

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano 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 (Dezembro / 2022)

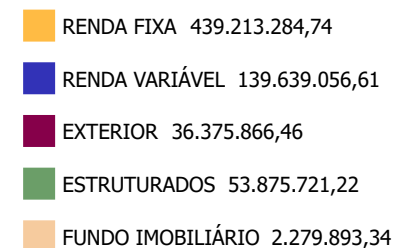
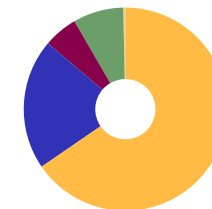
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			314.662.778,81	46,87%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	50.828.218,53	7,57%	939	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.930.058,19	2,37%	248	1,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	29.816.321,45	4,44%	739	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.541.443,57	0,53%	1.000	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	20.190.517,06	3,01%	77	5,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	761.862,13	0,11%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.669.589,10	0,40%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1	D+1260	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	812.495,89	0,12%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	21.984.878,05	3,27%	1.545	2,60%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	20.914.270,00	3,12%	25.252	1,53%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.729.117,12	0,41%	194	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	21.244.929,88	3,16%	21.707	0,93%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	18.640.085,60	2,78%	44	3,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	10.724.075,70	1,60%	92	2,19%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	13.918.528,89	2,07%	1.545	1,00%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	17.327.913,40	2,58%	2.534	5,05%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	11.718.447,80	1,75%	4.054	9,09%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	6.858.235,36	1,02%	3.708	3,15%	Artigo 9º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	7.614.040,66	1,13%	7.977	1,41%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	12.556.158,89	1,87%	7.509	1,26%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	9.347.431,55	1,39%	510	0,48%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	15.183.386,49	2,26%	8.904	0,88%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	16.027.787,10	2,39%	785	1,36%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	1.762.115,52	0,26%	3.924	0,90%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	15.062.027,44	2,24%	29.334	1,60%	Artigo 10º, Inciso I
BRASIL FLORESTAL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	750.675,21	0,11%	17	2,71%	Artigo 10º, Inciso II
BRASIL FLORESTAL MULTIELSTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	759.443,04	0,11%	21	0,56%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIELSTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	4.330.286,42	0,64%	28	3,47%	Artigo 10º, Inciso II
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.279.893,34	0,34%		1,55%	Artigo 11º
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	436.810,17	0,07%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			671.383.822,37				

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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, Alínea 'a'	100,00%	314.662.778,81	46,87%	0,00%	24,00%	60,00%	88.167.514,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	96.574.598,17	14,38%	10,00%	20,00%	60,00%	306.255.695,25
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	33.569.191,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	24.493.822,76	3,65%	0,00%	10,00%	30,00%	176.921.323,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	67.138.382,24
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	67.138.382,24
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	3.482.085,00	0,52%	0,00%	1,00%	5,00%	30.087.106,12
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	33.569.191,12
Total Renda Fixa	100,00%	439.213.284,74	65,42%	10,00%	55,00%	185,00%	

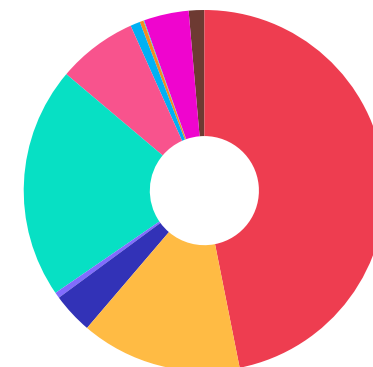


ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

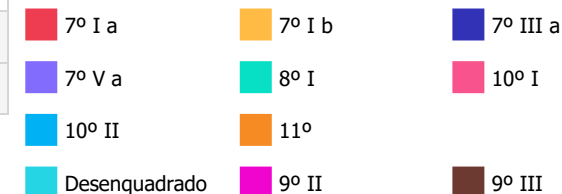


Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2022)

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%	139.202.246,44	20,73%	5,00%	23,00%	40,00%	129.351.282,51
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	134.276.764,47
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	48.035.316,55	7,15%	0,00%	10,00%	10,00%	19.103.065,69
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	5.840.404,67	0,87%	0,00%	1,00%	5,00%	27.728.786,45
Artigo 11º	10,00%	2.279.893,34	0,34%	0,00%	1,00%	5,00%	31.289.297,78
Desenquadrado - RV	0,00%	436.810,17	0,07%	0,00%	0,00%	0,00%	-436.810,17
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	195.794.671,17	29,16%	5,00%	35,00%	80,00%	



