

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro 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 (Novembro / 2022)

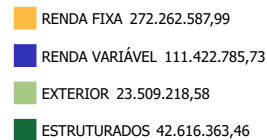
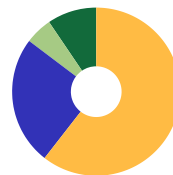
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.713.558,06	0,42%	325	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	178.167,07	0,04%	990	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	79.480.162,40	19,52%	1.176	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	14.529.076,02	3,57%	4.037	13,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	5.036.477,75	1,24%	77	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	956.055,47	0,23%	898	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	78.098.328,14	19,18%	985	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.174.785,17	0,78%	319	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	6.125.433,35	1,50%	173	3,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	62.959.865,54	15,46%	479	2,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	11.407.337,78	2,80%	7.380	0,92%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	8.603.341,24	2,11%	1.379	3,32%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.322.414,42	1,80%	3.986	0,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.950.855,00	0,97%	25.279	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.916.774,17	0,96%	593	2,01%	Artigo 8º, Inciso I
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	6.096.246,07	1,50%	727	1,14%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	8.731.253,06	2,14%	38	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	5.535.723,69	1,36%	1.881	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	14.574.838,21	3,58%	2.618	4,18%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.670.685,81	1,88%	50	0,58%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	D+32	Não há	6.050.862,29	1,49%	208	3,60%	Artigo 8º, Inciso I
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+3 du ...	Não há	4.956.769,55	1,22%	2.540	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	889.936,75	0,22%	57	0,15%	Artigo 9º, Inciso II
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+6 du	Não há	2.169.355,15	0,53%	60	1,84%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	5.604.827,40	1,38%	8.238	1,00%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.830.524,84	2,17%	558	0,87%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	6.014.574,44	1,48%	88.487	0,39%	Artigo 9º, Inciso III
BRADERCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	6.785.319,82	1,67%	31.253	0,85%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	D+2 du	Não há	7.777.668,15	1,91%	2.644	1,75%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCA...	D+3 du	25 meses	4.941.402,23	1,21%	21	2,43%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.444.168,72	3,30%	893	1,30%	Artigo 10º, Inciso I
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	9.667.804,54	2,37%	30.844	0,92%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			407.194.592,30				

