

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

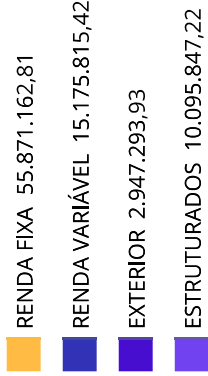
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.137.571,90	6,11%	987	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.360.674,49	1,62%	780	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	424.070,16	0,50%	1.114	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	39.319,30	0,05%	324	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.056.650,42	1,26%	810	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.440.212,62	1,71%	963	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	923.661,15	1,10%	739	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	656.548,88	0,78%	1.180	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	9.294.786,72	11,05%	2.714	5,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	6.056.754,49	7,20%	75	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea b
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.073.086,41	8,41%	895	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	610.540,71	0,73%	213	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.643.007,37	1,95%	87	0,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	903.679,90	1,07%	77	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	11.799.986,13	14,03%	233	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	7.450.612,16	8,86%	197	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.963.259,61	3,52%	3.851	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.483.712,95	4,14%	1.739	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+24	Não há	3.651.721,98	4,34%	21.707	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.978.918,56	2,35%	3.026	1,64%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	3.098.202,32	3,68%	32	0,31%	Artigo 8º, Inciso I
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	2.947.293,93	3,50%	39	0,49%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.159.536,51	3,76%	7.159	0,16%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.024.923,94	3,60%	125	0,40%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.652.006,93	1,96%	3.362	0,11%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.259.379,84	2,69%	7.148	0,29%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			84.090.119,38				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			115.761,07				Artigo 6º
PL Total			84.205.880,45				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Dezembro / 2022)

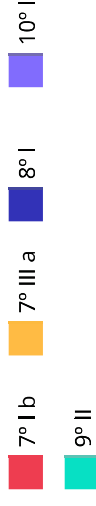
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alinea a	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,75%	59,24%	49.814.986,72
Artigo 7º, Inciso I, Alinea b	100,00%	26.390.250,13	31,38%	14,81%	18,75%	59,24%	23.424.736,59
Artigo 7º, Inciso III, Alinea a	70,00%	29.480.912,68	35,06%	13,13%	17,50%	60,00%	20.973.158,95
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	17,50%	20,00%	16.818.023,88
Artigo 7º, Inciso V, Alinea b	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	10,00%	8.409.011,94
Total Renda Fixa	100,00%	55.871.162,81	66,44%	27,94%	75,28%	208,48%	



ⓘ ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.963/2021 em seus Artigo 7º § 7º e Artigo 8º § 3º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2022)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	15.175.815,42	18,05%	11,21%	12,70%	30,00%	10.051.220,39
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,24%	30,00%	25.227.035,81
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.095.847,22	12,01%	2,09%	2,78%	10,00%	-1.686.835,28
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	25.271.662,64	30,05%	13,30%	17,72%	70,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	2.947.293,93	3,50%	1,88%	2,50%	10,00%	5.461.718,01
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	1,88%	2,50%	10,00%	8.409.011,94
Total Exterior	10,00%	2.947.293,93	3,50%	3,76%	5,00%	20,00%	

Empréstimo Consignado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 12º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	8.409.011,94

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea a	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alinea b	26.350.930,83	31,34	14,81	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alinea a	16.777.246,65	19,95	13,13	60,00
Artigo 7º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso V, Alinea b	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	15.175.815,42	18,05	11,21	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	2.947.293,93	3,50	1,88	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	1,88	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.095.847,22	12,01	2,09	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	29.862.754,66	35,51	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.036.950,55	25,02	-
CAIXA DTVM	14.212.239,59	16,90	0,07
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	9.294.786,72	11,05	0,08
TRÍGONO CAPITAL	3.098.202,32	3,68	0,07
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.963.259,61	3,52	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.978.918,56	2,35	0,00
BANCO BRADESCO	1.643.007,37	1,95	-