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%	27.028.434,91	4,03%	0,00%	8,00%	10,00%	40.109.947,33
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.347.431,55	1,39%	0,00%	2,00%	5,00%	24.221.759,57
Total Exterior	10,00%	36.375.866,46	5,42%	0,00%	10,00%	15,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	314.662.778,81	46,87	-
CAIXA DTVM	127.375.976,90	18,97	-
ITAÚ UNIBANCO	46.942.379,86	6,99	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.899.148,05	6,39	-
ITAÚ DTVM	39.885.015,48	5,94	0,01
SOMMA INVESTIMENTOS	17.327.913,40	2,58	-
WESTERN ASSET	15.062.027,44	2,24	0,03
XP ASSET MANAGEMENT	14.472.276,02	2,16	-
NAVI CAPITAL	13.918.528,89	2,07	0,97
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.556.158,89	1,87	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	11.718.447,80	1,75	0,03
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.523.840,46	0,97	1,34
KPTL	4.330.286,42	0,64	1,22
SICREDI	1.762.115,52	0,26	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.510.118,25	0,22	-
CADENCE GESTORA	436.810,17	0,07	-
GENIAL GESTÃO LTDA	0,01	0,00	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	314.662.778,81	46,87	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	96.574.598,17	14,38	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	24.493.822,76	3,65	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	3.482.085,00	0,52	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	139.202.246,44	20,73	5,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	27.028.434,91	4,03	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	9.347.431,55	1,39	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	48.035.316,55	7,15	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	5.840.404,67	0,87	0,00	5,00
Artigo 11º	2.279.893,34	0,34	0,00	5,00

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
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,22%	13,16%	3,33%	3,76%	13,16%	33,23%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,19%	3,39%	0,43%	0,68%	3,39%	2,55%	0,24%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,34%	-11,04%	-0,26%	-8,69%	-11,04%	-17,27%	1,17%	0,05%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,19%	3,30%	-1,72%	1,24%	3,30%	-3,47%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,23%	3,06%	-1,79%	1,09%	3,06%	-4,16%	3,81%	0,06%

120% do CDI (Benchmark)	1,35%	15,02%	3,85%	7,99%	15,02%	21,12%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1	-0,18%	-1.201.110.000.100,00%	-6,71%	14,05%	-1.201.110.000.100,00%	-1.201.110.000.100,00%	-	-

IMA-B 5 (Benchmark)	0,94%	9,78%	2,53%	2,98%	9,78%	14,79%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	9,67%	2,46%	2,96%	9,67%	14,40%	1,14%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,24%	6,20%	0,10%	1,87%	6,20%	4,57%	2,52%	0,04%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,25%	4,94%	-0,49%	0,73%	4,94%	3,40%	2,58%	0,05%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,20%	6,22%	1,37%	2,85%	6,22%	1,88%	0,64%	0,01%

CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,15%	12,67%	3,26%	6,70%	12,67%	17,85%	0,03%	0,00%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,50%	16,85%	4,16%	5,46%	16,85%	42,05%	-	-
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	-0,15%	-8,68%	-	-7,66%	-8,68%	-7,00%	-	0,07%

S&P 500 (Benchmark)	-5,90%	-19,44%	7,08%	1,43%	-19,44%	2,22%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,84%	-11,99%	9,67%	6,81%	-11,99%	16,56%	8,32%	0,23%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,81%	-11,92%	9,76%	6,88%	-11,92%	16,92%	8,32%	0,23%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,84%	-11,74%	9,81%	7,03%	-11,74%	17,56%	8,33%	0,24%

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,38%	15,27%	3,81%	4,73%	15,27%	38,23%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-0,03%	-0,38%	-0,09%	-0,20%	-0,38%	-1,42%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	-0,05%	-0,64%	-0,16%	-0,36%	-0,64%	-1,94%	-	0,00%

Global BDRX (Benchmark)	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%	-	-
-------------------------	--------	---------	-------	--------	---------	--------	---	---

Ibovespa (Benchmark)	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-2,62%	2,43%	-1,12%	9,90%	2,43%	-9,39%	10,03%	0,22%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-2,13%	4,71%	-1,49%	10,99%	4,71%	-12,72%	9,24%	0,21%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-2,54%	-3,07%	-0,78%	10,36%	-3,07%	-22,81%	9,62%	0,21%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-2,08%	0,10%	-1,60%	10,01%	0,10%	-10,58%	9,44%	0,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,57%	-0,76%	-2,39%	7,00%	-0,76%	-6,97%	9,73%	0,21%

