

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			104.763.624,69	25,97%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.050.757,74	3,23%	31	8,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	21.905.600,27	5,43%	20	6,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	29.255.402,07	7,25%	706	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	6.260.471,21	1,55%	478	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	2.216.550,29	0,55%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.877.577,65	2,20%	105	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	10.025.371,88	2,49%	269	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	8.901.802,25	2,21%	97	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	26.413.445,36	6,55%	810	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	28.865,21	0,01%	939	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	8.215.108,85	2,04%	1.180	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.531.883,32	2,61%	297	1,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	21.879.277,50	5,42%	144	13,84%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA ...	D+0	Não há	4.822.865,41	1,20%	1.934	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.419.838,32	2,33%	284	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	16.593.751,70	4,11%	1.060	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.763.286,02	0,44%	242	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	12.379.821,11	3,07%	63	2,70%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.045.767,35	0,26%	3.851	0,07%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

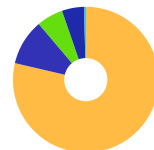
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	10.682.710,24	2,65%	186	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+5 du	Não há	1.750.557,15	0,43%	48	13,99%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.222.043,29	1,79%	653	1,88%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.615.507,73	0,40%	34.378	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.641.516,78	0,90%	25.252	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	7.812.509,56	1,94%	194	1,29%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÃO...	D+33	Não há	1.638.375,13	0,41%	165	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.702.939,38	0,67%	127	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.854.274,62	0,71%	1.795	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	4.993.745,69	1,24%	56	0,83%	Artigo 9º, Inciso II
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMER...	D+5 du	Não há	958.581,37	0,24%	39	0,16%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	1.599.579,09	0,40%	57	1,35%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+6 du	Não há	1.186.609,54	0,29%	169	0,72%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.418.219,87	0,35%	282	0,50%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	13.617.500,88	3,38%	510	0,70%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	9.902.606,06	2,45%	125	1,31%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	4.856.393,80	1,20%	8.904	0,28%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	5.044.991,98	1,25%	10	11,14%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.575.000,00	0,39%		1,59%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		35.412,40	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			403.424.730,36				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			35.412,40	Artigo 6º			
PL Total			403.460.142,76				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	104.763.624,69	25,97%	1,00%	15,00%	30,00%	16.263.794,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	145.682.836,10	36,11%	20,00%	36,00%	85,00%	197.228.184,71
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	75,00%	54.479.018,95	13,50%	0,00%	0,50%	65,00%	207.747.055,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	75,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	10,00%	22,00%	55,00%	221.883.601,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	15,00%	12.379.821,11	3,07%	0,00%	3,50%	10,00%	27.962.651,93
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'c'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Total Renda Fixa	100,00%	317.305.300,85	78,65%	31,00%	77,00%	270,00%	



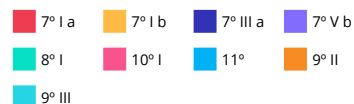
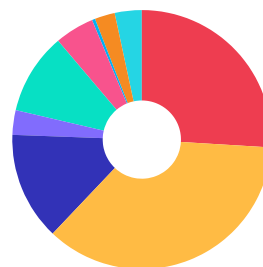
RENTA FIXA	317.305.300,85
RENTA VARIÁVEL	40.966.201,23
EXTERIOR	23.774.236,44
ESTRUTURADOS	19.803.991,84
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.575.000,00

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 (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2022)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	45,00%	40.966.201,23	10,15%	0,00%	8,00%	20,00%	39.718.744,84
Artigo 8º, Inciso II	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.803.991,84	4,91%	1,00%	4,00%	10,00%	20.538.481,20
Artigo 10º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Artigo 10º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.171.236,52
Artigo 11º	15,00%	1.575.000,00	0,39%	0,00%	1,00%	5,00%	18.596.236,52
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	45,00%	62.345.193,07	15,45%	1,00%	13,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	40.342.473,04
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	10.156.735,56	2,52%	0,00%	4,00%	10,00%	30.185.737,48
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	13.617.500,88	3,38%	0,00%	6,00%	10,00%	26.724.972,16
Total Exterior	10,00%	23.774.236,44	5,89%	0,00%	10,00%	30,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	116.862.665,35	28,97	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	104.763.624,69	25,97	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	85.137.391,24	21,10	-
BANESTES DTVM	83.511.606,63	20,70	0,90
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.044.991,98	1,25	0,34
OCCAM BRASIL	2.854.274,62	0,71	0,02
GENIAL INVESTIMENTOS	2.786.188,63	0,69	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.418.219,87	0,35	0,02
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.045.767,35	0,26	0,00

