

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

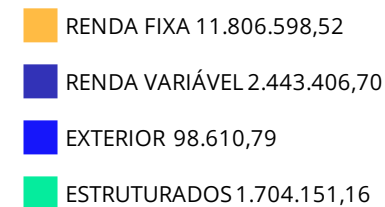
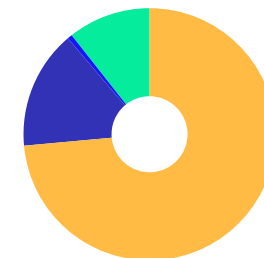
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.355.280,91	8,44%	987	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	170.580,65	1,06%	780	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	303.171,28	1,89%	356	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	302.429,93	1,88%	287	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	764.143,90	4,76%	810	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	68.762,78	0,43%	939	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	0,01	0,00%	739	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	0,01	0,00%	1.180	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	524.355,66	3,27%	297	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	304.549,81	1,90%	895	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	503.888,05	3,14%	213	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.431.420,75	21,38%	1.060	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	1.585.665,76	9,88%	217	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	201.251,13	1,25%	361	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.267.856,56	14,13%	233	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	563.895,27	3,51%	1.739	0,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	365.805,19	2,28%	3.276	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	522.781,83	3,26%	28	0,27%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	88.598,84	0,55%	1.302	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	D+3 du	Não há	150.776,87	0,94%	14.062	0,04%	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
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	524.073,46	3,26%	6.919	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	227.475,24	1,42%	92	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	98.610,79	0,61%	510	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	462.588,42	2,88%	186	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	763.666,51	4,76%	125	0,10%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	75.451,79	0,47%	8.904	0,00%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	402.444,44	2,51%	3.362	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIO...	Não se ...	Não se aplica	23.241,33	0,14%	2.056	0,02%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			16.052.767,17				

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

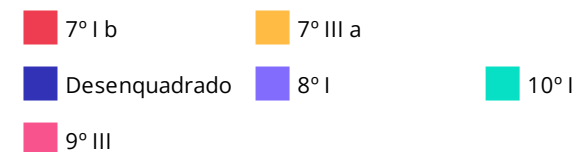
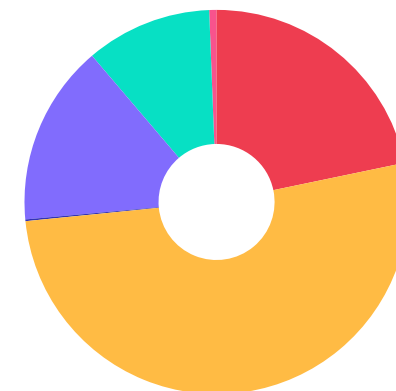
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	33,00%	59,24%	9.509.659,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.488.725,13	21,73%	24,38%	32,00%	59,24%	6.020.934,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	8.294.632,06	51,67%	1,13%	1,50%	50,00%	-268.248,48
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,50%	20,00%	3.210.553,43
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	802.638,36
Desenquadrado - RF	0,00%	23.241,33	0,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-23.241,33
Total Renda Fixa	100,00%	11.806.598,52	73,55%	25,51%	73,00%	193,48%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	2.443.406,70	15,22%	15,00%	18,70%	20,00%	767.146,73
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,30%	20,00%	3.210.553,43
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.704.151,16	10,62%	3,75%	5,00%	10,00%	-98.874,44
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.147.557,86	25,84%	18,75%	27,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	98.610,79	0,61%	0,00%	0,00%	10,00%	1.506.665,93
Total Exterior	10,00%	98.610,79	0,61%	0,00%	0,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.461.180,33	46,48	-
CAIXA DTVM	5.550.231,88	34,57	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	2.495.331,80	15,54	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	522.781,83	3,26	0,00
BV ASSET	23.241,33	0,14	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 5,50% ao ano (Benchmark)	1,09%	11,58%	2,98%	3,03%	11,58%	29,53%	-	-
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR - BBVH11	0,88%	-37,29%	-18,49%	-21,15%	-37,29%	-49,63%	-	0,25%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,24%	9,34%	2,25%	2,34%	9,34%	14,78%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	9,32%	2,42%	2,69%	9,32%	14,40%	1,21%	0,03%
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%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	9,51%	2,44%	2,86%	9,51%	14,19%	1,14%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,24%	6,20%	0,10%	1,87%	6,20%	4,57%	2,52%	0,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,24%	6,06%	0,17%	1,72%	6,06%	4,49%	2,46%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	1,48%	8,82%	1,74%	6,49%	8,82%	6,66%	-	-
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%