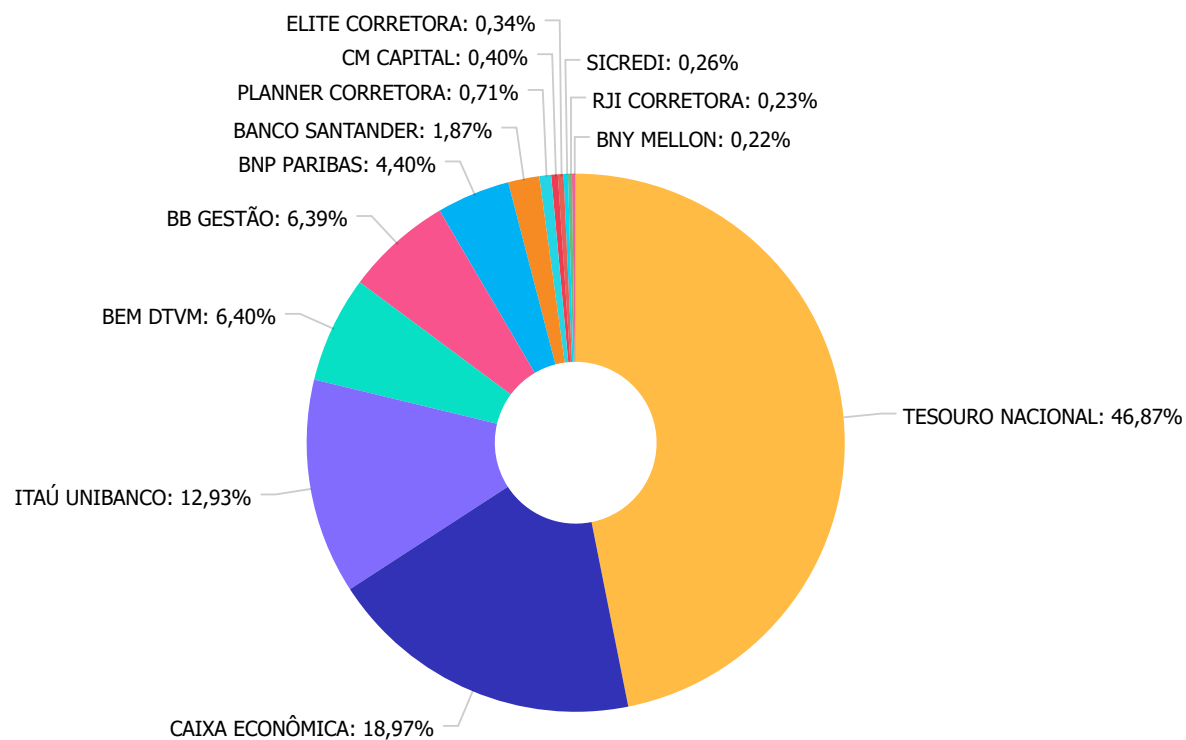
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,64%	-9,36%	-9,69%	1,51%	-9,36%	-24,85%	11,79%	0,25%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,87%	6,44%	-2,18%	9,13%	6,44%	1,44%	8,91%	0,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1,80%	5,16%	3,00%	15,16%	5,16%	-3,78%	10,24%	0,23%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-2,48%	2,47%	-0,85%	6,33%	2,47%	8,22%	10,05%	0,18%
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,43%	-25,01%	5,58%	1,05%	-25,01%	-5,95%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-4,90%	-11,97%	9,70%	6,79%	-11,97%	16,92%	8,34%	0,24%
IFIX (Benchmark)	0,00%	2,22%	-4,14%	2,56%	2,22%	-0,11%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-0,37%	-0,05%	-0,12%	-0,37%	-3,89%	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	-50,78%	-50,51%	-50,61%	-50,78%	-49,19%	-	-

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

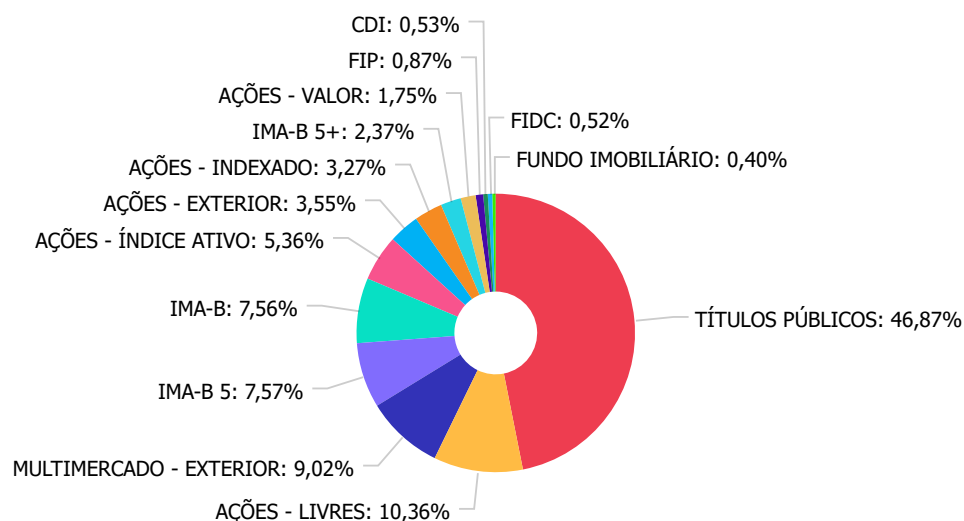
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%	-	-
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,72%	-24,70%	5,60%	1,82%	-24,70%	-2,86%	-	-
MSCI ACWI (Benchmark)	-5,43%	-25,01%	5,58%	1,05%	-25,01%	-5,95%	-	-