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

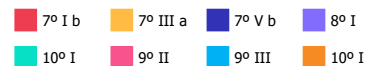
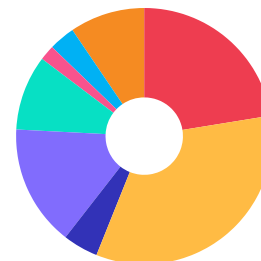
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	13,00%	50,00%	203.597.296,15
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100.937.441,30	24,79%	20,00%	34,00%	80,00%	224.818.232,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	3,00%	12.215.837,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	151.314.467,67	37,16%	10,00%	15,00%	60,00%	93.002.287,71
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	40.719.459,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	20.010.679,02	4,91%	0,00%	5,00%	5,00%	349.050,60
Total Renda Fixa	100,00%	272.262.587,99	66,86%	30,00%	67,00%	208,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	68.806.422,27	16,90%	10,00%	18,00%	30,00%	53.351.955,42
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	42.616.363,46	10,47%	3,00%	9,00%	10,00%	-1.896.904,23
Total Renda Variável / Estruturado	30,00%	111.422.785,73	27,36%	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%	8.664.119,30	2,13%	3,00%	3,00%	10,00%	32.055.339,93
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	14.845.099,28	3,65%	4,00%	6,00%	10,00%	25.874.359,95
Total Exterior	10,00%	23.509.218,58	5,77%	7,00%	9,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	162.645.000,84	39,94	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	62.959.865,54	15,46	0,01
SOMMA INVESTIMENTOS	23.178.179,45	5,69	-
WESTERN ASSET	15.682.378,98	3,85	0,03
ICATU VANGUARDA	14.529.076,02	3,57	0,03
TARPON INVESTIMENTOS	13.721.548,10	3,37	0,20
SAFRA ASSET MANAGEMENT	13.444.168,72	3,30	0,01
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	11.407.337,78	2,80	0,10
BANCO J. SAFRA S/A	8.830.524,84	2,17	0,00
GUEPARDO INVESTIMENTOS	8.731.253,06	2,14	0,25
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	7.777.668,15	1,91	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	7.322.414,42	1,80	0,02
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.785.319,82	1,67	0,00
PORTO SEGURO INVESTIMENTOS	6.125.433,35	1,50	-
CLARITAS INVESTIMENTOS	6.096.246,07	1,50	0,06
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.796.847,22	1,42	-
XP ASSET MANAGEMENT	5.604.827,40	1,38	0,02
OCCAM BRASIL	5.535.723,69	1,36	0,03
ITAÚ UNIBANCO	5.036.477,75	1,24	0,00
TRUXT INVESTIMENTOS	4.956.769,55	1,22	0,02
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.941.402,23	1,21	0,33
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.916.774,17	0,96	0,01
GENIAL INVESTIMENTOS	2.169.355,15	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 '	100.937.441,30	24,79	20,00	80,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	151.314.467,67	37,16	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20.010.679,02	4,91	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	68.806.422,27	16,90	10,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	8.664.119,30	2,13	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	14.845.099,28	3,65	4,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	42.616.363,46	10,47	3,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,77%	8,00%	1,63%	1,56%	8,90%	15,34%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,71%	7,71%	1,63%	1,45%	8,49%	14,60%	2,08%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,94%	10,71%	3,09%	6,43%	11,68%	14,31%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	10,46%	3,02%	6,31%	11,40%	13,77%	0,19%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,33%	8,76%	2,00%	2,36%	9,62%	15,81%	-	-
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC RENDA FIXA LP	-0,36%	8,41%	1,90%	2,27%	9,30%	15,64%	2,20%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	-0,35%	8,59%	1,96%	2,28%	9,43%	15,37%	1,96%	0,03%
IRF-M (Benchmark)	-0,66%	7,24%	1,66%	5,33%	9,26%	7,16%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-2,92%	3,15%	-0,16%	4,24%	6,76%	-2,11%	8,54%	0,07%
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,09%	12,25%	3,47%	7,08%	13,19%	20,00%	0,04%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,04%	11,39%	3,21%	6,61%	12,23%	16,93%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,01%	11,50%	3,19%	6,59%	12,34%	17,00%	0,03%	0,00%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	11,60%	3,25%	6,71%	12,51%	17,51%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,94%	10,12%	2,91%	5,99%	10,86%	13,84%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,88%	9,52%	2,73%	5,63%	10,21%	13,23%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,10%	12,43%	3,61%	7,40%	13,38%	20,44%	0,04%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	5,38%	-14,39%	3,16%	-1,26%	-10,66%	12,66%	-	-
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	6,20%	-3,29%	9,81%	8,05%	2,01%	33,45%	14,08%	0,23%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,01%	-7,52%	5,32%	3,52%	-2,44%	26,39%	14,10%	0,24%

IBX (Benchmark)	-3,11%	6,82%	2,24%	0,20%	10,17%	3,57%	-	-
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-6,63%	10,93%	-0,78%	-4,05%	15,99%	10,12%	14,55%	0,23%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	-6,63%	10,93%	-0,78%	-4,05%	15,99%	10,12%	14,55%	0,23%

Ibovespa (Benchmark)	-3,06%	7,31%	2,71%	1,02%	10,37%	3,30%	-	-
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-9,23%	6,02%	0,08%	2,26%	7,19%	-2,17%	15,45%	0,23%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-3,87%	2,23%	0,86%	-2,86%	4,61%	-2,18%	13,16%	0,22%
OCCAM FIC AÇÕES	-5,26%	7,38%	1,01%	1,90%	11,13%	3,17%	11,52%	0,20%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-4,00%	1,86%	-0,17%	-4,20%	5,49%	5,43%	13,67%	0,21%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	-11,20%	4,39%	-1,24%	0,43%	15,95%	18,36%	14,34%	0,30%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-10,24%	20,55%	3,46%	12,00%	31,49%	50,22%	14,97%	0,27%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,55%	8,10%	-0,60%	2,31%	8,20%	28,61%	14,39%	0,29%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-7,76%	6,42%	-1,91%	-3,76%	10,41%	-2,99%	14,26%	0,23%