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,24%	9,34%	2,25%	2,34%	9,34%	14,78%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	9,04%	2,36%	2,47%	9,04%	14,12%	1,30%	3,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	9,32%	2,42%	2,69%	9,32%	14,40%	1,21%	3,31%

IRF-M 1 (Benchmark)	1,18%	12,02%	3,16%	6,70%	12,02%	15,30%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	11,74%	3,09%	6,56%	11,74%	14,76%	0,08%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	11,73%	3,09%	6,56%	11,73%	14,68%	0,08%	0,63%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,94%	9,78%	2,53%	2,98%	9,78%	14,79%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	9,51%	2,44%	2,86%	9,51%	14,19%	1,14%	3,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,93%	9,60%	2,49%	2,90%	9,60%	14,37%	1,14%	3,05%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,86%	9,16%	2,35%	2,91%	9,16%	12,98%	1,15%	2,82%

IMA-B (Benchmark)	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,27%	5,95%	0,03%	1,67%	5,95%	3,48%	2,42%	4,11%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,24%	6,06%	0,17%	1,72%	6,06%	4,49%	2,46%	4,08%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,25%	4,94%	-0,49%	0,73%	4,94%	3,40%	2,58%	4,87%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,24%	6,20%	0,10%	1,87%	6,20%	4,57%	2,52%	4,11%

CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
-----------------	-------	--------	-------	-------	--------	--------	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,96%	10,58%	2,76%	5,72%	10,58%	14,21%	0,00%	0,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,15%	11,81%	2,65%	5,57%	11,81%	18,52%	0,16%	0,96%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,03%	11,26%	2,95%	6,09%	11,26%	14,90%	0,00%	0,48%
IPCA (Benchmark)	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	-0,37%	7,83%	-0,53%	2,43%	7,83%	12,71%	1,53%	2,39%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14%	10,70%	2,23%	5,84%	10,70%	10,58%	0,37%	1,36%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,67%	13,75%	2,06%	8,76%	13,75%	16,43%	1,71%	4,19%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,10%	10,95%	1,68%	6,67%	10,95%	12,55%	2,24%	3,76%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,14%	12,03%	1,54%	8,38%	12,03%	11,10%	2,74%	6,60%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,16%	13,45%	2,91%	6,55%	13,45%	18,12%	0,22%	0,62%

Ibovespa (Benchmark)	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%	-	-
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1,80%	5,16%	3,00%	15,16%	5,16%	-3,78%	10,24%	22,76%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,48%	-3,47%	-1,99%	5,53%	-3,47%	-8,07%	9,73%	18,97%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,32%	5,38%	2,63%	14,39%	5,38%	49,95%	9,87%	22,55%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,80%	11,58%	2,72%	7,46%	11,58%	3,55%	8,38%	18,06%