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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
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%	0,01%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	11,96%	3,12%	6,60%	11,96%	13,99%	0,11%	0,01%

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%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	3,10%	2,70%	-0,17%	3,10%	0,83%	0,99%	0,05%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	3,16%	2,71%	-0,34%	3,16%	0,91%	0,99%	0,05%

IMA-B (Benchmark)	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,26%	6,02%	-0,06%	1,74%	6,02%	4,43%	2,58%	0,04%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,13%	5,66%	0,24%	2,00%	5,66%	-1,90%	2,48%	0,04%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,08%	-0,78%	0,15%	-3,19%	-0,78%	-8,14%	2,94%	0,06%

IRF-M (Benchmark)	1,48%	8,82%	1,74%	6,49%	8,82%	6,66%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,43%	8,58%	1,64%	6,34%	8,58%	6,10%	1,73%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	8,72%	1,76%	6,44%	8,72%	6,35%	1,73%	0,03%

CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12%	12,59%	3,22%	6,67%	12,59%	17,79%	0,01%	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
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,11%	12,94%	3,24%	6,84%	12,94%	19,15%	0,03%	0,00%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	0,86%	9,18%	2,44%	5,02%	9,18%	11,72%	0,00%	0,00%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,91%	11,53%	2,73%	5,98%	11,53%	12,52%	0,33%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,02%	9,39%	2,50%	2,84%	9,39%	13,84%	1,00%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,31%	10,63%	2,70%	3,51%	10,63%	16,67%	0,98%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14%	10,70%	2,23%	5,84%	10,70%	10,58%	0,37%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	9,30%	1,67%	4,80%	9,30%	9,89%	1,26%	0,02%

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
--------------------------	---	---	---	---	---	---	---	---

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
Global BDRX (Benchmark)	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%	-	-
IDIV (Benchmark)	-1,61%	12,65%	3,15%	7,71%	12,65%	5,43%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-2,43%	8,49%	0,12%	7,07%	8,49%	-2,90%	8,91%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-3,47%	4,78%	-4,19%	7,18%	4,78%	-11,16%	10,28%	0,22%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-2,72%	3,65%	-1,81%	9,14%	3,65%	-10,02%	9,33%	0,21%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,03%	-4,58%	-3,90%	9,86%	-4,58%	-34,78%	9,06%	0,24%
OCCAM FIC AÇÕES	-2,66%	4,52%	-1,56%	8,90%	4,52%	-8,80%	7,17%	0,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,57%	-0,76%	-2,39%	7,00%	-0,76%	-6,97%	9,73%	0,21%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-2,86%	-10,15%	-6,28%	3,31%	-10,15%	-21,87%	10,30%	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%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-0,82%	7,49%	3,09%	9,39%	7,49%	-12,58%	7,55%	0,20%
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%	0,22%
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%	0,04%

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
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%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-8,67%	-7,68%	-9,91%	-0,44%	-7,68%	-53,96%	14,39%	0,15%