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
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,10%	12,11%	3,14%	6,49%	12,11%	16,71%	0,00%	0,00%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,03%	11,26%	2,95%	6,09%	11,26%	14,90%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,13%	12,76%	3,20%	6,69%	12,76%	17,85%	0,02%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,37%	7,83%	-0,53%	2,43%	7,83%	12,71%	1,53%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14%	10,70%	2,23%	5,84%	10,70%	10,58%	0,37%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	11,41%	3,98%	4,00%	11,41%	16,36%	0,60%	0,03%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	-	0,83%	0,84%	-	-	0,60%	-

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
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	-11,33%	-	-2,09%	-9,02%	-	-	12,91%	-
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%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	11,78%	2,78%	6,52%	11,78%	15,73%	0,56%	0,01%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,16%	13,45%	2,91%	6,55%	13,45%	18,12%	0,22%	0,01%
Global BDRX (Benchmark)	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-4,79%	-28,54%	3,52%	-0,98%	-28,54%	-6,74%	10,61%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-3,65%	-1,79%	-4,24%	6,84%	-1,79%	-16,98%	10,34%	0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,48%	-3,47%	-1,99%	5,53%	-3,47%	-8,07%	9,73%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,64%	-9,36%	-9,69%	1,51%	-9,36%	-24,85%	11,79%	0,25%
IBX (Benchmark)	-2,63%	4,02%	-0,39%	10,33%	4,02%	-7,61%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	-2,54%	5,24%	-0,37%	10,67%	5,24%	-10,85%	9,48%	0,21%
IDIV (Benchmark)	-1,61%	12,65%	3,15%	7,71%	12,65%	5,43%	-	-

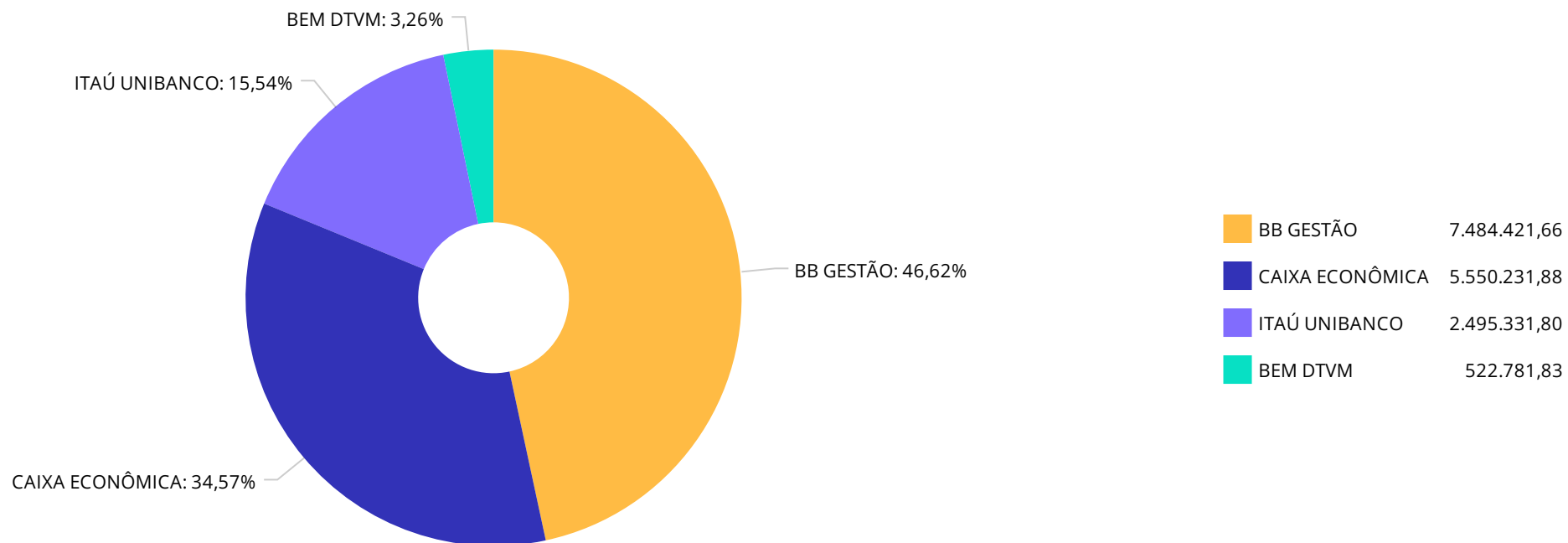
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,10%	1,77%	-2,42%	6,62%	1,77%	-5,19%	10,52%	0,20%
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%
SMLL (Benchmark)	-3,01%	-15,06%	-7,61%	5,76%	-15,06%	-28,82%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	-2,99%	-15,33%	-7,72%	5,14%	-15,33%	-29,83%	13,87%	0,29%