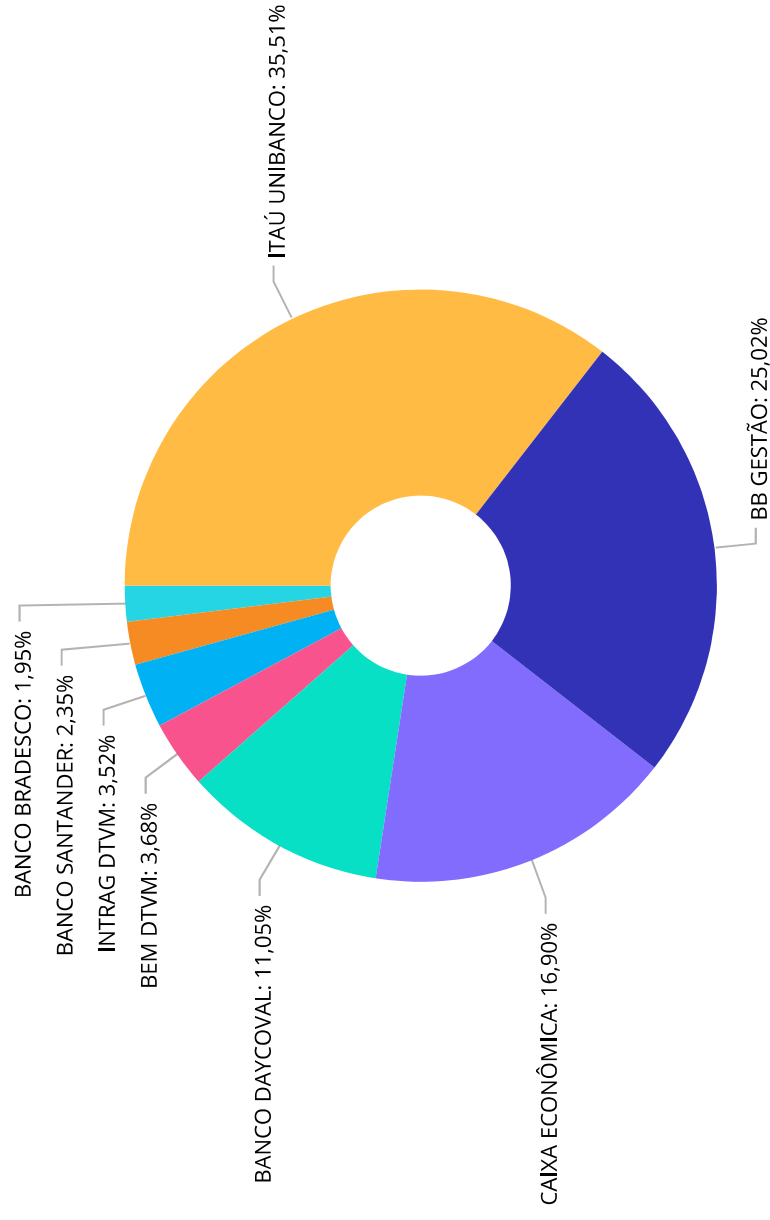
SMLL (Benchmark)	-3,01%	-15,06%	-7,61%	5,76%	-15,06%	-28,82%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,80%	-8,69%	-3,58%	3,72%	-8,69%	-17,52%	8,16%	21,53%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,72%	-24,70%	5,60%	1,82%	-24,70%	-2,86%	-	-
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-0,13%	-21,08%	8,39%	4,43%	-21,08%	3,29%	11,28%	16,415%



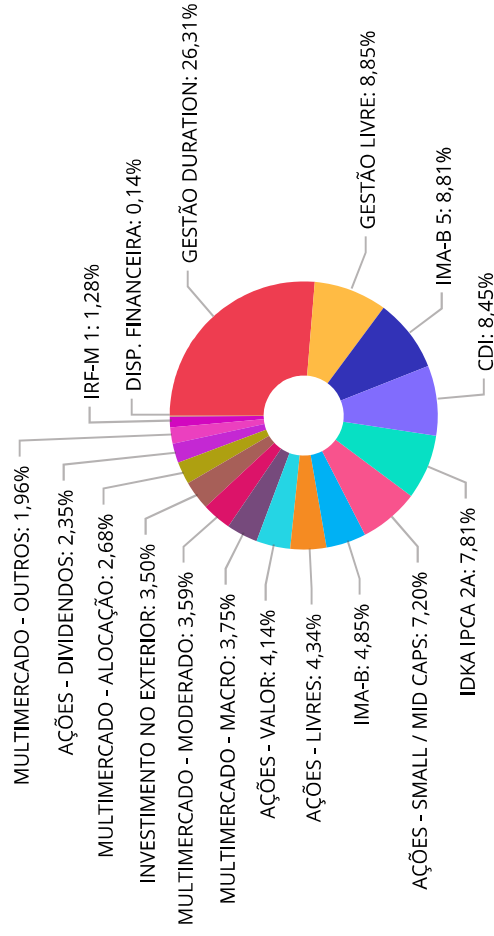
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Dezembro / 2022)