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



TESOURO NACIONAL	314.662.778,81
CAIXA ECONÔMICA	127.375.976,90
ITAÚ UNIBANCO	86.827.395,34
BEM DTVM	42.964.890,09
BB GESTÃO	42.899.148,05
BNP PARIBAS	29.534.303,46
BANCO SANTANDER	12.556.158,89
PLANNER CORRETORA	4.767.096,59
CM CAPITAL	2.669.589,10
ELITE CORRETORA	2.279.893,34
SICREDI	1.762.115,52
RJI CORRETORA	1.574.358,03
BNY MELLON	1.510.118,25

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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	314.662.778,81	■ AÇÕES - LIVRES	69.530.921,59	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	60.591.475,44	■ IMA-B 5	50.828.218,53
■ IMA-B	50.768.700,64	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	35.967.999,00	■ AÇÕES - EXTERIOR	23.819.707,57	■ AÇÕES - INDEXADO	21.984.878,05
■ IMA-B 5+	15.930.058,19	■ AÇÕES - VALOR	11.718.447,80	■ FIP	5.840.404,67	■ CDI	3.541.443,57
■ FIDC	3.482.085,00	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.716.703,51				

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	04/01/2022	1.280	3827,7686	4.026,619185	4.899.543,81	5.154.072,56	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	10/02/2022	1.559	3846,301089	4.026,619185	5.996.383,40	6.277.499,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	24/05/2022	10.309	4.151,368820	4.208,272469	42.796.461,17	43.383.080,88	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	01/06/2022	1.942	4119,013540	4.164,132083	7.999.124,29	8.086.744,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	18/08/2022	2.161	4.003,343810	4.150,606027	8.651.225,97	8.969.459,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	23/08/2022	3.607	4.003,343810	4.127,008313	14.440.061,12	14.886.118,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	13.717	4.009,617406	4.086,661771	54.999.921,96	56.056.739,51	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/10/2022	1.592	4080,866490	4.058,663196	6.496.739,45	6.461.391,81	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	09/11/2022	1.600	4060,354006	4.128,861306	6.496.566,41	6.606.178,09	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	02/12/2022	1.724	4.059,444003	4.090,886916	6.998.481,46	7.052.689,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	29/12/2022	3.200	4.062,499278	4.064,246138	12.999.997,69	13.005.587,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	28/10/2021	1.449	3977,478261	4.022,577741	5.763.366,00	5.828.715,15	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	30/11/2021	1.387	4169,633376	4.022,577741	5.783.281,49	5.579.315,33	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	17/11/2021	303	4.128,989331	4.022,577741	1.251.083,77	1.218.841,06	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	06/12/2021	1.452	4200,155373	4.022,577741	6.098.625,60	5.840.782,88	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	13.639	4.193,558503	4.251,642106	57.195.944,42	57.988.146,68	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/07/2022	2.940	4081,521882	4.079,217848	11.999.674,33	11.992.900,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	18/08/2022	803	4.010,486989	4.170,881133	3.220.421,05	3.349.217,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512198	3.933,027029	1.997.348,05	1.628.273,19	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	3.933,027029	34.966,87	27.531,19	Mercado

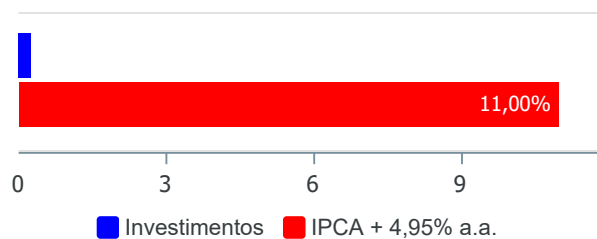
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2022)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	03/08/2021	1.293	4563,054091	3.933,027029	5.900.028,94	5.085.403,95	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	13/09/2021	9.500	4428,231791	3.933,027029	42.068.202,01	37.363.756,78	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	14/09/2021	145	4428,231791	3.933,027029	642.093,61	570.288,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	28/11/2022	428	3886,763534	3.925,339501	1.663.534,79	1.680.045,31	Curva