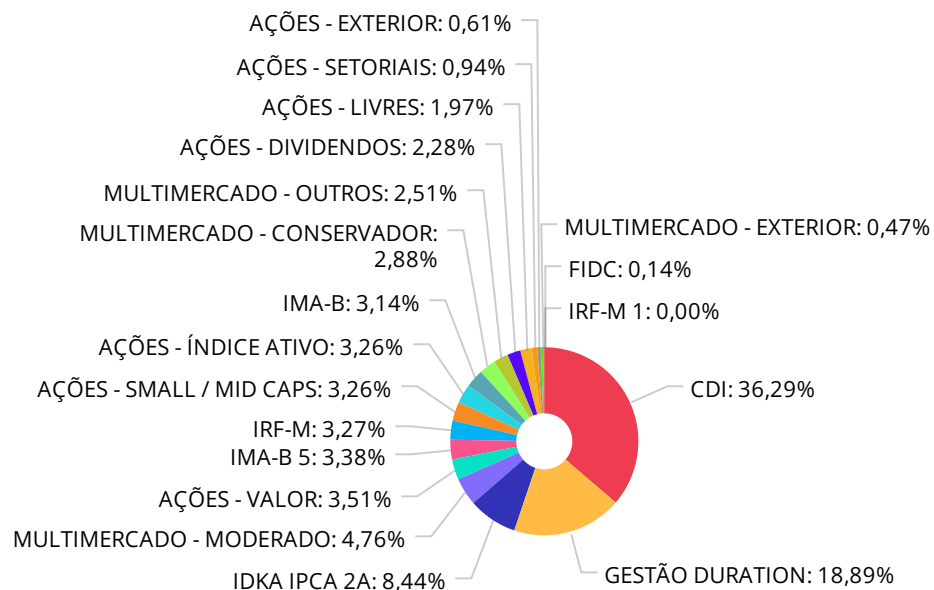
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	-4,79%	-28,54%	3,52%	-0,98%	-28,54%	-6,74%	10,61%	19,766%

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



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

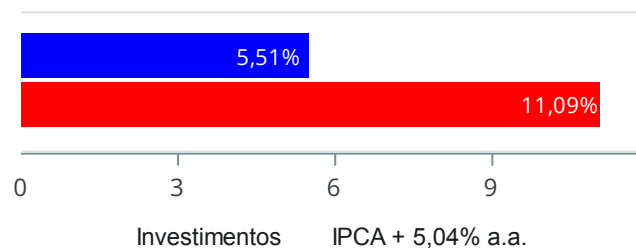


■ CDI	5.825.317,38	■ GESTÃO DURATION	3.032.000,46	■ IDKA IPCA 2A	1.355.280,91
■ MULTIMERCADO - MODERADO	763.666,51	■ AÇÕES - VALOR	563.895,27	■ IMA-B 5	542.514,71
■ IRF-M	524.355,66	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	524.073,46	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	522.781,83
■ IMA-B	503.888,06	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	462.588,42	■ MULTIMERCADO - OUTROS	402.444,44
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	365.805,19	■ AÇÕES - LIVRES	316.074,08	■ AÇÕES - SETORIAIS	150.776,87
■ AÇÕES - EXTERIOR	98.610,79	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	75.451,79	■ FIDC	23.241,33
■ IRF-M 1	0,01				