ITAÚ UNIBANCO	29.862.754,66
BB GESTÃO	21.036.950,55
CAIXA ECONÔMICA	14.212.239,59
BANCO DAYCOVAL	9.294.786,72
BEM DTVM	3.098.202,32
INTRAG DTVM	2.963.259,61
BANCO SANTANDER	1.978.918,56
BANCO BRADESCO	1.643.007,37



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



GESTÃO DURATION	22.151.423,27	GESTÃO LIVRE	7.450.612,16	IMA-B 5	7.417.428,98	CDI	7.112.405,71
IDKA IPCA 2A	6.577.784,52	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.061.461,93	IMA-B	4.080.889,13	AÇÕES - LIVRES	3.651.721,98
AÇÕES - VALOR	3.483.712,95	MULTIMERCADO - MACRO	3.159.536,51	MULTIMERCADO - MODERADO	3.024.923,94	INVESTIMENTO NO EXTERIOR	2.947.293,93
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.259.379,84	AÇÕES - DIVIDENDOS	1.978.918,56	MULTIMERCADO - OUTROS	1.652.006,93	IRF-M 1	1.080.619,04
DISP. FINANCEIRA	115.761,07						

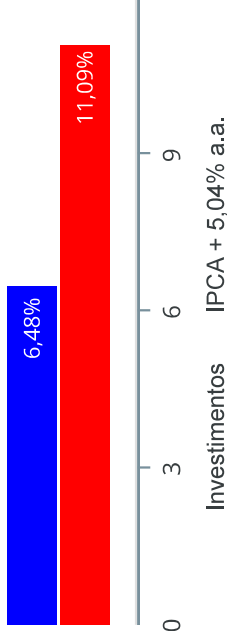
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

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	78.008.034,28	930.915,35	1.897.290,70	77.052.157,80	10.498,87	10.498,87	0,01%	0,01%	0,95%	0,95%	1,41%	2,81%
Fevereiro	77.052.157,80	2.539.897,05	2.379.999,29	77.414.430,64	202.375,08	212.873,95	0,26%	0,28%	1,39%	2,35%	11,72%	2,39%
Março	77.414.430,64	1.648.730,84	1.492.970,32	79.368.951,22	1.798.760,06	2.011.634,01	2,32%	2,60%	2,06%	4,46%	58,36%	3,10%
Abril	79.368.951,22	1.701.021,42	1.339.466,94	79.510.827,55	-219.678,15	1.791.955,86	-0,28%	2,32%	1,44%	5,96%	38,92%	2,35%
Mai	79.510.827,55	13.418.086,98	12.773.259,92	81.059.626,32	903.971,71	2.695.927,57	1,13%	3,47%	0,90%	6,91%	50,23%	2,94%
Junho	81.059.626,32	1.642.391,84	1.976.022,20	79.117.801,52	-1.608.194,44	1.087.733,13	-1,98%	1,42%	1,08%	8,07%	17,59%	2,71%
Julho	79.117.801,52	1.620.509,78	1.623.868,60	80.135.963,13	1.021.520,43	2.109.253,56	1,29%	2,73%	-0,27%	7,78%	35,09%	2,50%
Agosto	80.135.963,13	1.367.826,64	86.750,00	82.785.462,77	1.368.423,00	3.477.676,56	1,68%	4,46%	0,09%	7,87%	56,60%	2,91%
Setembro	82.785.462,77	1.493.416,06	1.378.999,67	83.104.752,61	204.873,45	3.682.550,01	0,25%	4,71%	0,12%	8,00%	58,92%	3,10%
Outubro	83.104.752,61	1.437.212,15	1.306.847,80	85.235.174,80	2.000.057,84	5.682.607,85	2,40%	7,23%	0,98%	9,06%	79,78%	3,76%
Novembro	85.235.174,80	2.572.171,28	2.842.911,71	84.108.567,85	-855.866,52	4.826.741,33	-1,00%	6,15%	0,80%	9,94%	61,92%	4,63%
Dezembro	84.108.567,85	4.556.223,45	4.835.157,23	84.090.119,38	260.485,31	5.087.226,64	0,31%	6,48%	1,05%	11,09%	58,42%	2,99%