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	582.201.516,63	12.499.955,98	5.349.543,85	584.960.712,73	-4.391.216,03	-4.391.216,03	-0,75%	-0,75%	0,95%	0,95%	-78,80%	5,50%
Fevereiro	584.960.712,73	12.822.295,38	7.319.618,09	587.519.255,93	-2.944.134,09	-7.335.350,12	-0,50%	-1,24%	1,38%	2,34%	-53,05%	4,77%
Março	587.519.255,93	7.097.530,64	506.654,96	611.956.135,99	17.846.004,38	10.510.654,26	3,00%	1,73%	2,05%	4,43%	38,93%	6,23%
Abril	611.956.135,99	7.537.353,11	539.629,09	600.908.298,26	-18.045.561,75	-7.534.907,49	-2,92%	-1,24%	1,43%	5,93%	-20,91%	5,07%
Mai	600.908.298,26	108.814.394,52	103.137.034,82	611.861.941,34	5.276.283,38	-2.258.624,11	0,87%	-0,38%	0,89%	6,87%	-5,53%	6,78%
Junho	611.861.941,34	15.941.474,50	8.512.122,06	598.808.548,84	-20.482.744,94	-22.741.369,05	-3,31%	-3,68%	1,08%	8,02%	-45,80%	6,39%
Julho	598.808.548,84	19.357.708,41	12.793.411,36	616.864.797,72	11.491.951,83	-11.249.417,22	1,90%	-1,85%	-0,28%	7,72%	-23,91%	5,64%
Agosto	616.864.797,72	51.196.015,14	44.200.591,40	633.589.453,35	9.729.231,89	-1.520.185,33	1,56%	-0,32%	0,08%	7,81%	-4,04%	6,25%
Setembro	633.589.453,35	76.746.695,42	69.680.340,63	636.165.699,27	-4.490.108,87	-6.010.294,20	-0,70%	-1,01%	0,11%	7,93%	-12,79%	7,56%
Outubro	636.165.699,27	13.991.054,87	7.281.021,51	659.470.711,99	16.594.979,36	10.584.685,16	2,58%	1,54%	0,98%	8,98%	17,15%	9,56%
Novembro	659.470.711,99	17.452.670,29	10.306.216,29	663.949.074,03	-2.668.091,96	7.916.593,20	-0,40%	1,13%	0,80%	9,85%	11,51%	10,45%
Dezembro	663.949.074,03	32.293.468,35	18.906.952,71	671.383.822,37	-5.951.767,30	1.964.825,90	-0,88%	0,25%	1,05%	11,00%	2,23%	6,88%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

