

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
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.499.815,88	1,58%	324	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	318.827,11	0,08%	963	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	80.397.820,14	19,50%	1.180	1,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	14.708.628,84	3,57%	3.823	14,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	5.083.046,99	1,23%	75	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+0	Não há	18.057.835,92	4,38%	57	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	58.507,85	0,01%	895	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	12.037.112,78	2,92%	1.060	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	78.996.220,84	19,16%	1.000	0,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.210.652,19	0,78%	361	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	43.603.540,38	10,57%	477	1,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	11.546.432,69	2,80%	7.598	0,89%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	8.708.302,50	2,11%	1.424	2,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.190.367,58	1,74%	3.851	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.849.464,69	0,93%	25.252	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.805.746,35	0,92%	580	2,04%	Artigo 8º, Inciso I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	5.952.937,72	1,44%	718	1,09%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	8.444.287,28	2,05%	41	0,77%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	5.388.343,46	1,31%	1.795	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	14.272.086,97	3,46%	2.534	4,16%	Artigo 8º, Inciso I

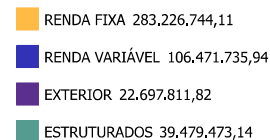
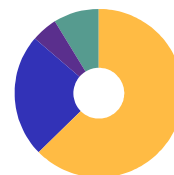


Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.305.113,75	1,77%	50	0,58%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.970.436,52	1,45%	203	3,60%	Artigo 8º, Inciso I
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	4.813.478,48	1,17%	2.419	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	882.965,62	0,21%	56	0,15%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	2.183.171,79	0,53%	57	1,84%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	5.425.085,75	1,32%	7.977	1,01%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.418.261,61	2,04%	529	0,92%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	5.788.327,05	1,40%	85.574	0,41%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	6.453.243,23	1,56%	30.568	0,87%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	7.399.244,31	1,79%	2.513	1,70%	Artigo 10º, Inciso I
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	D+32	Não há	5.020.852,90	1,22%	70	3,79%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	5.014.331,67	1,22%	21	2,43%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	15.591.801,03	3,78%	947	1,37%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			412.396.291,87				

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

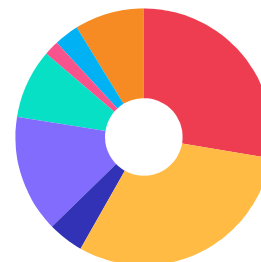
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	13,00%	50,00%	206.198.145,94
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	125.065.974,88	30,33%	20,00%	34,00%	80,00%	204.851.058,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	12.371.888,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	137.906.034,04	33,44%	10,00%	15,00%	60,00%	109.531.741,08
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	41.239.629,19
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	20.254.735,19	4,91%	0,00%	5,00%	5,00%	365.079,40
Total Renda Fixa	100,00%	283.226.744,11	68,68%	30,00%	67,00%	208,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	66.992.262,80	16,24%	10,00%	18,00%	30,00%	56.726.624,76
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	39.479.473,14	9,57%	3,00%	9,00%	10,00%	1.760.156,05
Total Renda Variável / Estruturado	30,00%	106.471.735,94	25,82%	13,00%	27,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	8.491.223,16	2,06%	3,00%	3,00%	10,00%	32.748.406,03
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	14.206.588,66	3,44%	4,00%	6,00%	10,00%	27.033.040,53
Total Exterior	10,00%	22.697.811,82	5,50%	7,00%	9,00%	20,00%	