SMLL (Benchmark)	-11,23%	-12,42%	-6,49%	-8,76%	-9,10%	-21,09%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-9,83%	-7,02%	-3,96%	-6,16%	-4,87%	-10,18%	14,88%	0,22%

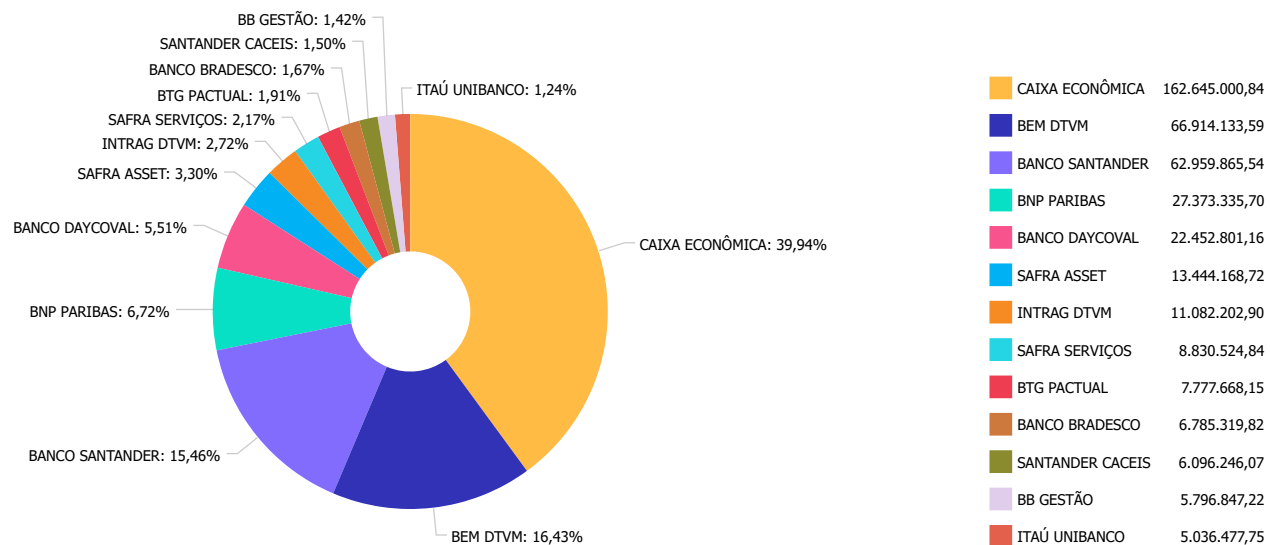
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	6,01%	-7,94%	5,24%	3,26%	-2,90%	25,23%	14,19%	0,24%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,82%	12,82%	3,10%	6,71%	13,65%	16,66%	0,17%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-1,10%	-	-	-	-	-	3,32%	-