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	15.059.519,11	1.678.393,22	3.693.882,34	13.170.689,49	126.659,50	126.659,50	0,84%	0,84%	0,95%	0,95%	88,27%	3,31%
Fevereiro	13.170.689,49	2.057.255,87	1.823.700,00	13.405.393,24	1.147,88	127.807,38	0,01%	0,85%	1,39%	2,35%	36,14%	2,50%
Março	13.405.393,24	2.269.852,70	2.713.309,69	13.289.721,70	327.785,45	455.592,83	2,45%	3,32%	2,06%	4,46%	74,40%	3,60%
Abril	13.289.721,70	2.438.470,53	2.442.545,50	13.057.849,41	-227.797,32	227.795,51	-1,71%	1,54%	1,44%	5,96%	25,94%	2,70%
Mai	13.057.849,41	2.282.443,02	3.136.814,61	12.289.428,01	85.950,19	313.745,70	0,66%	2,21%	0,90%	6,91%	32,02%	3,13%
Junho	12.289.428,01	2.111.614,17	2.419.716,19	11.749.352,30	-231.973,69	81.772,01	-1,89%	0,28%	1,08%	8,07%	3,52%	3,06%
Julho	11.749.352,30	3.058.916,03	2.588.547,17	12.438.043,94	218.322,78	300.094,79	1,79%	2,08%	-0,27%	7,78%	26,69%	2,76%
Agosto	12.438.043,94	2.650.419,65	2.122.210,56	13.197.287,17	231.034,14	531.128,93	1,78%	3,89%	0,09%	7,87%	49,48%	3,19%
Setembro	13.197.287,17	2.671.061,54	2.113.198,09	13.782.112,32	26.961,70	558.090,63	0,20%	4,10%	0,12%	8,00%	51,22%	3,23%
Outubro	13.782.112,32	3.093.198,23	3.213.265,77	13.979.773,00	317.728,22	875.818,85	2,31%	6,50%	0,98%	9,06%	71,70%	4,08%
Novembro	13.979.773,00	3.076.467,93	2.279.895,13	14.646.176,14	-130.169,66	745.649,19	-0,88%	5,56%	0,80%	9,94%	55,95%	5,09%
Dezembro	14.646.176,14	4.544.211,24	3.434.073,91	15.748.217,86	-8.095,61	737.553,58	-0,05%	5,51%	1,05%	11,09%	49,62%	2,41%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