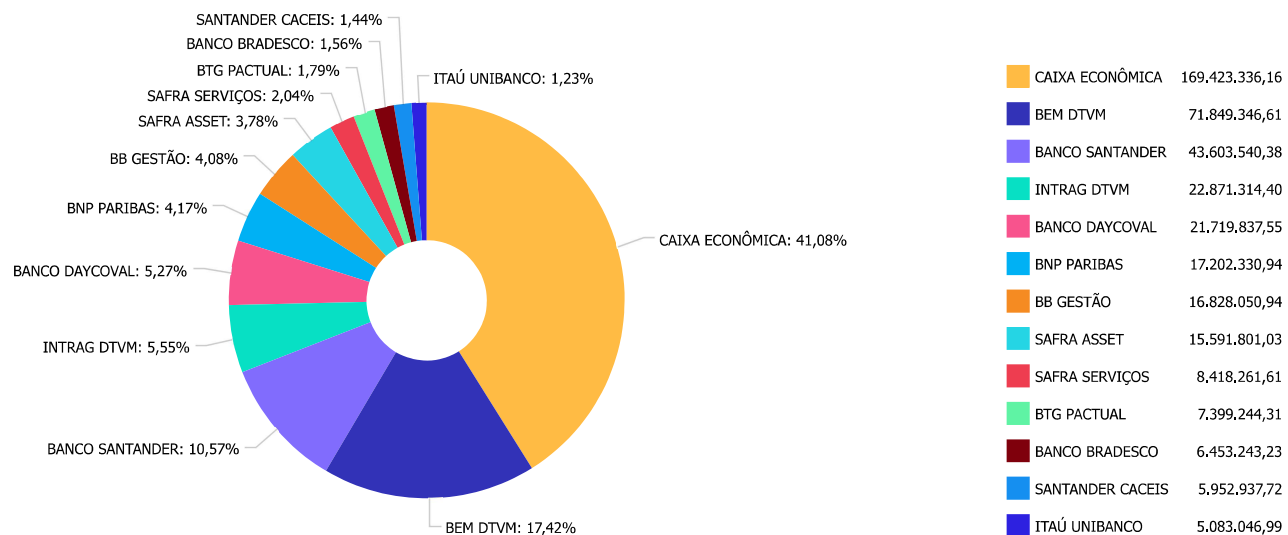
Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	169.423.336,16	41,08	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	43.603.540,38	10,57	0,01
SOMMA INVESTIMENTOS	22.980.389,47	5,57	-
ICATU VANGUARDA	19.729.481,74	4,78	0,04
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	18.057.835,92	4,38	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.828.050,94	4,08	-
SAFRA ASSET MANAGEMENT	15.591.801,03	3,78	0,01
TARPON INVESTIMENTOS	13.275.550,27	3,22	0,21
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	11.546.432,69	2,80	0,10
GUEPARDO INVESTIMENTOS	8.444.287,28	2,05	0,25
BANCO J. SAFRA S/A	8.418.261,61	2,04	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	7.399.244,31	1,79	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	7.190.367,58	1,74	0,02
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.453.243,23	1,56	0,00
CLARITAS INVESTIMENTOS	5.952.937,72	1,44	0,06
WESTERN ASSET	5.788.327,05	1,40	0,01
XP ASSET MANAGEMENT	5.425.085,75	1,32	-
OCCAM BRASIL	5.388.343,46	1,31	0,03
ITAÚ UNIBANCO	5.083.046,99	1,23	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	5.014.331,67	1,22	0,34
TRUXT INVESTIMENTOS	4.813.478,48	1,17	0,02
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.805.746,35	0,92	0,01
GENIAL INVESTIMENTOS	2.183.171,79	0,53	

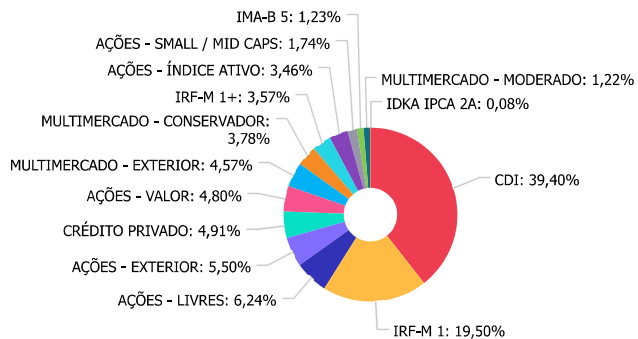
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	125.065.974,88	30,33	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	137.906.034,04	33,44	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20.254.735,19	4,91	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	66.992.262,80	16,24	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	8.491.223,16	2,06	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	14.206.588,66	3,44	4,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	39.479.473,14	9,57	3,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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