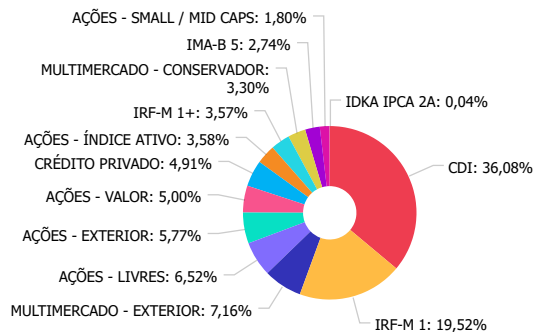
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,09%	-24,89%	-0,58%	4,59%	-23,60%	1,33%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6,55%	-26,98%	1,53%	5,49%	-24,46%	-1,88%	21,05%	0,21%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,15%	-34,88%	-1,98%	4,60%	-35,09%	-16,19%	23,82%	0,24%
MSCI WORLD (Benchmark)	7,55%	-20,13%	5,86%	9,14%	-17,37%	4,59%	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	6,98%	-43,45%	-4,77%	3,83%	-44,92%	-39,24%	21,70%	0,29%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	6,95%	-23,54%	1,14%	4,80%	-22,59%	3,34%	15,73%	0,22%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,36%	-20,71%	5,19%	8,20%	-18,19%	1,33%	-	-
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	6,72%	-22,10%	-0,28%	4,75%	-18,42%	-6,54%	17,69%	0,20%

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



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

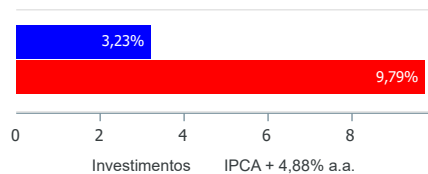


■ CDI	146.902.592,38	■ IRF-M 1	79.480.162,40	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	29.172.194,74
■ AÇÕES - LIVRES	26.545.946,82	■ AÇÕES - EXTERIOR	23.509.218,58	■ AÇÕES - VALOR	20.363.222,82
■ CRÉDITO PRIVADO	20.010.679,02	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	14.574.838,21	■ IRF-M 1+	14.529.076,02
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	13.444.168,72	■ IMA-B 5	11.161.911,10	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.322.414,42
■ IDKA IPCA 2A	178.167,07				