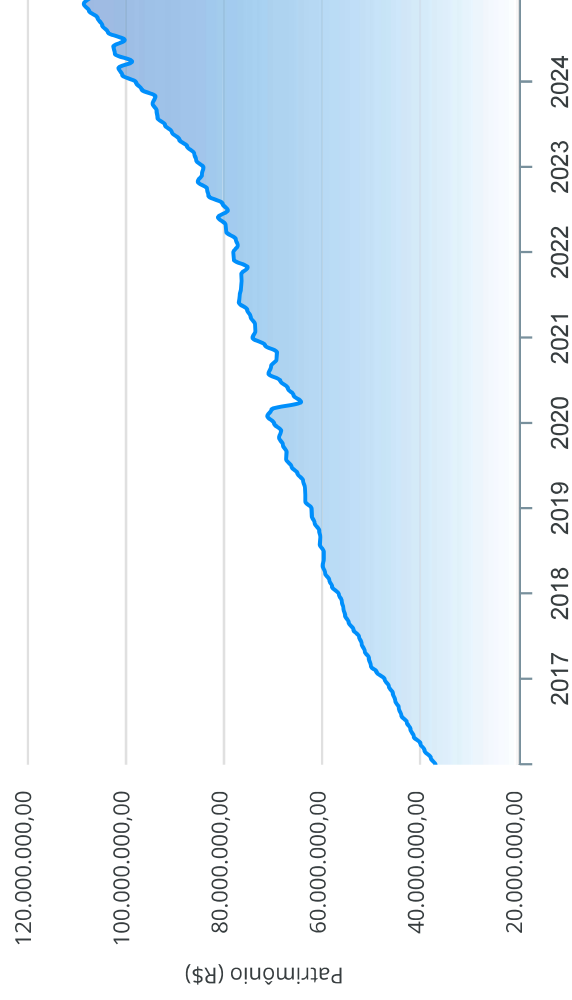
Investimentos x Meta de Rentabilidade





Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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 Dezembro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.075.718,32	0,00	0,00	5.137.571,90	61.853,58	1,22%	1,22%	1,21%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	419.219,46	0,00	0,00	424.070,16	4.850,70	1,16%	1,16%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	7.366.154,16	0,00	0,00	7.450.612,16	84.458,00	1,15%	1,15%	0,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.044.747,91	0,00	0,00	1.056.650,42	11.902,51	1,14%	1,14%	0,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	556.347,87	93.656,73	0,00	656.548,88	6.544,28	1,01%	1,15%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	6.001.264,45	0,00	0,00	6.056.754,49	55.490,04	0,92%	0,92%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.348.353,79	0,00	0,00	1.360.674,49	12.320,70	0,91%	0,91%	1,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	6.301.860,84	1.701.683,65	1.000.019,61	7.073.086,41	69.561,53	0,87%	1,03%	0,00%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.215.208,20	0,00	0,00	9.294.786,72	79.578,52	0,86%	0,86%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.077.628,75	0,00	655.000,00	1.440.212,62	17.583,87	0,85%	1,23%	1,30%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.097.792,72	1.113.883,07	3.180.137,62	39.319,30	7.781,13	0,24%	0,96%	0,00%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	611.990,12	0,00	0,00	610.540,71	-1.449,41	-0,24%	-0,24%	2,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	925.854,06	0,00	0,00	923.661,15	-2.192,91	-0,24%	-0,24%	2,52%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	905.912,03	0,00	0,00	903.679,90	-2.232,13	-0,25%	-0,25%	2,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.647.401,07	0,00	0,00	1.643.007,37	-4.393,70	-0,27%	-0,27%	2,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	11.843.782,67	0,00	0,00	11.799.986,13	-43.796,54	-0,37%	-0,37%	1,53%
Total Renda Fixa	57.439.236,42	2.909.223,45	4.835.157,23	55.871.162,81	357.860,17	0,62%		1,02%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.587.193,15	0,00	0,00	3.651.721,98	64.528,83	1,80%	1,80%	10,24%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.125.226,75	0,00	0,00	3.159.536,51	34.309,76	1,10%	1,10%	2,24%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.004.761,42	0,00	0,00	3.024.923,94	20.162,52	0,67%	0,67%	1,71%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.647.000,00	0,00	1.652.006,93	5.006,93	0,30%	1,16%	0,22%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.256.265,69	0,00	0,00	2.259.379,84	3.114,15	0,14%	0,14%	2,74%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	3.139.722,52	0,00	0,00	3.098.202,32	-41.520,20	-1,32%	-1,27%	9,87%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.015.109,09	0,00	0,00	1.978.918,56	-36.190,53	-1,80%	-1,80%	8,38%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.017.678,13	0,00	0,00	2.963.259,61	-54.418,52	-1,80%	-1,80%	8,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.572.148,27	0,00	0,00	3.483.712,95	-88.435,32	-2,48%	-2,48%	9,73%
Total Renda Variável	23.718.105,02	1.647.000,00	0,00	25.271.662,64	-93.442,38	-0,37%		6,39%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.951.226,41	0,00	0,00	2.947.293,93	-3.932,48	-0,13%	-0,13%	11,28%