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

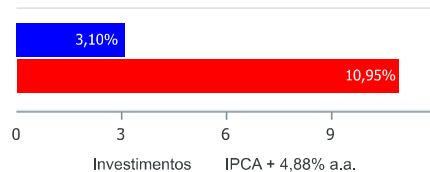


■ CDI	162.463.685,84	■ IRF-M 1	80.397.820,14	■ AÇÕES - LIVRES	25.744.239,79
■ AÇÕES - EXTERIOR	22.697.811,82	■ CRÉDITO PRIVADO	20.254.735,19	■ AÇÕES - VALOR	19.785.568,46
■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	18.866.819,21	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	15.591.801,03	■ IRF-M 1+	14.708.628,84
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.272.086,97	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.190.367,58	■ IMA-B 5	5.083.046,99
■ MULTIMERCADO - MODERADO	5.020.852,90	■ IDKA IPCA 2A	318.827,11		

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	374.430.502,58	153.659.829,25	152.490.900,46	373.817.254,13	-1.782.177,24	-1.782.177,24	-0,47%	-0,47%	0,94%	0,94%	-50,48%	3,89%
Fevereiro	373.817.254,13	24.706.537,16	21.173.345,95	375.852.318,75	-1.498.126,59	-3.280.303,83	-0,40%	-0,87%	1,37%	2,33%	-37,38%	3,67%
Março	375.852.318,75	57.806.868,57	55.702.797,04	384.461.325,21	6.504.934,93	3.224.631,10	1,72%	0,84%	2,04%	4,42%	18,94%	4,42%
Abril	384.461.325,21	5.129.998,19	5.767.531,21	374.138.871,26	-9.684.920,93	-6.460.289,83	-2,52%	-1,70%	1,42%	5,90%	-28,86%	3,88%
Mai	374.138.871,26	72.354.309,99	66.936.413,63	382.546.343,93	2.989.576,31	-3.470.713,52	0,79%	-0,93%	0,89%	6,85%	-13,58%	4,25%
Junho	382.546.343,93	16.504.457,81	15.099.441,64	374.153.574,38	-9.797.785,72	-13.268.499,24	-2,55%	-3,46%	1,07%	7,99%	-43,28%	4,00%
Julho	374.153.574,38	17.766.685,51	16.361.803,02	385.940.262,06	10.381.805,19	-2.886.694,05	2,76%	-0,79%	-0,28%	7,68%	-10,27%	3,33%
Agosto	385.940.262,06	64.022.885,37	62.606.526,81	393.661.624,37	6.305.003,75	3.418.309,70	1,63%	0,83%	0,07%	7,76%	10,64%	3,22%
Setembro	393.661.624,37	27.015.421,98	25.520.766,89	395.316.118,07	159.838,61	3.578.148,31	0,04%	0,87%	0,11%	7,88%	11,01%	3,04%
Outubro	395.316.118,07	21.092.617,00	19.464.692,39	406.527.747,11	9.583.704,43	13.161.852,74	2,41%	3,30%	0,97%	8,92%	37,00%	4,02%
Novembro	406.527.747,11	31.694.417,89	30.750.692,05	407.194.592,30	-276.880,65	12.884.972,09	-0,07%	3,23%	0,79%	9,79%	33,03%	4,90%
Dezembro	407.194.592,30	74.707.974,76	68.972.668,35	412.396.291,87	-533.606,84	12.351.365,25	-0,13%	3,10%	1,06%	10,95%	28,30%	2,94%