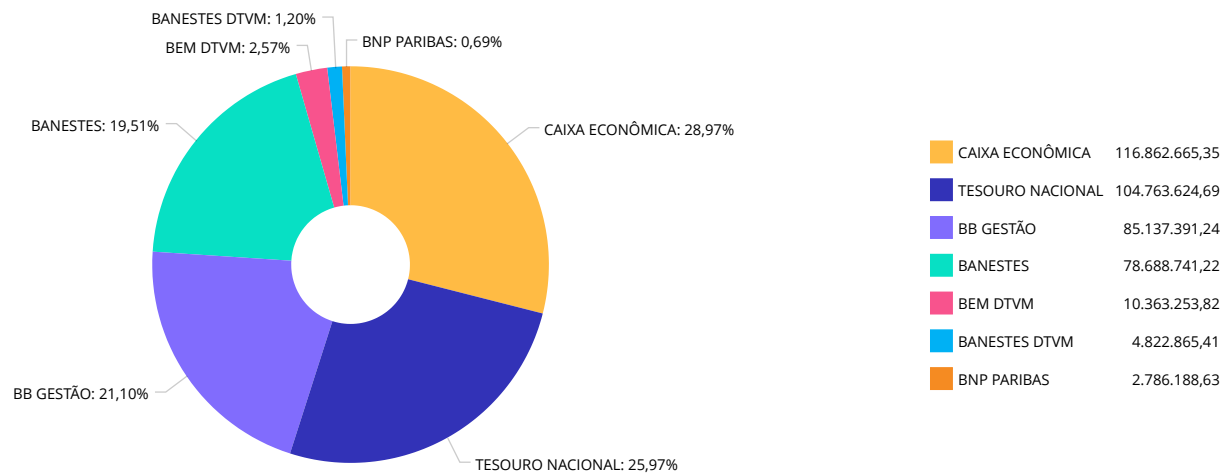
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,64%	-21,61%	7,15%	2,97%	-21,61%	-3,39%	11,86%	19,51%

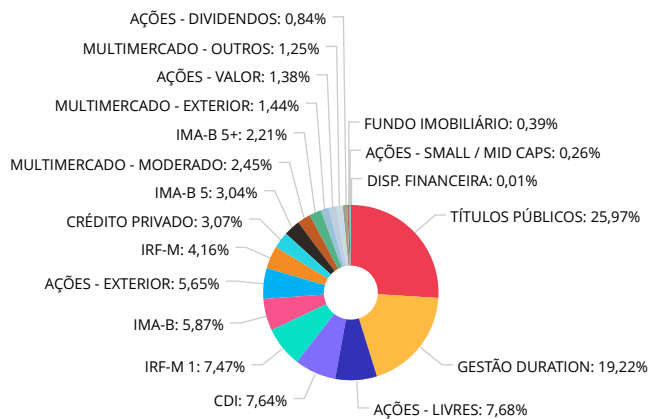
MSCI WORLD (Benchmark)	-5,72%	-24,70%	5,60%	1,82%	-24,70%	-2,86%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,64%	-21,61%	7,15%	2,97%	-21,61%	-3,39%	11,86%	19,51%

MSCI ACWI (Benchmark)	-5,43%	-25,01%	5,58%	1,05%	-25,01%	-5,95%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	0,64%	-21,61%	7,15%	2,97%	-21,61%	-3,39%	11,86%	19,51%

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



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



TÍTULOS PÚBLICOS	104.763.624,69	GESTÃO DURATION	77.548.124,93	AÇÕES - LIVRES	30.974.287,60	CDI	30.836.455,43
IRF-M 1	30.120.709,12	IMA-B	23.691.621,41	AÇÕES - EXTERIOR	22.815.655,07	IRF-M	16.792.354,53
CRÉDITO PRIVADO	12.379.821,11	IMA-B 5	12.270.787,38	MULTIMERCADO - MODERADO	9.902.606,06	IMA-B 5+	8.901.802,25
MULTIMERCADO - EXTERIOR	5.814.975,17	AÇÕES - VALOR	5.557.214,00	MULTIMERCADO - OUTROS	5.044.991,98	AÇÕES - DIVIDENDOS	3.388.932,28
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.575.000,00	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.045.767,35	DISP. FINANCEIRA	35.412,40		



