | 6,17%   | 4,95%  | 6,92%   | 9,45%   | 17,95%  | 1,16%   | 0,04%            |
| <b>IMA Geral (Benchmark)</b>                              | 0,92%  | 4,04%   | 3,06%  | 4,94%   | 5,26%   | 9,68%   | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP  | 0,91%  | 3,79%   | 3,01%  | 4,76%   | 4,92%   | 8,40%   | 1,03%   | 0,03%            |
| <b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>                               | 0,39%  | 0,65%   | 0,67%  | 2,95%   | -0,89%  | -1,17%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 0,37%  | 0,57%   | 0,66%  | 2,85%   | -1,22%  | -1,68%  | 2,20%   | 0,05%            |
| <b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>                               | 1,16%  | 3,17%   | 4,84%  | 2,82%   | -0,25%  | 10,41%  | -       | -                |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,11%  | 2,99%   | 4,72%  | 2,65%   | -0,64%  | 9,58%   | 3,57%   | 0,08%            |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 1,14%  | 3,08%   | 4,75%  | 2,73%   | -0,76%  | 9,69%   | 3,60%   | 0,08%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                | 0,95%  | 4,02%   | 2,61%  | 4,93%   | 6,43%   | 8,67%   | -       | -                |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,92%  | 3,90%   | 2,51%  | 4,78%   | 6,14%   | 7,98%   | 0,20%   | 0,01%            |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 0,93%  | 3,91%   | 2,54%  | 4,79%   | 6,18%   | 8,19%   | 0,20%   | 0,01%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                | 0,78%  | 6,25%   | 5,02%  | 7,09%   | 9,55%   | 17,65%  | -       | -                |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA           | -3,34% | -22,19% | -7,46% | -22,13% | -56,82% | -63,49% | 4,78%   | 0,43%            |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 0,89%  | -       | 4,86%  | -       | -       | -       | 1,28%   | -                |

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

|  | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M   | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP            | 0,77% | 6,14% | 4,95% | 6,94% | 9,19% | 16,95% | 1,04%   | 0,04%            |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,77% | 6,16% | 4,96% | 6,97% | 9,31% | 17,06% | 1,03%   | 0,04%            |

|  |        |        |       |       |         |         |       |       |
|--|--------|--------|-------|-------|---------|---------|-------|-------|
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>                               | 0,96%  | 4,73%  | 4,93% | 4,96% | 4,59%   | 14,18%  | -     | -     |
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA                                | -1,01% | -0,39% | 1,96% | 0,34% | -22,45% | -63,84% | 3,76% | 0,15% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,96%  | 4,58%  | 4,83% | 4,80% | 4,24%   | 13,52%  | 2,15% | 0,06% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 1,00%  | 4,58%  | 4,88% | 4,81% | 4,32%   | 13,57%  | 2,25% | 0,06% |

|  |       |       |       |       |       |       |       |       |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                               | 0,58% | 1,82% | 1,31% | 3,74% | 1,60% | 2,33% | -     | -     |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,58% | 1,77% | 1,32% | 3,68% | 1,34% | 1,86% | 1,52% | 0,04% |

|  |         |         |         |         |         |         |        |       |
|--|---------|---------|---------|---------|---------|---------|--------|-------|
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                     | 1,03%   | 4,34%   | 2,81%   | 5,14%   | 7,89%   | 10,24%  | -      | -     |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                                      | -58,66% | -58,85% | -58,71% | -58,97% | -59,61% | -62,62% | 93,04% | 0,58% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 1,07%   | 4,47%   | 2,84%   | 5,31%   | 8,23%   | 10,70%  | 0,02%  | 0,01% |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO   | 1,01%   | 4,24%   | 2,76%   | 5,02%   | 7,68%   | 9,68%   | 0,01%  | 0,01% |

