

# 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)**

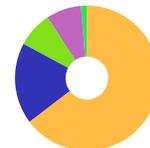
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	374.867,18	0,83%	987	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.661.723,99	3,67%	1.114	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.882.739,60	6,38%	324	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	610.336,05	1,35%	810	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.237.556,64	9,37%	963	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.629.296,88	8,03%	939	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	72.726,33	0,16%	739	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.026.900,53	2,27%	2.714	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.605.442,73	5,76%	158	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.138.889,50	4,73%	311	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.290.315,34	2,85%	217	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.522.281,70	10,00%	233	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.857.567,22	8,53%	316	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.850.424,77	6,30%	33	2,21%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	916.680,23	2,03%	32	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	754.211,74	1,67%	1.739	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	446.266,76	0,99%	3.276	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.171.071,02	4,80%	152	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	546.560,22	1,21%	194	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.005.469,77	4,44%	92	0,41%	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
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	951.827,45	2,11%	80	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	572.969,83	1,27%	20	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	551.938,34	1,22%	32	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.385.990,98	3,07%	186	0,44%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.385.167,37	3,06%	26	0,78%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.123.465,39	2,48%	125	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	644.570,22	1,43%		0,65%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>45.217.257,78</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	5,00%	59,24%	26.786.703,51
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	14.496.147,20	32,06%	12,37%	28,82%	59,24%	12.290.556,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	14.414.496,49	31,88%	11,91%	25,07%	52,31%	9.238.651,05
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	9.043.451,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	2.850.424,77	6,30%	0,00%	7,69%	7,69%	626.782,35
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,78%	5,00%	2.260.862,89
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>31.761.068,46</b>	<b>70,24%</b>	<b>24,28%</b>	<b>74,36%</b>	<b>203,48%</b>	



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

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	8.916.995,36	19,72%	11,21%	14,93%	25,00%	2.387.319,09
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	25,00%	11.304.314,45
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.894.623,74	8,61%	2,09%	2,78%	10,00%	627.102,04
Artigo 11º	5,00%	644.570,22	1,43%	0,00%	1,93%	1,93%	228.122,86
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>35,00%</b>	<b>13.456.189,32</b>	<b>29,76%</b>	<b>13,30%</b>	<b>20,64%</b>	<b>61,93%</b>	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.521.725,78
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.521.725,78
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.894.623,74	8,61%	2,09%	2,78%	10,00%	627.102,04
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>3.894.623,74</b>	<b>8,61%</b>	<b>2,09%</b>	<b>7,78%</b>	<b>30,00%</b>	

**Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)**

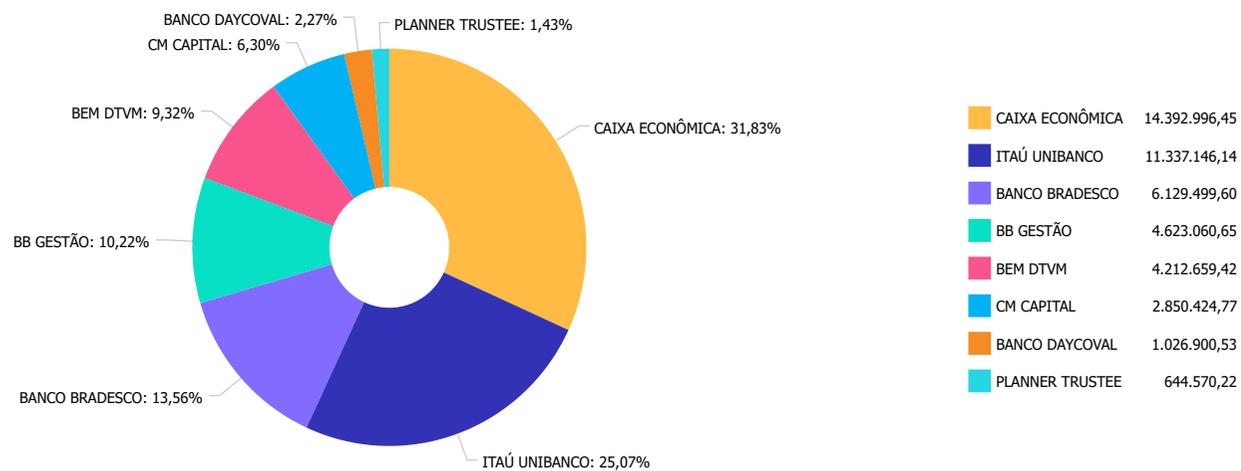
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	14.392.996,45	31,83	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.300.570,62	18,36	0,00
ITAU UNIBANCO	6.814.864,44	15,07	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.623.060,65	10,22	-
ITAU ASSET MANAGEMENT	4.522.281,70	10,00	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	2.850.424,77	6,30	0,59
TRÍGONO CAPITAL	1.124.908,17	2,49	0,02
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.026.900,53	2,27	0,01
AZ QUEST INVESTIMENTOS	916.680,23	2,03	0,00
ZION INVEST	644.570,22	1,43	-