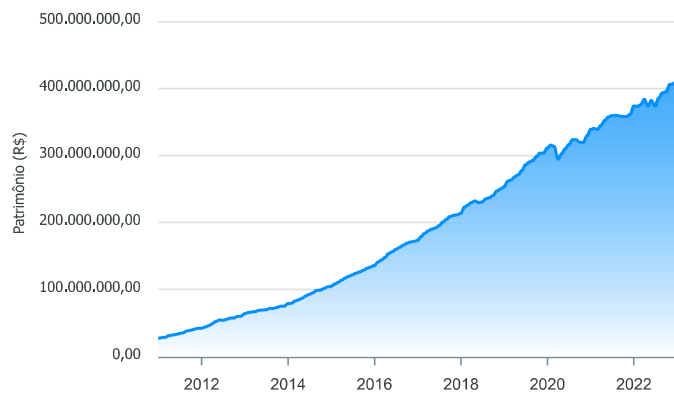
Investimentos x Meta de Rentabilidade



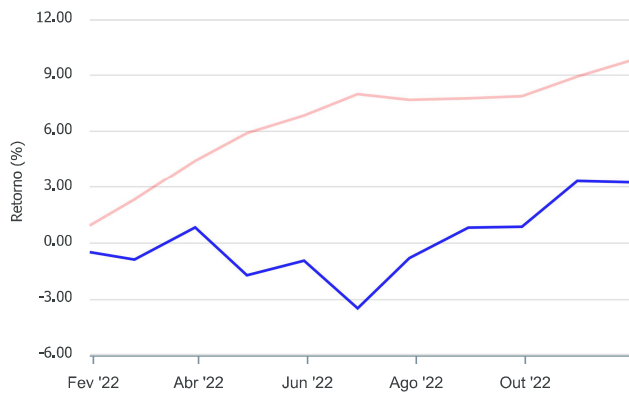
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 (%)	(%) Instt	Var - Mês
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	14.529.076,02	0,00	0,00	14.708.628,84	179.552,82	1,24%	1,24%	4,49%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	8.603.341,24	0,00	0,00	8.708.302,50	104.961,26	1,22%	1,22%	0,03%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.407.337,78	0,00	0,00	11.546.432,69	139.094,91	1,22%	1,22%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-JM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	79.480.162,40	0,00	0,00	80.397.820,14	917.657,74	1,15%	1,15%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	78.098.328,14	0,00	0,00	78.996.220,84	897.892,70	1,15%	1,15%	0,03%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.174.785,17	0,00	0,00	3.210.652,19	35.867,02	1,13%	1,13%	0,02%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	62.959.865,54	0,00	20.000.000,00	43.603.540,38	643.674,84	1,02%	1,14%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	5.036.477,75	0,00	0,00	5.083.046,99	46.569,24	0,92%	0,92%	1,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	178.167,07	138.401,94	0,00	318.827,11	2.258,10	0,71%	1,23%	1,30%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	0,00	18.000.000,00	0,00	18.057.835,92	57.835,92	0,32%	1,11%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	12.000.000,00	0,00	12.037.112,78	37.112,78	0,31%	1,12%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	956.055,47	97,71	899.095,09	58.507,85	1.449,76	0,15%	1,03%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1.713.558,06	37.569.475,11	32.822.882,24	6.499.815,88	39.664,95	0,10%	0,96%	0,00%
PORTO SEGURO IMA-B 5 FIC RENDA FIXA LP	6.125.433,35	0,00	6.131.070,03	0,00	5.636,68	0,09%	0,88%	1,25%
Total Renda Fixa	272.262.587,99	67.707.974,76	59.853.047,36	283.226.744,11	3.109.228,72	1,11%		0,29%