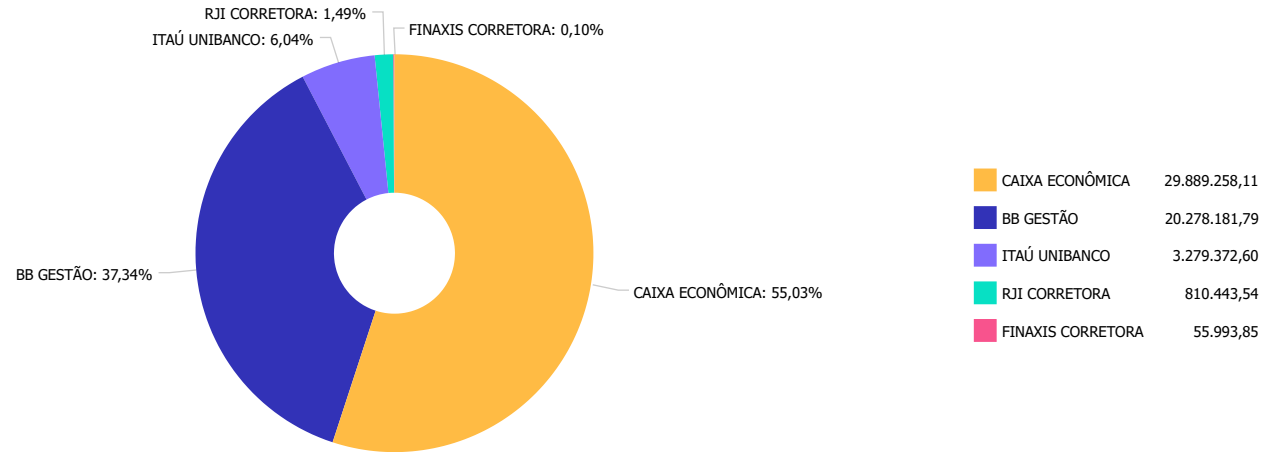
|   |       |       |       |       |        |        |       |       |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                             | 0,47% | 4,78% | 3,18% | 5,55% | 11,73% | 20,73% | -     | -     |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 0,99% | 4,46% | 2,96% | 5,35% | 8,41%  | 10,30% | 0,11% | 0,02% |



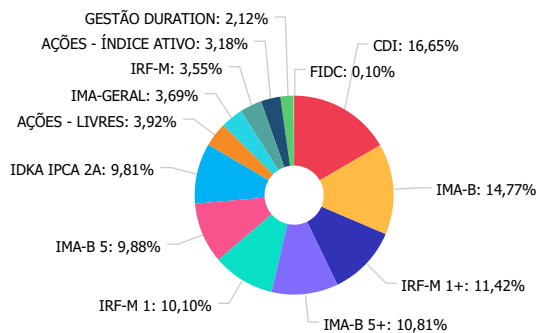
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2022 - RENDA VARIÁVEL

|                                      | Mês   | Ano    | 3M     | 6M     | 12M     | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--------------------------------------|-------|--------|--------|--------|---------|--------|---------|------------------|
| IBX-50 (Benchmark)                   | 3,30% | 6,74%  | -2,55% | 10,76% | -11,91% | 31,55% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FIAÇÕES          | 1,19% | 6,70%  | -2,16% | 10,78% | -13,21% | 28,94% | 10,53%  | 0,18%            |
| Ibovespa (Benchmark)                 | 3,22% | 6,23%  | -1,58% | 9,26%  | -11,78% | 27,40% | -       | -                |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES | 0,02% | -0,28% | -4,82% | 0,12%  | -23,71% | 2,12%  | 9,85%   | 0,19%            |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES               | 3,78% | 2,73%  | 2,61%  | 3,73%  | -16,42% | 25,66% | 9,36%   | 0,14%            |