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

Titulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/02/2022	2.475	4041,475328	4.205,820447	10.002.651,44	10.409.405,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/04/2022	1.560	4217,247417	4.243,447401	6.578.905,97	6.619.777,95	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/08/2022	3.155	4117,462757	4.109,352957	12.990.595,00	12.965.008,58	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/10/2022	912	4164,832110	4.147,582932	3.798.326,88	3.782.595,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	11/11/2022	925	3987,369527	4.044,422301	3.688.316,81	3.741.090,63	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	24/11/2022	1.820	3907,209923	3.951,213523	7.111.122,06	7.191.208,61	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	13/12/2022	975	3928,920938	3.951,213523	3.830.697,91	3.852.433,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	29/12/2021	665	4.198,229405	4.433,131656	2.791.822,55	2.948.032,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	21/02/2022	617	3968,953944	4.227,708935	2.448.844,58	2.608.496,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/02/2022	2.430	4117,023852	4.310,498617	10.004.367,96	10.474.511,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	22/02/2022	202	3968,953944	4.227,708935	801.728,70	853.997,20	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	602	4175,438692	4.321,860184	2.513.614,09	2.601.759,83	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	878	4175,438692	4.321,860184	3.666.035,17	3.794.593,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/04/2022	100	4175,438692	4.321,860184	417.543,87	432.186,02	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	140	4164,883793	4.223,300088	583.083,73	591.262,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	25/05/2022	35	4164,883793	4.223,300088	145.770,93	147.815,50	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	308	4113,258152	4.115,135575	1.266.883,51	1.267.461,76	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	500	4113,258152	4.115,135575	2.056.629,08	2.057.567,79	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	05/07/2022	22	4113,258152	4.115,135575	90.491,68	90.532,98	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	11/08/2022	2.490	4058,501854	4.166,556150	10.105.669,62	10.374.724,81	Curva

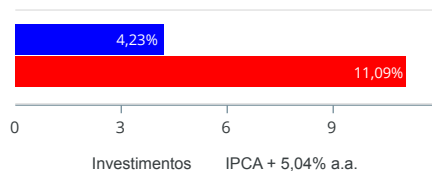
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2022)

Titulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/02/2022	2.430	4117,023852	4.310,498617	10.004.367,96	10.474.511,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	15/12/2021	707	4.267,647108	4.527,550470	3.017.226,51	3.200.978,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	06/05/2022	611	4076,821575	4.165,182379	2.490.937,98	2.544.926,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	03/06/2022	830	4087,350009	4.130,362870	3.392.500,51	3.428.201,18	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	22/08/2022	488	4099,695852	4.091,034676	2.000.651,58	1.996.424,92	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	13/09/2022	975	4107,222589	4.200,541013	4.004.542,02	4.095.527,49	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	352.002.609,19	5.506.300,74	7.706.347,32	347.406.335,02	-2.396.227,59	-2.396.227,59	-0,68%	-0,68%	0,95%	0,95%	-71,45%	3,27%
Fevereiro	347.406.335,02	25.956.692,77	22.203.888,38	350.653.934,91	-505.204,50	-2.901.432,09	-0,14%	-0,82%	1,39%	2,35%	-35,03%	3,23%
Março	350.653.934,91	7.869.655,51	5.105.701,29	359.504.349,25	6.086.460,12	3.185.028,03	1,72%	0,88%	2,06%	4,46%	19,84%	3,72%
Abril	359.504.349,25	16.964.013,52	14.301.152,16	358.601.103,24	-3.566.107,37	-381.079,34	-0,98%	-0,11%	1,44%	5,96%	-1,83%	3,16%
Mai	358.601.103,24	8.868.982,54	6.195.934,68	363.477.704,95	2.203.553,85	1.822.474,51	0,61%	0,50%	0,90%	6,91%	7,24%	3,60%
Junho	363.477.704,95	28.239.217,20	25.196.784,97	362.635.041,38	-3.885.095,80	-2.062.621,29	-1,06%	-0,57%	1,08%	8,07%	-7,00%	3,33%
Julho	362.635.041,38	7.965.070,83	5.095.592,92	371.825.002,22	6.320.482,93	4.257.861,64	1,73%	1,15%	-0,27%	7,78%	14,85%	3,06%
Agosto	371.825.002,22	36.027.436,25	33.080.470,02	378.995.016,81	4.223.048,36	8.480.910,00	1,13%	2,29%	0,09%	7,87%	29,15%	3,71%
Setembro	378.995.016,81	17.226.226,30	9.751.133,74	385.932.432,80	-537.676,57	7.943.233,43	-0,14%	2,15%	0,12%	8,00%	26,90%	3,25%
Outubro	385.932.432,80	15.215.647,63	16.006.209,00	391.747.572,85	6.605.701,42	14.548.934,85	1,71%	3,90%	0,98%	9,06%	43,04%	4,16%
Novembro	391.747.572,85	30.224.024,13	27.096.832,44	395.446.459,30	571.694,76	15.120.629,61	0,14%	4,05%	0,80%	9,94%	40,76%	5,10%
Dezembro	395.446.459,30	15.883.234,99	9.134.725,62	402.887.789,48	692.820,81	15.813.450,42	0,17%	4,23%	1,05%	11,09%	38,13%	3,13%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