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%

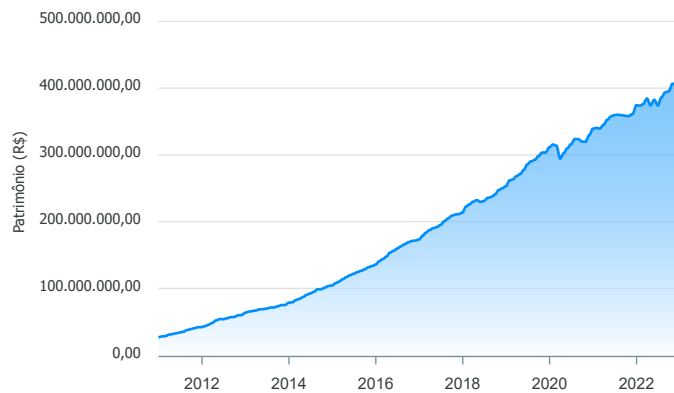
Investimentos x Meta de Rentabilidade



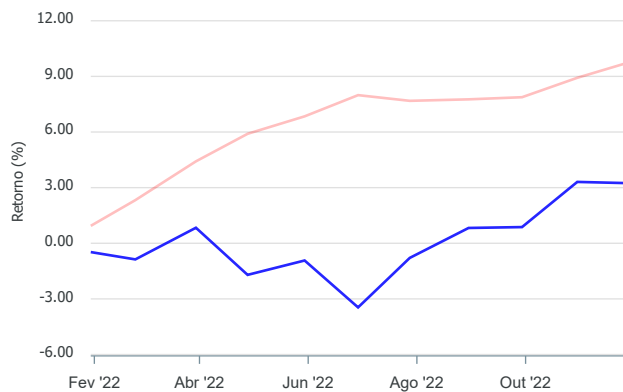
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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 Novembro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	8.509.713,55	0,00	0,00	8.603.341,24	93.627,69	1,10%	1,10%	0,04%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.284.669,99	0,00	0,00	11.407.337,78	122.667,79	1,09%	1,09%	0,04%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	62.307.541,82	0,00	0,00	62.959.865,54	652.323,72	1,05%	1,05%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	77.295.918,15	0,00	0,00	78.098.328,14	802.409,99	1,04%	1,04%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.142.932,62	0,00	0,00	3.174.785,17	31.852,55	1,01%	1,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	78.754.322,92	0,00	0,00	79.480.162,40	725.839,48	0,92%	0,92%	0,19%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	13.708.830,24	3.692.663,83	15.744.182,04	1.713.558,06	56.246,03	0,32%	0,88%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	8.944.508,80	7.001.754,06	15.006.510,01	956.055,47	16.302,62	0,10%	0,93%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	5.053.938,17	0,00	0,00	5.036.477,75	-17.460,42	-0,35%	-0,35%	1,96%
PORTO SEGURO IMA-B5 FIC RENDA FIXA LP	6.147.440,19	0,00	0,00	6.125.433,35	-22.006,84	-0,36%	-0,36%	2,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	179.432,59	0,00	0,00	178.167,07	-1.265,52	-0,71%	-0,71%	2,08%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,00	15.000.000,00	0,00	14.529.076,02	-470.923,98	-3,14%	-2,92%	8,54%
Total Renda Fixa	275.329.249,04	25.694.417,89	30.750.692,05	272.262.587,99	1.989.613,11	0,72%		0,61%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BTG PACTUAL S&P 500 BRL FI MULTIMERCADO	7.323.658,27	0,00	0,00	7.777.668,15	454.009,88	6,20%	6,20%	14,08%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.119.735,99	0,00	0,00	9.667.804,54	548.068,55	6,01%	6,01%	14,10%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	6.400.722,79	0,00	0,00	6.785.319,82	384.597,03	6,01%	6,01%	14,19%
CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	0,00	6.000.000,00	0,00	6.096.246,07	96.246,07	1,60%	-6,63%	14,55%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	13.335.201,25	0,00	0,00	13.444.168,72	108.967,47	0,82%	0,82%	0,17%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	4.996.318,43	0,00	0,00	4.941.402,23	-54.916,20	-1,10%	-1,10%	3,32%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	15.161.628,77	0,00	0,00	14.574.838,21	-586.790,56	-3,87%	-3,87%	13,16%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4.115.608,42	0,00	0,00	3.950.855,00	-164.753,42	-4,00%	-4,00%	13,67%
OCCAM FIC AÇÕES	5.842.773,90	0,00	0,00	5.535.723,69	-307.050,21	-5,26%	-5,26%	11,52%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.246.359,19	0,00	0,00	3.916.774,17	-329.585,02	-7,76%	-7,76%	14,26%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.547.945,61	0,00	0,00	8.731.253,06	-816.692,55	-8,55%	-8,55%	14,39%
TRUXT I VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.460.766,52	0,00	0,00	4.956.769,55	-503.996,97	-9,23%	-9,23%	15,45%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8.120.655,99	0,00	0,00	7.322.414,42	-798.241,57	-9,83%	-9,83%	14,88%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	8.545.713,39	0,00	0,00	7.670.685,81	-875.027,58	-10,24%	-10,24%	14,97%
TARPON WAHOO FIC AÇÕES	6.814.309,60	0,00	0,00	6.050.862,29	-763.447,31	-11,20%	-11,20%	14,34%
Total Renda Variável	109.031.398,12	6.000.000,00	0,00	111.422.785,73	-3.608.612,39	-3,14%		11,92%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	5.239.369,10	0,00	0,00	5.604.827,40	365.458,30	6,98%	6,98%	21,70%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	832.076,68	0,00	0,00	889.936,75	57.860,07	6,95%	6,95%	15,73%
GENIAL MS GLOBAL BRANDS INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	2.032.797,29	0,00	0,00	2.169.355,15	136.557,86	6,72%	6,72%	17,69%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.288.024,97	0,00	0,00	8.830.524,84	542.499,87	6,55%	6,55%	21,05%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.774.831,91	0,00	0,00	6.014.574,44	239.742,53	4,15%	4,15%	23,82%
Total Exterior	22.167.099,95	0,00	0,00	23.509.218,58	1.342.118,63	6,05%		21,40%

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.