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 FI MULTIMERCADO	4.941.402,23	0,00	0,00	5.014.331,67	72.929,44	1,48%	1,48%	1,74%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	13.444.168,72	2.000.000,00	0,00	15.591.801,03	147.632,31	0,96%	1,05%	0,10%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.020.852,90	20.852,90	0,42%	0,48%	2,70%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	6.050.862,29	0,00	0,00	5.970.436,52	-80.425,77	-1,33%	-1,33%	14,22%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.322.414,42	0,00	0,00	7.190.367,58	-132.046,84	-1,80%	-1,80%	8,16%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	14.574.838,21	0,00	0,00	14.272.086,97	-302.751,24	-2,08%	-2,08%	9,44%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	6.096.246,07	0,00	0,00	5.952.937,72	-143.308,35	-2,35%	-2,35%	11,30%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.950.855,00	0,00	0,00	3.849.464,69	-101.390,31	-2,57%	-2,57%	9,73%
OCCAM FIC AÇÕES	5.535.723,69	0,00	0,00	5.388.343,46	-147.380,23	-2,66%	-2,66%	7,17%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.916.774,17	0,00	0,00	3.805.746,35	-111.027,82	-2,83%	-2,83%	10,59%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.956.769,55	0,00	0,00	4.813.478,48	-143.291,07	-2,89%	-2,89%	12,31%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.731.253,06	0,00	0,00	8.444.287,28	-286.965,78	-3,29%	-3,29%	12,59%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7.670.685,81	0,00	0,00	7.305.113,75	-365.572,06	-4,77%	-4,77%	12,48%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.777.668,15	0,00	0,00	7.399.244,31	-378.423,84	-4,87%	-4,87%	8,35%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	6.785.319,82	0,00	0,00	6.453.243,23	-332.076,59	-4,89%	-4,89%	8,34%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.667.804,54	0,00	9.119.620,99	0,00	-548.183,55	-5,67%	-4,84%	8,32%
Total Renda Variável	111.422.785,73	7.000.000,00	9.119.620,99	106.471.735,94	-2.831.428,80	-2,39%		8,06%

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...	2.169.355,15	0,00	0,00	2.183.171,79	13.816,64	0,64%	0,64%	11,86%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	889.936,75	0,00	0,00	882.965,62	-6.971,13	-0,78%	-0,78%	10,82%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	5.604.827,40	0,00	0,00	5.425.085,75	-179.741,65	-3,21%	-3,21%	14,90%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.014.574,44	0,00	0,00	5.788.327,05	-226.247,39	-3,76%	-3,76%	11,59%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.830.524,84	0,00	0,00	8.418.261,61	-412.263,23	-4,67%	-4,67%	10,31%
Total Exterior	23.509.218,58	0,00	0,00	22.697.811,82	-811.406,76	-3,45%		11,90%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	76.506.242,57	0,00	0,00	78.996.220,84	2.489.978,27	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	77.986.156,05	0,00	0,00	80.397.820,14	2.411.664,09	3,09%	3,09%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	61.660.474,87	0,00	20.000.000,00	43.603.540,38	1.943.065,51	3,15%	3,27%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.156.611,88	0,00	0,00	11.546.432,69	389.820,81	3,49%	3,49%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,00	8.500.000,00	0,00	8.708.302,50	208.302,50	2,45%	3,53%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	4.944.282,32	52.354.755,94	50.996.374,38	6.499.815,88	197.152,00	0,34%	2,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	18.191.568,93	7.001.851,77	25.309.411,59	58.507,85	174.498,74	0,69%	2,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	4.976.097,44	0,00	0,00	5.083.046,99	106.949,55	2,15%	2,49%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.111.097,53	0,00	0,00	3.210.652,19	99.554,66	3,20%	3,20%
PORTO SEGURO IMA-B 5 FIC RENDA FIXA LP	6.036.328,80	0,00	6.131.070,03	0,00	94.741,23	1,57%	2,37%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	0,00	18.000.000,00	0,00	18.057.835,92	57.835,92	0,32%	3,21%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	12.000.000,00	0,00	12.037.112,78	37.112,78	0,31%	3,22%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	7.614.737,70	0,00	7.631.575,80	0,00	16.838,10	0,22%	2,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	176.207,89	138.401,94	0,00	318.827,11	4.217,28	1,34%	2,36%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,00	15.000.000,00	0,00	14.708.628,84	-291.371,16	-1,94%	-0,57%
Total Renda Fixa	272.359.805,98	112.995.009,65	110.068.431,80	283.226.744,11	7.940.360,28	2,88%	