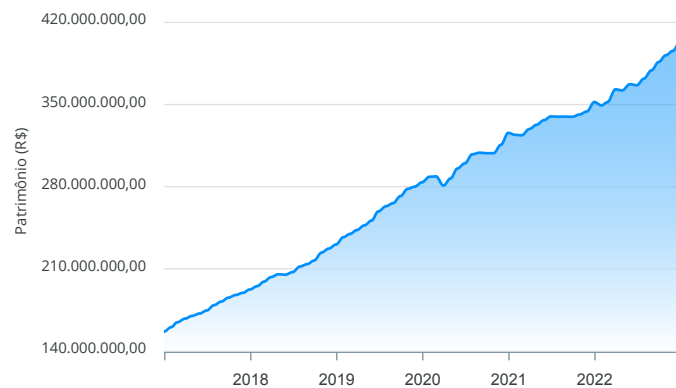


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO

36M

Evolução do Patrimônio



☐ 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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.381.978,81	0,00	0,00	10.531.883,32	149.904,51	1,44%	1,44%	1,73%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.172.006,54	0,00	0,00	6.260.471,21	88.464,67	1,43%	1,43%	1,73%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.894.892,44	0,00	0,00	10.025.371,88	130.479,44	1,32%	1,32%	0,99%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.762.105,05	0,00	0,00	8.877.577,65	115.472,60	1,32%	1,32%	0,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.187.821,30	0,00	0,00	2.216.550,29	28.728,99	1,31%	1,31%	0,98%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.649.571,36	0,00	0,00	21.905.600,27	256.028,91	1,18%	1,18%	0,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.121.341,90	0,00	0,00	8.215.108,85	93.766,95	1,15%	1,15%	0,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	26.115.914,34	0,00	0,00	26.413.445,36	297.531,02	1,14%	1,14%	0,37%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.316.571,25	0,00	0,00	9.419.838,32	103.267,07	1,11%	1,11%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	17.007.796,45	0,00	602.151,30	16.593.751,70	188.106,55	1,11%	1,12%	0,01%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	12.254.498,02	0,00	0,00	12.379.821,11	125.323,09	1,02%	1,02%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	28.601,49	0,00	0,00	28.865,21	263,72	0,92%	0,92%	1,14%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	21.682.962,37	0,00	0,00	21.879.277,50	196.315,13	0,91%	0,91%	0,33%
TÍTULOS PÚBLICOS	100.061.631,28	3.830.697,91	0,00	104.763.624,69	871.295,50	0,84%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	29.032.581,98	0,00	0,00	29.255.402,07	222.820,09	0,77%	0,77%	1,26%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	1.008.506,10	12.514.500,96	8.724.654,77	4.822.865,41	24.513,12	0,18%	0,86%	0,00%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.908.878,70	0,00	0,00	8.901.802,25	-7.076,45	-0,08%	-0,08%	2,94%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.068.192,66	0,00	0,00	13.050.757,74	-17.434,92	-0,13%	-0,13%	2,48%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.767.942,98	0,00	0,00	1.763.286,02	-4.656,96	-0,26%	-0,26%	2,58%
Total Renda Fixa	307.423.795,02	16.345.198,87	9.326.806,07	317.305.300,85	2.863.113,03	0,91%		0,86%