Total Exterior	2.951.226,41	0,00	0,00	2.947.293,93	-3.932,48	-0,13%		11,28%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	9.081.844,31	0,00	0,00	9.294.786,72	212.942,41	2,34%	2,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.480.578,31	4.159.198,73	4.765.484,71	7.073.086,41	198.794,08	1,71%	2,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	6.312.037,35	958.595,29	0,00	7.450.612,16	179.979,52	2,48%	2,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	5.909.893,06	0,00	0,00	6.056.754,49	146.861,43	2,49%	2,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.016.095,94	0,00	0,00	5.137.571,90	121.475,96	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.054.782,54	0,00	655.000,00	1.440.212,62	40.430,08	1,97%	2,36%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	1.536.744,20	1.647.515,40	3.183.940,19	39.319,30	38.999,89	1,22%	2,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.328.226,97	0,00	0,00	1.360.674,49	32.447,52	2,44%	2,44%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.033.646,99	0,00	0,00	1.056.650,42	23.003,43	2,23%	2,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	784.746,39	0,00	380.491,84	424.070,16	19.815,61	2,53%	3,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	486.783,74	153.297,46	0,00	656.548,88	16.467,68	2,57%	3,09%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	609.491,65	0,00	0,00	610.540,71	1.049,06	0,17%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	922.719,33	0,00	0,00	923.661,15	941,82	0,10%	0,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.642.490,06	0,00	0,00	1.643.007,37	517,31	0,03%	0,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	908.089,03	0,00	0,00	903.679,90	-4.409,13	-0,49%	-0,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	11.862.768,65	0,00	0,00	11.799.986,13	-62.782,52	-0,53%	-0,53%
Total Renda Fixa	56.970.938,52	6.918.606,88	8.984.916,74	55.871.162,81	966.534,15	1,51%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.545.373,10	0,00	0,00	3.651.721,98	106.348,88	3,00%	3,00%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	3.018.803,26	0,00	0,00	3.098.202,32	79.399,06	2,63%	2,63%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.964.008,37	0,00	0,00	3.024.923,94	60.915,57	2,06%	2,06%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.926.532,68	0,00	0,00	1.978.918,56	52.385,88	2,72%	2,72%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.107.234,04	0,00	0,00	3.159.536,51	52.302,47	1,68%	1,68%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.225.021,74	0,00	0,00	2.259.379,84	34.358,10	1,54%	1,54%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.647.000,00	0,00	1.652.006,93	5.006,93	0,30%	2,90%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.554.392,00	0,00	0,00	3.483.712,95	-70.679,05	-1,99%	-1,99%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.073.350,11	0,00	0,00	2.963.259,61	-110.090,50	-3,58%	-3,58%
Total Renda Variável	23.414.715,30	1.647.000,00	0,00	25.271.662,64	209.947,34	0,84%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	2.719.098,79	0,00	0,00	2.947.293,93	228.195,14	8,39%	8,39%