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.389.007,38	0,00	9.119.620,99	0,00	730.613,61	8,71%	9,67%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6.728.612,02	0,00	0,00	7.399.244,31	670.632,29	9,97%	9,97%
BRANCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	5.888.674,84	0,00	0,00	6.453.243,23	564.568,39	9,59%	9,59%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.735.799,17	3.500.000,00	0,00	15.591.801,03	356.001,86	2,34%	2,73%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4.971.929,30	0,00	0,00	5.014.331,67	42.402,37	0,85%	0,85%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.020.852,90	20.852,90	0,42%	5,69%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	0,00	6.000.000,00	0,00	5.952.937,72	-47.062,28	-0,78%	-3,96%
OCCAM FIC AÇÕES	5.473.453,83	0,00	0,00	5.388.343,46	-85.110,37	-1,55%	-1,55%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	3.943.629,90	0,00	0,00	3.849.464,69	-94.165,21	-2,39%	-2,39%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.907.783,75	0,00	0,00	4.813.478,48	-94.305,27	-1,92%	-1,92%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.978.413,89	0,00	0,00	3.805.746,35	-172.667,54	-4,34%	-4,34%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	14.504.066,99	0,00	0,00	14.272.086,97	-231.980,02	-1,60%	-1,60%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.457.502,85	0,00	0,00	7.190.367,58	-267.135,27	-3,58%	-3,58%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	7.689.101,49	0,00	0,00	7.305.113,75	-383.987,74	-4,99%	-4,99%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	6.409.986,51	0,00	0,00	5.970.436,52	-439.549,99	-6,86%	-6,86%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.907.516,16	0,00	0,00	8.444.287,28	-463.228,88	-5,20%	-5,20%
Total Renda Variável	100.985.478,08	14.500.000,00	9.119.620,99	106.471.735,94	105.878,85	0,10%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.100.399,06	0,00	0,00	8.418.261,61	317.862,55	3,92%	3,92%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.037.473,04	0,00	0,00	2.183.171,79	145.698,75	7,15%	7,15%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.684.272,77	0,00	0,00	5.788.327,05	104.054,28	1,83%	1,83%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	5.328.966,84	0,00	0,00	5.425.085,75	96.118,91	1,80%	1,80%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	819.722,30	0,00	0,00	882.965,62	63.243,32	7,72%	7,72%
Total Exterior	21.970.834,01	0,00	0,00	22.697.811,82	726.977,81	3,31%	

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
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.994.965,63	3.000.000,00	3.000.000,00	78.996.220,84	9.001.255,21	12,33%	12,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	72.769.139,81	300.000,00	80.397.820,14	7.928.680,33	10,90%	11,74%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	0,00	71.130.979,08	30.401.536,31	43.603.540,38	2.874.097,61	4,04%	12,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	15.702.520,95	3.000.000,00	15.000.000,00	5.083.046,99	1.380.526,04	7,38%	9,60%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	7.178.462,37	3.000.000,00	0,00	11.546.432,69	1.367.970,32	13,44%	13,61%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	36.923.611,47	12.000.000,00	38.245.276,92	12.037.112,78	1.358.778,23	2,78%	12,59%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	0,00	19.751.536,31	20.733.553,22	0,00	982.016,91	4,97%	9,57%
ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRI...	4.037.279,59	3.000.000,00	7.631.575,80	0,00	594.296,21	8,44%	10,95%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	8.636.714,99	125.101.923,16	127.785.658,56	6.499.815,88	546.836,29	0,41%	10,58%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	2.894.395,53	0,00	3.210.652,19	316.256,66	10,93%	12,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	64.000.000,00	64.269.139,81	0,00	269.139,81	0,42%	6,96%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.491,65	55.281.611,68	55.455.443,60	58.507,85	230.848,12	0,42%	11,26%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,00	8.500.000,00	0,00	8.708.302,50	208.302,50	2,45%	13,80%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.945.441,48	0,00	4.091.223,43	0,00	145.781,95	3,69%	8,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	29.600.000,00	29.737.582,33	0,00	137.582,33	0,46%	9,32%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	10.261.902,45	0,00	10.397.425,86	0,00	135.523,41	1,32%	9,51%
PORTO SEGURO IMA-B 5 FIC RENDA FIXA LP	0,00	6.000.000,00	6.131.070,03	0,00	131.070,03	2,18%	9,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	61.504.290,27	0,00	61.563.528,70	0,00	59.238,43	0,10%	9,67%
PORTO SEGURO SOBERANO FI RENDA FIXA REFERENCIADO D...	0,00	18.000.000,00	0,00	18.057.835,92	57.835,92	0,32%	12,47%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	6.800.422,37	0,00	6.849.442,47	0,00	49.020,10	0,72%	7,22%