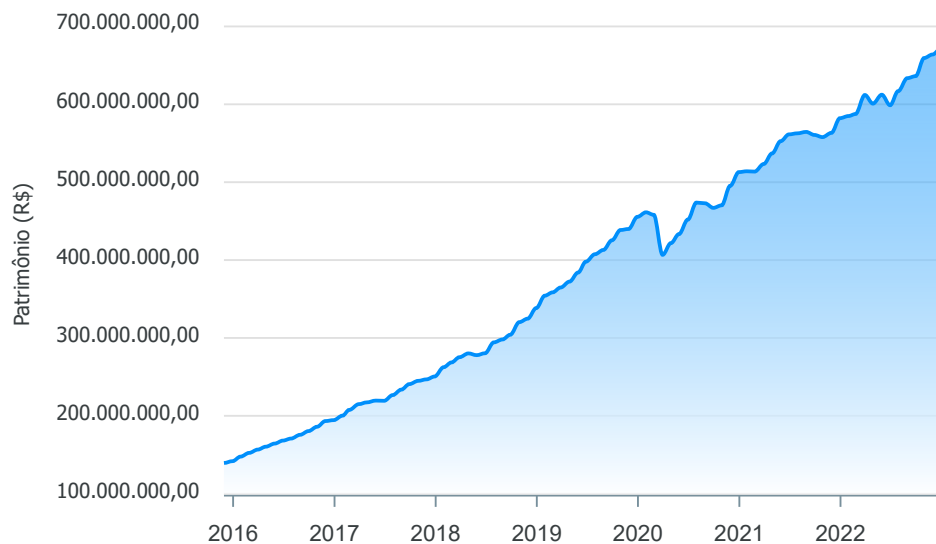


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

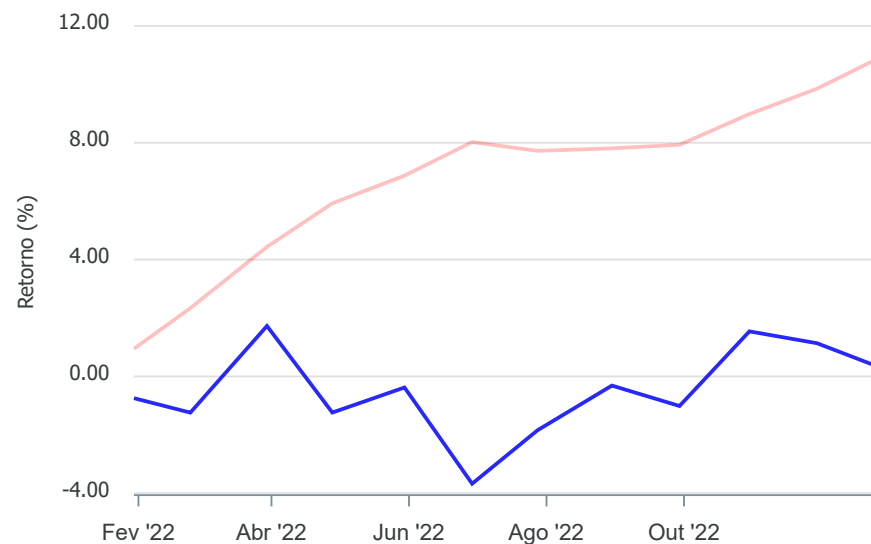
ANO

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 Dezembro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	50.363.836,31	0,00	0,00	50.828.218,53	464.382,22	0,92%	0,92%	1,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.053.730,70	12.294.989,21	18.906.952,71	3.541.443,57	99.676,37	0,45%	1,15%	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.660.687,11	0,00	0,00	2.669.589,10	8.901,99	0,33%	0,33%	1,17%
TÍTULOS PÚBLICOS	293.891.695,94	19.998.479,14	0,00	314.662.778,81	772.603,73	0,25%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	760.342,32	0,00	0,00	761.862,13	1.519,81	0,20%	0,20%	0,64%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	810.979,65	0,00	0,00	812.495,89	1.516,24	0,19%	0,19%	0,24%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	29.887.109,87	0,00	0,00	29.816.321,45	-70.788,42	-0,24%	-0,24%	2,52%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	20.240.388,63	0,00	0,00	20.190.517,06	-49.871,57	-0,25%	-0,25%	2,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.128.907,56	0,00	0,00	15.930.058,19	-198.849,37	-1,23%	-1,23%	3,81%
Total Renda Fixa	424.797.678,10	32.293.468,35	18.906.952,71	439.213.284,74	1.029.091,00	0,23%		2,01%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Dezembro/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	20.869.515,05	0,00	0,00	21.244.929,88	375.414,83	1,80%	1,80%	10,24%
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	759.685,59	0,00	0,00	759.443,04	-242,55	-0,03%	-0,03%	0,00%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.280.882,55	0,00	0,00	2.279.893,34	-989,21	-0,04%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	751.084,48	0,00	0,00	750.675,21	-409,27	-0,05%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	437.200,81	0,00	0,00	436.810,17	-390,64	-0,09%	0,00%	-
W7 FIP MULTISTRATÉGIA	4.336.957,17	0,00	0,00	4.330.286,42	-6.670,75	-0,15%	-	-
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.695.487,33	0,00	0,00	17.327.913,40	-367.573,93	-2,08%	-2,08%	9,44%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	19.044.983,91	0,00	0,00	18.640.085,60	-404.898,31	-2,13%	-2,13%	9,24%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.798.495,73	0,00	0,00	2.729.117,12	-69.378,61	-2,48%	-2,48%	10,05%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	12.023.592,49	0,00	0,00	11.718.447,80	-305.144,69	-2,54%	-2,54%	9,62%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	21.465.126,93	0,00	0,00	20.914.270,00	-550.856,93	-2,57%	-2,57%	9,73%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	22.577.013,83	0,00	0,00	21.984.878,05	-592.135,78	-2,62%	-2,62%	10,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.245.729,74	0,00	0,00	10.724.075,70	-521.654,04	-4,64%	-4,64%	11,79%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	16.838.223,39	0,00	0,00	16.027.787,10	-810.436,29	-4,81%	-4,81%	8,32%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15.827.657,40	0,00	0,00	15.062.027,44	-765.629,96	-4,84%	-4,84%	8,32%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.851.735,90	0,00	0,00	1.762.115,52	-89.620,38	-4,84%	-4,84%	8,33%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.631.385,91	0,00	0,00	13.918.528,89	-712.857,02	-4,87%	-4,87%	8,91%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	15.965.261,11	0,00	0,00	15.183.386,49	-781.874,62	-4,90%	-4,90%	8,34%
Total Renda Variável	201.400.019,32	0,00	0,00	195.794.671,17	-5.605.348,15	-2,78%		9,29%