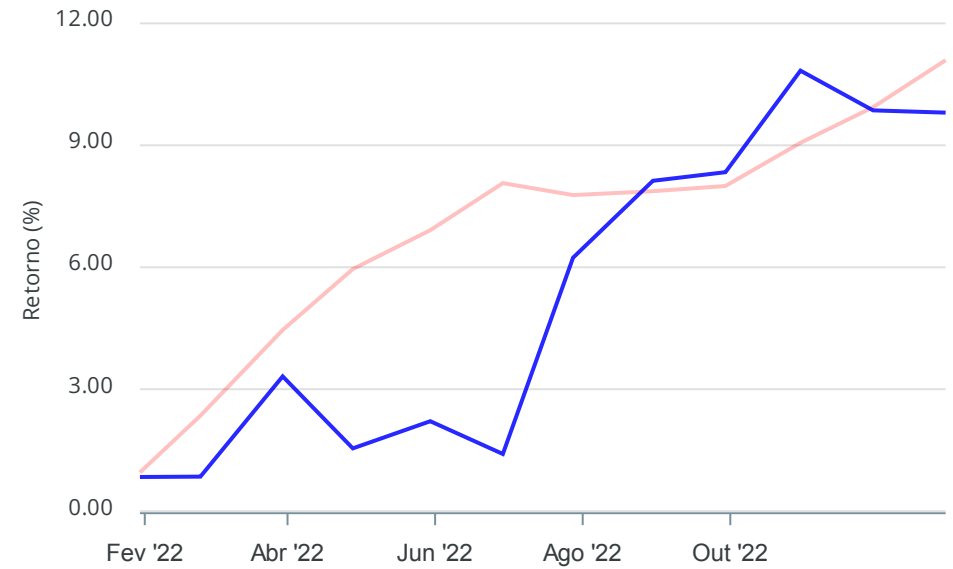
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 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 ...	516.892,30	0,00	0,00	524.355,66	7.463,36	1,44%	1,44%	1,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.338.964,06	0,00	0,00	1.355.280,91	16.316,85	1,22%	1,22%	1,21%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	755.536,29	0,00	0,00	764.143,90	8.607,61	1,14%	1,14%	0,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	300.303,48	0,00	0,00	303.171,28	2.867,80	0,95%	0,95%	0,60%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	299.579,84	0,00	0,00	302.429,93	2.850,09	0,95%	0,95%	0,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	68.134,54	0,00	0,00	68.762,78	628,24	0,92%	0,92%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	169.036,07	0,00	0,00	170.580,65	1.544,58	0,91%	0,91%	1,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	437.344,82	0,00	136.740,44	304.549,81	3.945,43	0,90%	1,03%	0,00%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	23.038,49	0,00	0,00	23.241,33	202,84	0,88%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.023.068,17	549.852,28	0,00	1.585.665,76	12.745,31	0,81%	1,10%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.830.077,15	3.394.358,96	2.834.073,91	3.431.420,75	41.058,55	0,66%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	200.000,00	0,00	201.251,13	1.251,13	0,63%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	1,15%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-0,24%	2,52%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	505.084,27	0,00	0,00	503.888,05	-1.196,22	-0,24%	-0,24%	2,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.276.273,88	0,00	0,00	2.267.856,56	-8.417,32	-0,37%	-0,37%	1,53%
Total Renda Fixa	10.543.333,38	4.144.211,24	2.970.814,35	11.806.598,52	89.868,25	0,77%		0,70%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	457.770,07	0,00	0,00	462.588,42	4.818,35	1,05%	1,05%	0,56%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	758.576,32	0,00	0,00	763.666,51	5.090,19	0,67%	0,67%	1,71%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	400.000,00	0,00	402.444,44	2.444,44	0,61%	1,16%	0,22%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	369.873,28	0,00	0,00	365.805,19	-4.068,09	-1,10%	-1,10%	10,52%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	578.209,96	0,00	0,00	563.895,27	-14.314,69	-2,48%	-2,48%	9,73%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	536.402,32	0,00	0,00	522.781,83	-13.620,49	-2,54%	-2,54%	9,48%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	540.247,90	0,00	0,00	524.073,46	-16.174,44	-2,99%	-2,99%	13,87%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	91.956,12	0,00	0,00	88.598,84	-3.357,28	-3,65%	-3,65%	10,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	238.540,38	0,00	0,00	227.475,24	-11.065,14	-4,64%	-4,64%	11,79%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	79.337,21	0,00	0,00	75.451,79	-3.885,42	-4,90%	-4,90%	8,34%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	170.047,23	0,00	0,00	150.776,87	-19.270,36	-11,33%	-11,33%	12,91%
Total Renda Variável	3.820.960,79	400.000,00	0,00	4.147.557,86	-73.402,93	-1,74%		7,09%

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
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	719.226,30	0,00	600.000,00	98.610,79	-20.615,51	-2,87%	-4,79%	10,61%
Total Exterior	719.226,30	0,00	600.000,00	98.610,79	-20.615,51	-2,87%		10,61%

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.253.647,52	8.522.919,79	7.455.298,17	3.431.420,75	110.151,61	1,02%	3,22%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.528.561,81	881.659,43	863.115,60	1.585.665,76	38.560,12	1,60%	3,14%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.323.235,80	0,00	0,00	1.355.280,91	32.045,11	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	747.508,37	0,00	0,00	764.143,90	16.635,53	2,23%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	300.159,09	0,00	8.821,04	303.171,28	11.833,23	3,94%	3,98%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	249.663,47	374.708,89	330.879,15	304.549,81	11.056,60	1,77%	2,95%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.536,87	509.298,18	0,00	524.355,66	4.520,61	0,87%	1,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	166.512,87	0,00	0,00	170.580,65	4.067,78	2,44%	2,44%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	299.943,48	0,00	0,00	302.429,93	2.486,45	0,83%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	67.114,32	0,00	0,00	68.762,78	1.648,46	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	200.000,00	0,00	201.251,13	1.251,13	0,63%	3,20%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	503.022,25	0,00	0,00	503.888,05	865,80	0,17%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	3,09%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	28.514,95	0,00	0,00	23.241,33	-5.273,62	-18,49%	-18,49%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.279.922,83	0,00	0,00	2.267.856,56	-12.066,27	-0,53%	-0,53%
Total Renda Fixa	9.758.343,65	10.488.586,29	8.658.113,96	11.806.598,52	217.782,54	1,88%	