**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)

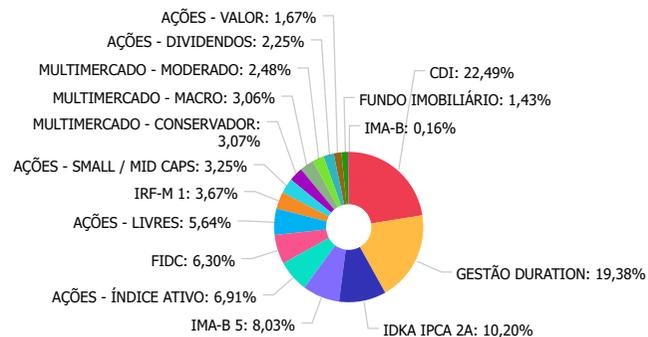
**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2022		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	59,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	14.496.147,20	32,06	12,37	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	14.414.496,49	31,88	11,91	52,31
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	2.850.424,77	6,30	0,00	7,69
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	8.916.995,36	19,72	11,21	25,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	25,00
Artigo 9º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.894.623,74	8,61	2,09	10,00
Artigo 11º	644.570,22	1,43	0,00	1,93

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



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

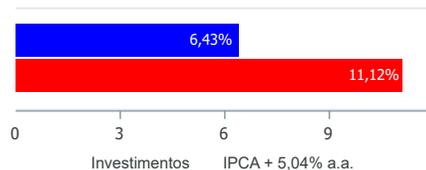


CDI	10.169.511,66	GESTÃO DURATION	8.764.961,01	IDKA IPCA 2A	4.612.423,82
IMA-B 5	3.629.296,88	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.122.898,47	FIDC	2.850.424,77
AÇÕES - LIVRES	2.552.029,99	IRF-M 1	1.661.723,99	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.468.618,57
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.385.990,98	MULTIMERCADO - MACRO	1.385.167,37	MULTIMERCADO - MODERADO	1.123.465,39
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.019.236,59	AÇÕES - VALOR	754.211,74	FUNDO IMOBILIÁRIO	644.570,22
IMA-B	72.726,33				

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	41.791.077,51	633.693,68	29.789,52	42.610.684,53	215.702,86	215.702,86	0,51%	0,51%	0,95%	0,95%	53,40%	3,23%
Fevereiro	42.610.684,53	1.197.771,01	1.237.690,40	42.902.946,76	332.181,62	547.884,48	0,78%	1,29%	1,39%	2,35%	54,97%	2,35%
Março	42.902.946,76	1.206.159,88	1.240.719,50	44.165.139,98	1.296.752,84	1.844.637,32	3,02%	4,35%	2,06%	4,46%	97,69%	3,57%
Abril	44.165.139,98	1.312.590,82	1.337.099,52	43.770.233,07	-370.398,21	1.474.239,11	-0,84%	3,48%	1,44%	5,96%	58,41%	2,82%
Mai	43.770.233,07	1.306.984,22	1.389.301,15	44.264.358,42	576.442,28	2.050.681,39	1,32%	4,84%	0,90%	6,91%	70,05%	2,67%
Junho	44.264.358,42	8.808.557,99	8.921.546,65	43.271.233,06	-880.136,70	1.170.544,69	-1,99%	2,76%	1,08%	8,07%	34,16%	2,69%
Julho	43.271.233,06	1.466.149,10	2.089.048,68	43.282.853,22	634.519,74	1.805.064,43	1,47%	4,26%	-0,27%	7,78%	54,83%	2,90%
Agosto	43.282.853,22	1.599.904,79	1.574.264,03	44.068.242,44	759.748,46	2.564.812,89	1,75%	6,09%	0,09%	7,87%	77,41%	3,09%
Setembro	44.068.242,44	1.626.551,63	1.418.258,33	44.396.006,03	119.470,29	2.684.283,18	0,27%	6,38%	0,12%	8,00%	79,74%	3,26%
Outubro	44.396.006,03	1.571.766,53	1.450.699,43	45.455.395,86	938.322,73	3.622.605,91	2,11%	8,62%	0,98%	9,06%	95,14%	3,99%
Novembro	45.455.395,86	6.704.270,01	5.493.363,85	45.819.815,48	-846.486,54	2.776.119,37	-1,81%	6,65%	0,80%	9,94%	66,93%	4,22%
Dezembro	45.819.815,48	2.854.517,56	3.363.719,51	45.217.257,78	-93.355,75	2.682.763,62	-0,20%	6,43%	1,07%	11,12%	57,88%	2,87%