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	12.813.699,11	0,00	0,00	12.556.158,89	-257.540,22	-2,01%	-2,14%	8,84%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	7.866.305,83	0,00	0,00	7.614.040,66	-252.265,17	-3,21%	-3,21%	14,90%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.818.062,02	0,00	0,00	9.347.431,55	-470.630,47	-4,79%	-4,79%	10,61%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	7.253.309,65	0,00	0,00	6.858.235,36	-395.074,29	-5,45%	-5,45%	11,07%
Total Exterior	37.751.376,61	0,00	0,00	36.375.866,46	-1.375.510,15	-3,64%		10,98%

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
TÍTULOS PÚBLICOS	277.896.456,79	34.655.319,78	1.665.801,49	314.662.778,81	3.776.803,73	1,21%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	49.609.705,78	0,00	0,00	50.828.218,53	1.218.512,75	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.078.928,12	29.081.873,73	34.828.389,02	3.541.443,57	209.030,74	0,55%	3,25%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	29.785.918,94	0,00	0,00	29.816.321,45	30.402,51	0,10%	0,10%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	751.582,01	0,00	0,00	761.862,13	10.280,12	1,37%	1,37%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	809.030,05	0,00	0,00	812.495,89	3.465,84	0,43%	0,43%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-6,71%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.683.374,81	0,00	0,00	2.669.589,10	-13.785,71	-0,51%	-0,26%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	20.289.028,35	0,00	0,00	20.190.517,06	-98.511,29	-0,49%	-0,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.220.052,26	0,00	0,00	15.930.058,19	-289.994,07	-1,79%	-1,79%
Total Renda Fixa	407.124.077,12	63.737.193,51	36.494.190,51	439.213.284,74	4.846.204,62	1,12%	

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 PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	14.602.933,22	0,00	0,00	16.027.787,10	1.424.853,88	9,76%	9,76%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	13.841.122,51	0,00	0,00	15.183.386,49	1.342.263,98	9,70%	9,70%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.734.073,14	0,00	0,00	15.062.027,44	1.327.954,30	9,67%	9,67%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.626.215,05	0,00	0,00	21.244.929,88	618.714,83	3,00%	3,00%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.604.686,24	0,00	0,00	1.762.115,52	157.429,28	9,81%	9,81%
BRASIL FLORESTAL MULTIELAB FIP	760.152,01	0,00	0,00	759.443,04	-708,97	-0,09%	-0,09%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	751.868,17	0,00	0,00	750.675,21	-1.192,96	-0,16%	-0,16%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.282.019,97	0,00	0,00	2.279.893,34	-2.126,63	-0,09%	-0,05%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.752.490,98	0,00	0,00	2.729.117,12	-23.373,86	-0,85%	-0,85%
W7 FIP MULTIELAB FIP	4.354.157,99	0,00	0,00	4.330.286,42	-23.871,57	-0,55%	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.810.290,10	0,00	0,00	11.718.447,80	-91.842,30	-0,78%	-0,78%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	22.233.604,82	0,00	0,00	21.984.878,05	-248.726,77	-1,12%	-1,12%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	18.921.314,09	0,00	0,00	18.640.085,60	-281.228,49	-1,49%	-1,49%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.609.563,15	0,00	0,00	17.327.913,40	-281.649,75	-1,60%	-1,60%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.229.279,30	0,00	0,00	13.918.528,89	-310.750,41	-2,18%	-2,18%
OSASCO PROPERTIES FII	883.451,02	0,00	0,00	436.810,17	-446.640,85	-50,56%	-50,51%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	21.425.872,69	0,00	0,00	20.914.270,00	-511.602,69	-2,39%	-2,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.874.610,21	0,00	0,00	10.724.075,70	-1.150.534,51	-9,69%	-9,69%
Total Renda Variável	194.297.704,66	0,00	0,00	195.794.671,17	1.496.966,51	0,77%	