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
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1.082.176,37	1.784.382,24	2.894.395,53	0,00	27.836,92	0,97%	10,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.880.515,15	438.401,94	2.014.382,24	318.827,11	14.292,26	0,62%	9,04%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,00	15.000.000,00	0,00	14.708.628,84	-291.371,16	-1,94%	4,43%
Total Renda Fixa	227.949.794,74	514.252.369,75	486.501.234,81	283.226.744,11	27.525.814,43	10,76%	

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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	6.363.222,13	0,00	0,00	7.305.113,75	941.891,62	14,80%	14,80%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,00	14.909.472,93	0,00	15.591.801,03	682.328,10	4,58%	14,01%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.337.434,64	0,00	4.668.450,70	0,00	331.016,06	7,63%	-0,35%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	13.109.569,86	0,00	13.407.677,97	0,00	298.108,11	2,27%	-3,47%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.589.443,21	2.000.000,00	0,00	4.813.478,48	224.035,27	4,88%	2,95%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.229.369,44	2.000.000,00	0,00	8.444.287,28	214.917,84	2,61%	4,55%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.680.533,51	0,00	0,00	3.805.746,35	125.212,84	3,40%	3,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.993.404,49	0,00	4.099.274,09	0,00	105.869,60	2,65%	-9,36%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.156.862,59	0,00	4.238.050,64	0,00	81.188,05	1,95%	2,07%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	0,00	3.800.000,00	0,00	3.849.464,69	49.464,69	1,30%	-0,75%
OCCAM FIC AÇÕES	3.363.583,95	2.000.000,00	0,00	5.388.343,46	24.759,51	0,46%	4,52%
ICATU VANGUARDA LONG BIASED FI MULTIMERCADO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.020.852,90	20.852,90	0,42%	17,00%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.014.331,67	14.331,67	0,29%	-
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	0,00	6.000.000,00	0,00	5.952.937,72	-47.062,28	-0,78%	8,32%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	13.347.829,21	1.000.000,00	0,00	14.272.086,97	-75.742,24	-0,53%	0,10%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	4.060.295,00	2.000.000,00	0,00	5.970.436,52	-89.858,48	-1,48%	3,01%
FINACAP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.072.157,19	3.000.000,00	4.937.152,89	0,00	-135.004,30	-2,66%	-
BAHIA AM VALUATION FIC AÇÕES	2.148.443,83	0,00	1.966.645,22	0,00	-181.798,61	-8,46%	2,49%
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	8.041.904,38	0,00	0,00	7.399.244,31	-642.660,07	-7,99%	-7,99%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.481.511,13	5.500.000,00	0,00	7.190.367,58	-791.143,55	-9,91%	-8,69%

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
BRDESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	7.964.451,00	160,80	500.000,00	6.453.243,23	-1.011.368,57	-12,70%	-12,45%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.453.853,57	0,00	9.119.620,99	0,00	-1.334.232,58	-12,76%	-11,99%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	12.896.761,26	0,00	11.409.472,13	0,00	-1.487.289,13	-11,53%	-11,92%
Total Renda Variável	111.290.630,39	52.209.633,73	54.346.344,63	106.471.735,94	-2.682.183,55	-1,64%	

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 NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	1.163.880,17	0,00	0,00	882.965,62	-280.914,55	-24,14%	-24,14%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.784.853,57	0,00	0,00	2.183.171,79	-601.681,78	-21,61%	-21,61%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	9.236.368,43	0,00	0,00	5.788.327,05	-3.448.041,38	-37,33%	-37,33%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.093.779,68	0,00	0,00	8.418.261,61	-3.675.518,07	-30,39%	-30,39%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	9.911.195,60	0,00	0,00	5.425.085,75	-4.486.109,85	-45,26%	-45,26%
Total Exterior	35.190.077,45	0,00	0,00	22.697.811,82	-12.492.265,63	-35,50%	

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.