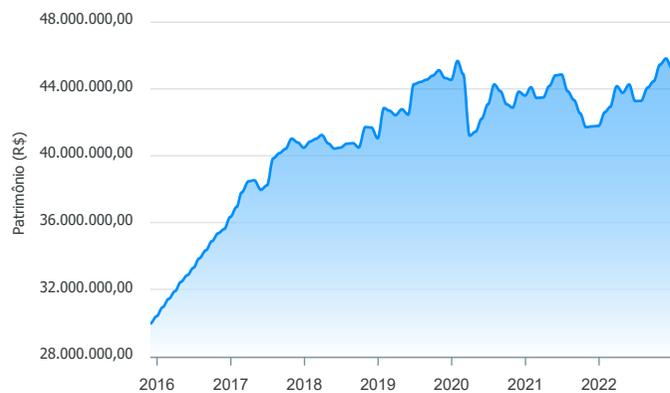
Investimentos x Meta de Rentabilidade



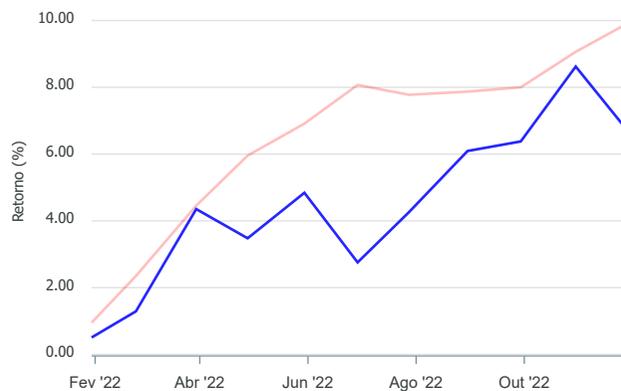
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.185.904,95	0,00	0,00	4.237.556,64	51.651,69	1,23%	1,23%	1,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	370.353,98	0,00	0,00	374.867,18	4.513,20	1,22%	1,22%	1,21%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.114.240,40	0,00	0,00	2.138.889,50	24.649,10	1,17%	1,17%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.642.716,46	0,00	0,00	1.661.723,99	19.007,53	1,16%	1,16%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.814.536,83	0,00	0,00	3.857.567,22	43.030,39	1,13%	1,13%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.276.245,24	0,00	0,00	1.290.315,34	14.070,10	1,10%	1,10%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.596.138,50	0,00	0,00	3.629.296,88	33.158,38	0,92%	0,92%	1,14%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.018.108,59	0,00	0,00	1.026.900,53	8.791,94	0,86%	0,86%	1,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.126.038,17	0,00	524.000,00	610.336,05	8.297,88	0,74%	1,14%	0,37%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.586.599,79	0,00	0,00	2.605.442,73	18.842,94	0,73%	0,73%	1,51%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	2.844.429,81	2.854.517,56	2.839.719,51	2.882.739,60	23.511,74	0,41%	0,96%	0,00%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.840.919,77	0,00	0,00	2.850.424,77	9.505,00	0,33%	0,33%	1,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	72.899,00	0,00	0,00	72.726,33	-172,67	-0,24%	-0,24%	2,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.539.066,49	0,00	0,00	4.522.281,70	-16.784,79	-0,37%	-0,37%	1,53%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>32.028.197,98</b>	<b>2.854.517,56</b>	<b>3.363.719,51</b>	<b>31.761.068,46</b>	<b>242.072,43</b>	<b>0,76%</b>		<b>0,82%</b>