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
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	4.963.520,24	0,00	0,00	5.044.991,98	81.471,74	1,64%	1,64%	4,88%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	9.836.600,61	0,00	0,00	9.902.606,06	66.005,45	0,67%	0,67%	1,71%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.765.079,71	0,00	0,00	1.750.557,15	-14.522,56	-0,82%	-0,82%	7,55%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.064.972,25	0,00	0,00	1.045.767,35	-19.204,90	-1,80%	-1,80%	8,16%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.679.087,82	0,00	0,00	1.638.375,13	-40.712,69	-2,42%	-2,42%	8,91%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	8.011.116,29	0,00	0,00	7.812.509,56	-198.606,73	-2,48%	-2,48%	10,05%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.737.429,99	0,00	0,00	3.641.516,78	-95.913,21	-2,57%	-2,57%	9,73%
OCCAM FIC AÇÕES	2.932.343,82	0,00	0,00	2.854.274,62	-78.069,20	-2,66%	-2,66%	7,17%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7.423.574,58	0,00	0,00	7.222.043,29	-201.531,29	-2,71%	-2,71%	9,33%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.663.104,46	0,00	0,00	1.615.507,73	-47.596,73	-2,86%	-2,86%	10,30%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.016.500,12	0,00	0,00	10.682.710,24	-333.789,88	-3,03%	-3,03%	9,06%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.799.982,88	0,00	0,00	2.702.939,38	-97.043,50	-3,47%	-3,47%	10,28%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	5.106.475,76	0,00	0,00	4.856.393,80	-250.081,96	-4,90%	-4,90%	8,34%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.724.500,00	0,00	13.750,00	1.575.000,00	-135.750,00	-7,87%	-8,67%	14,39%
Total Renda Variável	63.724.288,53	0,00	13.750,00	62.345.193,07	-1.365.345,46	-2,14%		7,76%

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
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.589.455,82	0,00	0,00	1.599.579,09	10.123,27	0,64%	0,64%	11,86%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.415.409,19	0,00	0,00	1.418.219,87	2.810,68	0,20%	0,20%	11,63%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	959.860,37	0,00	0,00	958.581,37	-1.279,00	-0,13%	-0,13%	11,28%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	5.033.171,93	0,00	0,00	4.993.745,69	-39.426,24	-0,78%	-0,78%	10,82%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.303.123,53	0,00	0,00	13.617.500,88	-685.622,65	-4,79%	-4,79%	10,61%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	1.275.107,90	0,00	0,00	1.186.609,54	-88.498,36	-6,94%	-6,94%	20,71%
Total Exterior	24.576.128,74	0,00	0,00	23.774.236,44	-801.892,30	-3,26%		11,33%



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	85.479.104,91	18.535.292,58	1.589.187,30	104.763.624,69	2.338.414,50	2,25%	-
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.242.385,08	0,00	0,00	21.905.600,27	663.215,19	3,12%	3,12%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	21.298.733,57	0,00	0,00	21.879.277,50	580.543,93	2,73%	2,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	25.838.421,05	0,00	0,00	26.413.445,36	575.024,31	2,23%	2,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	16.662.565,35	0,00	602.151,30	16.593.751,70	533.337,65	3,20%	3,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	28.774.147,57	0,00	0,00	29.255.402,07	481.254,50	1,67%	1,67%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	12.077.612,52	0,00	0,00	12.379.821,11	302.208,59	2,50%	2,50%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.708.130,54	0,00	588.464,92	9.419.838,32	300.172,70	3,09%	3,24%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.761.048,75	0,00	0,00	10.025.371,88	264.323,13	2,71%	2,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.968.683,23	0,00	0,00	8.215.108,85	246.425,62	3,09%	3,09%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.643.907,70	0,00	0,00	8.877.577,65	233.669,95	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.349.741,44	0,00	0,00	10.531.883,32	182.141,88	1,76%	1,76%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.159.767,17	0,00	0,00	6.260.471,21	100.704,04	1,63%	1,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.562.659,68	0,00	5.635.594,18	0,00	72.934,50	1,31%	3,16%
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	0,00	38.157.002,02	33.393.117,89	4.822.865,41	58.981,28	0,15%	2,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.158.315,55	0,00	0,00	2.216.550,29	58.234,74	2,70%	2,70%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.019.125,88	0,00	0,00	13.050.757,74	31.631,86	0,24%	0,24%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	4.795.904,31	957.732,45	5.767.158,60	0,00	13.521,84	0,24%	2,47%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.888.587,20	0,00	0,00	8.901.802,25	13.215,05	0,15%	0,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIAR...	591.392,96	0,00	599.414,58	0,00	8.021,62	1,36%	3,15%