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



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

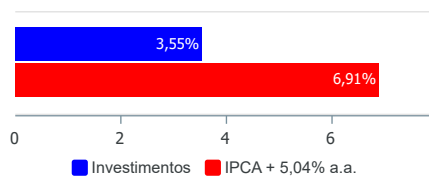


|           |              |         |              |                      |              |                 |              |
|-----------|--------------|---------|--------------|----------------------|--------------|-----------------|--------------|
| CDI       | 9.041.591,29 | IMA-B   | 8.023.391,88 | IRF-M 1+             | 6.202.443,87 | IMA-B 5+        | 5.870.168,33 |
| IRF-M 1   | 5.486.159,32 | IMA-B 5 | 5.368.414,94 | IDKA IPCA 2A         | 5.326.532,10 | AÇÕES - LIVRES  | 2.126.642,42 |
| IMA-GERAL | 2.002.773,45 | IRF-M   | 1.930.341,45 | AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 1.726.066,81 | GESTÃO DURATION | 1.152.730,18 |
| FIDC      | 55.993,85    |         |              |                      |              |                 |              |

**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   | 50.306.295,53  | 2.430.000,00 | 1.500.000,00 | 51.352.049,22 | 115.753,69   | 115.753,69   | 0,23%       | 0,23%        | 0,95%    | 0,95%     | 23,71%   | 2,05% |
| Fevereiro | 51.352.049,22  | 1.125.000,00 | 888.832,26   | 51.812.982,42 | 224.765,46   | 340.519,15   | 0,44%       | 0,66%        | 1,39%    | 2,35%     | 28,18%   | 1,86% |
| Março     | 51.812.982,42  | 1.180.000,00 | 878.649,47   | 53.238.522,07 | 1.124.189,12 | 1.464.708,27 | 2,16%       | 2,83%        | 2,06%    | 4,46%     | 63,59%   | 2,56% |
| Abril     | 53.238.522,07  | 1.371.364,69 | 940.000,00   | 53.650.119,17 | -19.767,59   | 1.444.940,68 | -0,04%      | 2,80%        | 1,44%    | 5,96%     | 46,95%   | 1,95% |
| Maior     | 53.650.119,17  | 1.225.000,00 | 958.034,53   | 54.313.249,89 | 396.165,25   | 1.841.105,93 | 0,73%       | 3,55%        | 0,90%    | 6,91%     | 51,38%   | 2,15% |