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
BRABESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.369.745,40	0,00	0,00	1.385.167,37	15.421,97	1,13%	1,13%	0,13%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.371.554,40	0,00	0,00	1.385.990,98	14.436,58	1,05%	1,05%	0,56%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.115.976,97	0,00	0,00	1.123.465,39	7.488,42	0,67%	0,67%	1,71%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	451.229,66	0,00	0,00	446.266,76	-4.962,90	-1,10%	-1,10%	10,52%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	559.335,08	0,00	0,00	551.938,34	-7.396,74	-1,32%	-1,27%	9,87%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	933.528,82	0,00	0,00	916.680,23	-16.848,59	-1,80%	-1,80%	8,16%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	773.357,68	0,00	0,00	754.211,74	-19.145,94	-2,48%	-2,48%	9,73%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	560.454,67	0,00	0,00	546.560,22	-13.894,45	-2,48%	-2,48%	10,05%
BRABESCO SELECTION FI AÇÕES	2.228.559,15	0,00	0,00	2.171.071,02	-57.488,13	-2,58%	-2,58%	8,99%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	589.010,22	0,00	0,00	572.969,83	-16.040,39	-2,72%	-2,67%	11,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.103.022,37	0,00	0,00	2.005.469,77	-97.552,60	-4,64%	-4,64%	11,79%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	999.844,46	0,00	0,00	951.827,45	-48.017,01	-4,80%	-4,80%	11,90%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	735.998,62	0,00	0,00	644.570,22	-91.428,40	-12,42%	-13,35%	14,98%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>13.791.617,50</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.456.189,32</b>	<b>-335.428,18</b>	<b>-2,43%</b>		<b>7,72%</b>

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.139.875,55	0,00	0,00	4.237.556,64	97.681,09	2,36%	2,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.542.291,18	0,00	0,00	3.629.296,88	87.005,70	2,46%	2,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.090.856,96	2.700.000,00	0,00	3.857.567,22	66.710,26	1,76%	3,32%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	4.774.759,36	0,00	4.224.000,00	610.336,05	59.576,69	1,25%	2,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	2.051.080,22	6.860.554,10	6.083.782,79	2.882.739,60	54.888,07	0,62%	2,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.611.976,49	0,00	0,00	1.661.723,99	49.747,50	3,09%	3,09%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.090.840,50	1.000.000,00	0,00	2.138.889,50	48.049,00	2,30%	3,34%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.567.612,18	0,00	0,00	2.605.442,73	37.830,55	1,47%	1,47%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	692.301,53	570.000,00	0,00	1.290.315,34	28.013,81	2,22%	3,14%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.003.374,37	0,00	0,00	1.026.900,53	23.526,16	2,34%	2,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	366.003,58	0,00	0,00	374.867,18	8.863,60	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	72.652,18	0,00	0,00	72.726,33	74,15	0,10%	0,10%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.857.732,07	0,00	0,00	2.850.424,77	-7.307,30	-0,26%	-0,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.546.342,78	0,00	0,00	4.522.281,70	-24.061,08	-0,53%	-0,53%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>30.407.698,95</b>	<b>11.130.554,10</b>	<b>10.307.782,79</b>	<b>31.761.068,46</b>	<b>530.598,20</b>	<b>1,70%</b>	