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	28.173,22	0,00	0,00	28.865,21	691,99	2,46%	2,46%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.764.260,86	0,00	0,00	1.763.286,02	-974,84	-0,06%	-0,06%
Total Renda Fixa	300.772.668,54	57.650.027,05	48.175.088,77	317.305.300,85	7.057.694,03	2,27%	



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
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9.110.292,24	0,00	5.000.000,37	4.856.393,80	746.101,93	8,19%	9,70%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	9.703.188,55	0,00	0,00	9.902.606,06	199.417,51	2,06%	2,06%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.698.144,40	0,00	0,00	1.750.557,15	52.412,75	3,09%	3,09%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.044.991,98	44.991,98	0,90%	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.636.345,26	0,00	0,00	1.638.375,13	2.029,87	0,12%	0,12%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.084.619,51	0,00	0,00	1.045.767,35	-38.852,16	-3,58%	-3,58%
OCCAM FIC AÇÕES	2.899.358,67	0,00	0,00	2.854.274,62	-45.084,05	-1,55%	-1,55%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.879.420,76	0,00	0,00	7.812.509,56	-66.911,20	-0,85%	-0,85%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.730.595,19	0,00	0,00	3.641.516,78	-89.078,41	-2,39%	-2,39%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.723.772,75	0,00	0,00	1.615.507,73	-108.265,02	-6,28%	-6,28%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.821.007,63	0,00	0,00	2.702.939,38	-118.068,25	-4,19%	-4,19%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.748.250,00	0,00	41.250,00	1.575.000,00	-132.000,00	-7,55%	-9,91%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7.354.852,25	0,00	0,00	7.222.043,29	-132.808,96	-1,81%	-1,81%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.115.911,97	0,00	0,00	10.682.710,24	-433.201,73	-3,90%	-3,90%
Total Renda Variável	62.505.759,18	5.000.000,00	5.041.250,37	62.345.193,07	-119.315,74	-0,18%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.154.711,60	0,00	0,00	13.617.500,88	462.789,28	3,52%	3,52%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	4.636.063,54	0,00	0,00	4.993.745,69	357.682,15	7,72%	7,72%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.286.014,41	0,00	0,00	1.418.219,87	132.205,46	10,28%	10,28%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1.492.827,67	0,00	0,00	1.599.579,09	106.751,42	7,15%	7,15%
BB SCHRODER INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCA...	884.362,91	0,00	0,00	958.581,37	74.218,46	8,39%	8,39%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	1.380.363,75	0,00	0,00	1.186.609,54	-193.754,21	-14,04%	-14,04%
Total Exterior	22.834.343,88	0,00	0,00	23.774.236,44	939.892,56	4,12%	