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
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	11.543.577,68	0,00	0,00	12.556.158,89	1.012.581,21	8,77%	8,62%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.029.760,11	0,00	0,00	9.347.431,55	317.671,44	3,52%	3,52%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	6.691.440,77	0,00	0,00	6.858.235,36	166.794,59	2,49%	2,49%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	7.479.138,93	0,00	0,00	7.614.040,66	134.901,73	1,80%	1,80%
Total Exterior	34.743.917,49	0,00	0,00	36.375.866,46	1.631.948,97	4,70%	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	65.939.293,54	247.038.566,41	7.765.943,84	314.662.778,81	9.450.862,70	3,02%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	65.540.196,47	0,00	20.356.402,73	50.828.218,53	5.644.424,79	8,61%	9,67%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	50.703.571,34	6.528.481,35	60.383.906,78	0,00	3.151.854,09	5,51%	9,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	37.294.383,40	0,00	9.520.959,21	29.816.321,45	2.042.897,26	5,48%	6,19%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	20.366.521,45	0,00	21.403.989,38	0,00	1.037.467,93	5,09%	7,22%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.240.508,65	0,00	0,00	20.190.517,06	950.008,41	4,94%	4,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.795.005,29	0,00	15.688.925,28	0,00	893.919,99	6,04%	9,51%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.133.558,36	108.067.405,44	110.509.543,97	3.541.443,57	850.023,74	0,75%	12,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.289.354,06	0,00	14.110.541,63	0,00	821.187,57	6,18%	9,32%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.836.589,43	0,00	14.524.547,95	0,00	687.958,52	4,97%	5,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.535.166,18	14.116.163,41	14.116.163,41	15.930.058,19	394.892,01	1,33%	3,06%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	717.281,82	0,00	0,00	761.862,13	44.580,31	6,22%	6,22%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	785.883,18	0,00	0,00	812.495,89	26.612,71	3,39%	3,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	237,14	0,00	254,10	0,00	16,96	7,15%	11,74%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-1.201.110.000.100,00%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.000.907,80	0,00	134.605,20	2.669.589,10	-196.713,50	-6,56%	-11,04%
Total Renda Fixa	326.178.458,12	375.750.616,61	288.515.783,48	439.213.284,74	25.799.993,49	6,24%	

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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.201.869,28	0,00	0,00	21.244.929,88	1.043.060,60	5,16%	5,16%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.076.126,28	0,00	0,00	13.918.528,89	842.402,61	6,44%	6,44%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	17.802.398,71	0,00	0,00	18.640.085,60	837.686,89	4,71%	4,71%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	21.464.228,30	0,00	0,00	21.984.878,05	520.649,75	2,43%	2,43%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.663.250,08	0,00	0,00	2.729.117,12	65.867,04	2,47%	2,47%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	17.309.979,34	0,00	0,00	17.327.913,40	17.934,06	0,10%	0,10%
BRASIL FLORESTAL MULTIELAB FIP	762.315,40	0,00	0,00	759.443,04	-2.872,36	-0,38%	-0,38%
BRASIL FLORESTAL FICFIP	755.513,01	0,00	0,00	750.675,21	-4.837,80	-0,64%	-0,64%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.289.320,38	0,00	0,00	2.279.893,34	-9.427,04	-0,41%	-0,37%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	21.073.354,37	0,00	0,00	20.914.270,00	-159.084,37	-0,75%	-0,75%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.996.577,28	0,00	0,00	1.762.115,52	-234.461,76	-11,74%	-11,74%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	12.089.277,19	0,00	0,00	11.718.447,80	-370.829,39	-3,07%	-3,07%
W7 FIP MULTIELAB FIP	4.741.662,03	0,00	17.353,29	4.330.286,42	-394.022,32	-8,31%	-8,68%
OSASCO PROPERTIES FII	889.083,22	0,00	0,00	436.810,17	-452.273,05	-50,87%	-50,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.831.525,69	0,00	0,00	10.724.075,70	-1.107.449,99	-9,36%	-9,36%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	17.114.538,47	0,00	0,00	15.062.027,44	-2.052.511,03	-11,99%	-11,99%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	17.248.692,32	0,00	0,00	15.183.386,49	-2.065.305,83	-11,97%	-11,97%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	18.197.097,09	0,00	0,00	16.027.787,10	-2.169.309,99	-11,92%	-11,92%
Total Renda Variável	201.506.808,44	0,00	17.353,29	195.794.671,17	-5.694.783,98	-2,83%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.080.433,60	0,00	0,00	9.347.431,55	-3.733.002,05	-28,54%	-28,54%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	10.682.514,44	0,00	0,00	6.858.235,36	-3.824.279,08	-35,80%	-35,80%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTMENT...	16.843.061,79	0,00	0,00	12.556.158,89	-4.286.902,90	-25,45%	-25,55%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTMENT...	13.910.240,24	0,00	0,00	7.614.040,66	-6.296.199,58	-45,26%	-45,26%
Total Exterior	54.516.250,07	0,00	0,00	36.375.866,46	-18.140.383,61	-33,28%	

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.