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
BRADERCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.342.129,63	0,00	0,00	1.385.167,37	43.037,74	3,21%	3,21%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.348.572,18	0,00	0,00	1.385.990,98	37.418,80	2,77%	2,77%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	545.129,64	0,00	0,00	572.969,83	27.840,19	5,11%	5,11%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.100.841,17	0,00	0,00	1.123.465,39	22.624,22	2,06%	2,06%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	537.793,56	0,00	0,00	551.938,34	14.144,78	2,63%	2,63%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	551.241,31	0,00	0,00	546.560,22	-4.681,09	-0,85%	-0,85%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	457.355,08	0,00	0,00	446.266,76	-11.088,32	-2,42%	-2,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	769.513,51	0,00	0,00	754.211,74	-15.301,77	-1,99%	-1,99%
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	2.191.423,53	0,00	0,00	2.171.071,02	-20.352,51	-0,93%	-0,93%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	950.747,78	0,00	0,00	916.680,23	-34.067,55	-3,58%	-3,58%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1.060.934,42	0,00	0,00	951.827,45	-109.106,97	-10,28%	-10,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.220.626,98	0,00	0,00	2.005.469,77	-215.157,21	-9,69%	-9,69%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	911.998,29	0,00	0,00	644.570,22	-267.428,07	-29,32%	-30,08%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>13.988.307,08</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.456.189,32</b>	<b>-532.117,76</b>	<b>-3,80%</b>	

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.031.350,53	0,00	4.872.030,00	610.336,05	451.015,52	8,96%	10,70%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.449.135,22	500.000,00	1.100.000,00	4.237.556,64	388.421,42	7,85%	9,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.579.128,73	0,00	287.450,05	3.629.296,88	337.618,20	9,43%	9,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.717.614,17	500.000,00	0,00	4.522.281,70	304.667,53	7,22%	7,83%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.395.816,21	0,00	0,00	2.605.442,73	209.626,52	8,75%	8,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.487.263,90	0,00	1,65	1.661.723,99	174.461,74	11,73%	11,73%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	304.069,14	19.706.874,01	17.245.481,57	2.882.739,60	117.278,02	0,59%	10,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	3.750.000,00	0,00	3.857.567,22	107.567,22	2,87%	13,13%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.494.355,22	570.000,00	876.000,00	1.290.315,34	101.960,12	4,94%	12,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.281.198,65	0,00	1.000.000,00	374.867,18	93.668,53	7,31%	9,32%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	2.050.000,00	0,00	2.138.889,50	88.889,50	4,34%	13,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.588.078,83	0,00	1.596.200,00	72.726,33	80.847,50	5,09%	6,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.142.678,21	0,00	1.212.043,21	0,00	69.365,00	6,07%	9,51%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.026.900,53	26.900,53	2,69%	9,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.212.043,21	1.212.570,85	0,00	527,64	0,04%	11,26%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.204.186,72	0,00	143.723,24	2.850.424,77	-210.038,71	-6,56%	-11,04%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>29.674.875,53</b>	<b>29.288.917,22</b>	<b>29.545.500,57</b>	<b>31.761.068,46</b>	<b>2.342.776,28</b>	<b>3,97%</b>	

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
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.231.636,61	0,00	0,00	1.385.167,37	153.530,76	12,47%	12,47%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.239.973,29	0,00	0,00	1.385.990,98	146.017,69	11,78%	11,78%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.025.925,07	0,00	0,00	2.171.071,02	145.145,95	7,16%	7,16%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	987.697,79	0,00	0,00	1.123.465,39	135.767,60	13,75%	13,75%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	572.969,83	72.969,83	14,59%	14,01%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	0,00	500.000,00	0,00	551.938,34	51.938,34	10,39%	5,38%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	533.369,03	0,00	0,00	546.560,22	13.191,19	2,47%	2,47%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	633.141,67	0,00	0,00	644.570,22	11.428,55	1,81%	0,72%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	438.527,97	0,00	0,00	446.266,76	7.738,79	1,76%	1,76%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	781.326,02	0,00	0,00	754.211,74	-27.114,28	-3,47%	-3,47%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	996.351,74	0,00	0,00	916.680,23	-79.671,51	-8,00%	-8,00%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	1.035.682,88	0,00	0,00	951.827,45	-83.855,43	-8,10%	-8,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.212.569,91	0,00	0,00	2.005.469,77	-207.100,14	-9,36%	-9,36%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>12.116.201,98</b>	<b>1.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>13.456.189,32</b>	<b>339.987,34</b>	<b>2,59%</b>	

---

**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.