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	5.828.535,46	97.281.038,19	3.701.058,76	104.763.624,69	5.355.109,80	5,19%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	48.113.243,58	0,00	25.000.005,63	26.413.445,36	3.300.207,41	6,86%	10,70%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	51.048.889,44	0,00	25.000.000,00	29.255.402,07	3.206.512,63	6,28%	9,30%
BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.676.529,44	13.590,22	132.230,01	21.905.600,27	2.347.710,62	11,92%	11,96%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	19.617.800,12	0,00	0,00	21.879.277,50	2.261.477,38	11,53%	11,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	535.595,94	15.659.747,13	708.599,29	16.593.751,70	1.107.007,92	6,84%	12,59%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	11.317.524,84	0,00	0,00	12.379.821,11	1.062.296,27	9,39%	9,39%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.518.442,57	0,00	10.000.000,00	10.531.883,32	1.013.440,75	5,19%	8,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.352.069,95	0,00	0,00	8.215.108,85	863.038,90	11,74%	11,74%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.718.356,25	0,00	544.800,85	10.025.371,88	851.816,48	8,77%	3,16%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.157.927,13	11.761.409,65	5.340.291,96	9.419.838,32	840.793,50	6,04%	12,94%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.610.515,00	0,00	484.752,83	8.877.577,65	751.815,48	8,73%	3,10%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.352.129,84	0,00	0,00	13.050.757,74	698.627,90	5,66%	5,66%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.619.055,79	0,00	10.000.000,00	6.260.471,21	641.415,42	4,11%	8,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	7.104.683,66	0,00	5.497.981,41	2.216.550,29	609.848,04	8,58%	10,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.176.190,47	0,00	5.781.552,34	0,00	605.361,87	11,70%	14,04%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.971.480,00	0,00	574.194,84	8.901.802,25	504.517,09	5,62%	-0,78%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.663.170,90	0,00	0,00	1.763.286,02	100.115,12	6,02%	6,02%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	353.407,08	49.270.008,14	49.704.580,39	0,00	81.165,17	0,16%	9,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIAR...	550.859,29	0,00	615.222,14	0,00	64.362,85	11,68%	13,98%

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
BANESTES INVEST PUBLIC AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CP	0,00	38.157.002,02	33.393.117,89	4.822.865,41	58.981,28	0,15%	9,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	26.320,42	0,00	0,00	28.865,21	2.544,79	9,67%	9,67%
Total Renda Fixa	255.312.727,17	212.142.795,35	176.478.388,34	317.305.300,85	26.328.166,67	9,05%	

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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	8.705.904,27	0,00	0,00	9.902.606,06	1.196.701,79	13,75%	13,75%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	6.967.568,17	0,00	0,00	7.222.043,29	254.475,12	3,65%	3,65%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	5.933.732,71	1.700.000,00	0,00	7.812.509,56	178.776,85	2,34%	2,47%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.510.123,08	0,00	0,00	1.638.375,13	128.252,05	8,49%	8,49%
OCCAM FIC AÇÕES	2.730.829,83	0,00	0,00	2.854.274,62	123.444,79	4,52%	4,52%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.579.597,45	0,00	0,00	2.702.939,38	123.341,93	4,78%	4,78%
BANESTES DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.628.571,03	0,00	0,00	1.750.557,15	121.986,12	7,49%	7,49%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	0,00	5.000.000,00	0,00	5.044.991,98	44.991,98	0,90%	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.706.000,00	0,00	150.000,00	1.575.000,00	19.000,00	1,11%	-7,68%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.669.215,98	0,00	0,00	3.641.516,78	-27.699,20	-0,75%	-0,75%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.145.345,55	0,00	0,00	1.045.767,35	-99.578,20	-8,69%	-8,69%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.797.918,39	0,00	0,00	1.615.507,73	-182.410,66	-10,15%	-10,15%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.194.859,29	0,00	0,00	10.682.710,24	-512.149,05	-4,57%	-4,57%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11.353.170,79	0,00	5.000.000,37	4.856.393,80	-1.496.776,62	-13,18%	-11,97%
Total Renda Variável	60.922.836,54	6.700.000,00	5.150.000,37	62.345.193,07	-127.643,10	-0,20%	

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...	1.214.576,21	0,00	0,00	958.581,37	-255.994,84	-21,08%	-21,08%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.824.211,38	0,00	0,00	1.418.219,87	-405.991,51	-22,26%	-22,26%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.040.422,82	0,00	0,00	1.599.579,09	-440.843,73	-21,61%	-21,61%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	6.582.500,44	0,00	0,00	4.993.745,69	-1.588.754,75	-24,14%	-24,14%
GENIAL MS US GROWTH INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	3.180.930,68	0,00	0,00	1.186.609,54	-1.994.321,14	-62,70%	-62,70%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	21.000.357,90	0,00	1.700.000,00	13.617.500,88	-5.682.857,02	-27,06%	-28,54%
Total Exterior	35.842.999,43	0,00	1.700.000,00	23.774.236,44	-10.368.762,99	-28,93%	

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.