Total Exterior	2.719.098,79	0,00	0,00	2.947.293,93	228.195,14	8,39%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	10.943.233,48	0,00	0,00	11.799.986,13	856.752,65	7,83%	7,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.419.927,69	0,00	5.000.000,00	5.137.571,90	717.644,21	9,21%	9,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.794.653,75	958.595,29	0,00	7.450.612,16	697.363,12	11,78%	11,81%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	3.802.515,77	14.830.248,85	12.222.662,76	7.073.086,41	662.984,55	9,60%	11,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	5.526.311,85	0,00	0,00	6.056.754,49	530.442,64	9,61%	9,60%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	3.778.913,23	5.000.000,00	0,00	9.294.786,72	515.873,49	8,78%	9,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.772.085,39	0,00	4.800.000,00	1.360.674,49	388.589,10	9,39%	9,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.484.688,60	0,00	1.241.784,59	1.440.212,62	197.308,61	8,61%	9,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	2.002.242,53	6.839.525,08	8.933.511,78	39.319,30	131.063,47	7,70%	10,58%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	881.960,46	75.518,68	0,00	1.056.650,42	99.171,28	10,64%	10,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.550.681,79	0,00	0,00	1.643.007,37	92.325,58	5,94%	5,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	315.894,61	447.038,32	409.105,91	424.070,16	70.243,14	11,65%	11,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	869.779,56	0,00	0,00	923.661,15	53.881,59	6,20%	6,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	320.827,00	330.476,62	41.703,55	656.548,88	46.948,81	11,19%	11,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	707.184,13	0,00	750.392,68	0,00	43.208,55	6,12%	9,67%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	861.159,77	0,00	0,00	903.679,90	42.520,13	4,94%	4,94%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	575.680,51	0,00	0,00	610.540,71	34.860,20	6,04%	6,06%
TÍTULOS PÚBLICOS	534.383,11	0,00	534.383,11	0,00	0,00	0,00%	-
Total Renda Fixa	56.142.123,23	28.481.402,84	33.933.544,38	55.871.162,81	5.181.181,12	6,12%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.847.750,28	0,00	0,00	3.159.536,51	311.786,23	10,94%	10,95%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.016.806,63	0,00	0,00	2.259.379,84	242.573,21	12,03%	12,03%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.800.000,00	0,00	3.024.923,94	224.923,94	8,04%	13,75%
ITAÚ DUNAMIS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.472.433,69	0,00	0,00	3.651.721,98	179.288,29	5,17%	5,16%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	2.940.158,23	0,00	0,00	3.098.202,32	158.044,09	5,38%	5,38%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.647.000,00	0,00	1.652.006,93	5.006,93	0,30%	13,45%
SANTANDER DIVIDENDOS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.978.918,56	-21.081,44	-1,04%	11,58%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.608.954,14	0,00	0,00	3.483.712,95	-125.241,19	-3,48%	-3,47%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.245.421,83	0,00	0,00	2.963.259,61	-282.162,22	-8,69%	-8,69%
Total Renda Variável	18.131.524,80	6.447.000,00	0,00	25.271.662,64	693.137,84	2,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	3.734.386,25	0,00	0,00	2.947.293,93	-787.092,32	-21,08%	-21,08%
Total Exterior	3.734.386,25	0,00	0,00	2.947.293,93	-787.092,32	-21,08%	

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das aliquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