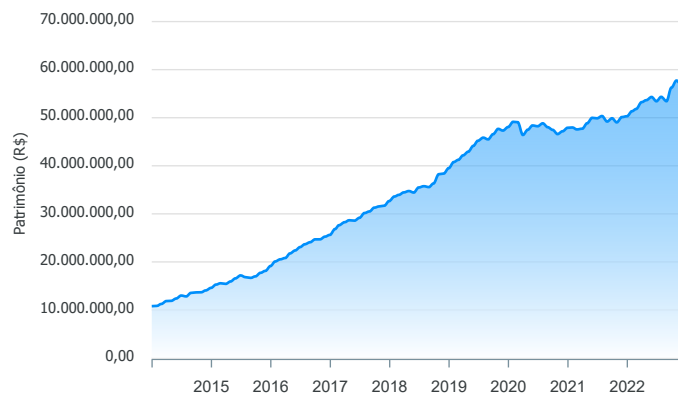
Investimentos x Meta de Rentabilidade



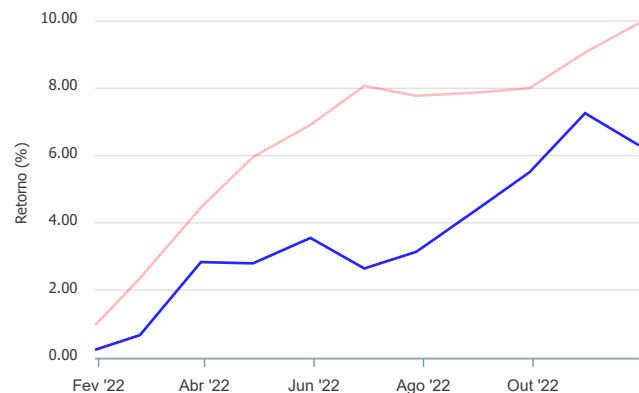
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior       | Aplicações          | Resgates          | Saldo Atual          | Retorno (R\$)     | Retorno (%)  | (%) Instit | Var - Mês    |
|---|----------------------|---------------------|-------------------|----------------------|-------------------|--------------|------------|--------------|
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA                               | 409.922,42           | 0,00                | 9.568,19          | 405.788,11           | 5.433,88          | 1,33%        | -1,01%     | 3,76%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 4.030.803,46         | 0,00                | 0,00              | 4.076.607,57         | 45.804,11         | 1,14%        | 1,14%      | 3,60%        |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 1.773.878,25         | 0,00                | 0,00              | 1.793.560,76         | 19.682,51         | 1,11%        | 1,11%      | 3,57%        |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 4.523.381,49         | 0,00                | 0,00              | 4.571.608,73         | 48.227,24         | 1,07%        | 1,07%      | 0,02%        |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-... | 5.174.637,72         | 0,00                | 0,00              | 5.226.433,69         | 51.795,97         | 1,00%        | 1,00%      | 2,25%        |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX... | 1.141.449,33         | 0,00                | 0,00              | 1.152.730,18         | 11.280,85         | 0,99%        | 0,99%      | 0,11%        |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 1.967.635,83         | 0,00                | 0,00              | 1.986.514,65         | 18.878,82         | 0,96%        | 0,96%      | 2,15%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 3.755.820,41         | 0,00                | 0,00              | 3.790.677,63         | 34.857,22         | 0,93%        | 0,93%      | 0,20%        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 1.679.998,92         | 0,00                | 0,00              | 1.695.481,69         | 15.482,77         | 0,92%        | 0,92%      | 0,20%        |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | 1.984.688,22         | 0,00                | 0,00              | 2.002.773,45         | 18.085,23         | 0,91%        | 0,91%      | 1,03%        |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | 1.529.535,96         | 0,00                | 0,00              | 1.543.094,97         | 13.559,01         | 0,89%        | 0,89%      | 1,28%        |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 5.285.569,07         | 0,00                | 0,00              | 5.326.532,10         | 40.963,03         | 0,77%        | 0,77%      | 1,16%        |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 1.420.114,17         | 0,00                | 0,00              | 1.431.047,44         | 10.933,27         | 0,77%        | 0,77%      | 1,04%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.376.103,86         | 0,00                | 0,00              | 2.394.272,53         | 18.168,67         | 0,76%        | 0,76%      | 1,03%        |
| CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO... | 4.149.071,71         | 1.225.000,00        | 940.000,00        | 4.469.982,56         | 35.910,85         | 0,67%        | 1,01%      | 0,01%        |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 1.919.289,71         | 0,00                | 0,00              | 1.930.341,45         | 11.051,74         | 0,58%        | 0,58%      | 1,52%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 6.179.396,54         | 0,00                | 0,00              | 6.202.443,87         | 23.047,33         | 0,37%        | 0,37%      | 2,20%        |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA       | 418.649,25           | 0,00                | 8.466,34          | 404.655,43           | -5.527,48         | -1,32%       | -3,34%     | 4,78%        |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR 1                                 | 135.449,22           | 0,00                | 0,00              | 55.993,85            | -79.455,37        | -58,66%      | -58,66%    | 93,04%       |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>49.855.395,54</b> | <b>1.225.000,00</b> | <b>958.034,53</b> | <b>50.460.540,66</b> | <b>338.179,65</b> | <b>0,67%</b> |            | <b>1,54%</b> |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário | Saldo Anterior      | Aplicações  | Resgates    | Saldo Atual         | Retorno (R\$)    | Retorno (%)  | (%) Instit | Var - Mês     |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|------------------|--------------|------------|---------------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                         | 992.881,40          | 0,00        | 0,00        | 1.030.384,52        | 37.503,12        | 3,78%        | 3,78%      | 9,36%         |
| CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES                   | 1.705.780,33        | 0,00        | 0,00        | 1.726.066,81        | 20.286,48        | 1,19%        | 1,19%      | 10,53%        |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES           | 1.096.061,90        | 0,00        | 0,00        | 1.096.257,90        | 196,00           | 0,02%        | 0,02%      | 9,85%         |
| <b>Total Renda Variável</b>                    | <b>3.794.723,63</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>3.852.709,23</b> | <b>57.985,60</b> | <b>1,53%</b> |            | <b>10,02%</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 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.