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	450.099,52	0,00	0,00	462.588,42	12.488,90	2,77%	2,77%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	551.785,02	200.000,00	0,00	763.666,51	11.881,49	1,58%	2,06%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	68.781,59	0,00	0,00	75.451,79	6.670,20	9,70%	9,70%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	400.000,00	0,00	402.444,44	2.444,44	0,61%	2,90%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	524.742,66	0,00	0,00	522.781,83	-1.960,83	-0,37%	-0,37%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	153.989,21	0,00	0,00	150.776,87	-3.212,34	-2,09%	-2,09%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	92.519,39	0,00	0,00	88.598,84	-3.920,55	-4,24%	-4,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	374.894,28	0,00	0,00	365.805,19	-9.089,09	-2,42%	-2,42%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	575.335,82	0,00	0,00	563.895,27	-11.440,55	-1,99%	-1,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	251.879,96	0,00	0,00	227.475,24	-24.404,72	-9,69%	-9,69%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	567.925,29	0,00	0,00	524.073,46	-43.851,83	-7,72%	-7,72%
Total Renda Variável	3.611.952,74	600.000,00	0,00	4.147.557,86	-64.394,88	-1,53%	



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 FIAÇÕES BDR NÍVEL I	661.478,91	0,00	600.000,00	98.610,79	37.131,88	5,61%	3,52%
Total Exterior	661.478,91	0,00	600.000,00	98.610,79	37.131,88	5,61%	

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
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	362.400,72	26.032.282,41	23.277.032,98	3.431.420,75	313.770,60	1,19%	12,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.631.970,13	0,00	560.000,00	2.267.856,56	195.886,43	7,44%	7,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.586.676,04	0,00	350.000,00	1.355.280,91	118.604,87	7,48%	9,32%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	1.310.426,82	3.130.674,74	2.972.794,01	1.585.665,76	117.358,21	2,64%	12,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1.888.249,59	500.000,00	1.702.511,42	764.143,90	78.405,73	3,28%	10,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.634.788,47	0,00	1.500.000,00	170.580,65	35.792,18	2,19%	9,51%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	475.117,43	0,00	0,00	503.888,05	28.770,62	6,06%	6,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	300.000,00	8.821,04	303.171,28	11.992,32	4,00%	11,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	62.700,62	0,00	0,00	68.762,78	6.062,16	9,67%	9,67%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,00	519.346,98	0,00	524.355,66	5.008,68	0,96%	8,72%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	300.000,00	0,00	302.429,93	2.429,93	0,81%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	200.000,00	0,00	201.251,13	1.251,13	0,63%	12,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	6,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	11,74%
BB VOTORANTIM HIGHLAND FIDC INFRAESTRUTURA SÊNIOR ...	37.061,53	0,00	0,00	23.241,33	-13.820,20	-37,29%	-37,29%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	51.160,27	1.505.606,12	1.148.910,23	304.549,81	-103.306,35	-6,64%	11,26%
Total Renda Fixa	10.040.551,64	32.487.910,25	31.520.069,68	11.806.598,52	798.206,31	7,25%	

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	742.938,11	200.000,00	260.000,00	763.666,51	80.728,40	8,56%	13,75%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	656.067,37	0,00	250.000,00	462.588,42	56.521,05	8,62%	11,78%
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	496.756,28	0,00	0,00	522.781,83	26.025,55	5,24%	5,24%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	541.930,88	0,00	200.000,00	365.805,19	23.874,31	4,41%	1,76%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	0,00	400.000,00	0,00	402.444,44	2.444,44	0,61%	13,45%
CAIXA ELETROBRAS FIAÇÕES	0,00	150.000,00	0,00	150.776,87	776,87	0,52%	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	389.485,21	0,00	300.000,00	88.598,84	-886,37	-0,23%	-1,79%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	85.715,05	0,00	0,00	75.451,79	-10.263,26	-11,97%	-11,97%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	584.167,59	0,00	0,00	563.895,27	-20.272,32	-3,47%	-3,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	250.966,07	0,00	0,00	227.475,24	-23.490,83	-9,36%	-9,36%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	618.947,98	0,00	0,00	524.073,46	-94.874,52	-15,33%	-15,33%
Total Renda Variável	4.366.974,54	750.000,00	1.010.000,00	4.147.557,86	40.583,32	0,79%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2022

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I	703.153,19	200.000,00	600.000,00	98.610,79	-204.542,40	-22,65%	-28,54%
Total Exterior	703.153,19	200.000,00	600.000,00	98.610,79	-204.542,40	-22,65%	

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

