

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 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	1.888.979,77	0,85%	1.020	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.224.485,64	1,45%	782	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.921.307,22	1,31%	569	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.990.546,02	2,24%	484	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	1.117.459,04	0,50%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	25.061.921,35	11,25%	286	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	14.763.657,59	6,62%	258	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	19.983.248,02	8,97%	66	7,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	290.855,24	0,13%	325	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.901.845,36	4,44%	809	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.948.123,52	4,91%	990	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.805.779,22	2,61%	947	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.228.152,95	4,59%	296	1,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	670.716,19	0,30%	898	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.889.000,08	4,44%	159	1,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	12.670.331,20	5,69%	237	0,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	6.071.660,25	2,72%	198	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BBIF MASTER FIDC LP 1	Não se ...	27 meses	255.766,98	0,11%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.748.207,54	1,68%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.902.850,94	1,30%	1.801	0,28%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2022)

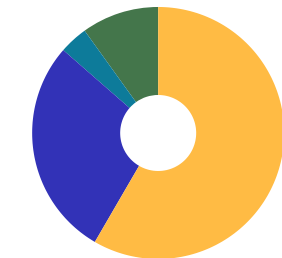
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.350.677,41	1,95%	3.364	1,50%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	2.386.831,18	1,07%	25.279	0,17%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.038.678,84	1,36%	593	1,56%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	6.397.181,88	2,87%	3.271	0,45%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.789.243,71	1,70%	126	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.005.805,24	1,80%	3.768	0,33%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	3.063.695,22	1,37%	256	1,26%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.650.844,46	1,19%	22.400	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.377.046,84	1,07%	1.431	1,40%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.399.587,63	2,42%	42.177	1,32%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	4.476.053,77	2,01%	32	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕ...	D+6 du	Não há	2.710.926,59	1,22%	10	1,48%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+5 du	Não há	2.554.546,14	1,15%	128	0,55%	Artigo 9º, Inciso II
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	2.013.147,03	0,90%	19.923	0,46%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.760.705,16	0,79%	558	0,17%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.340.149,97	3,29%	7.590	0,36%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC M...	D+2 du	720 dias	2.947.182,00	1,32%	583	1,88%	Artigo 10º, Inciso I
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.970.627,99	2,68%	510	6,15%	Artigo 10º, Inciso I
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	2.215.039,23	0,99%	108	0,32%	Artigo 10º, Inciso I
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	3.179.214,06	1,43%	17	3,28%	Artigo 10º, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.897.349,96	1,30%	28	2,32%	Artigo 10º, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			222.859.428,43				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	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%	16,58%	62,20%	138.618.564,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	111.126.360,94	49,86%	12,44%	16,58%	62,20%	27.492.203,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	29.301.707,72	13,15%	2,85%	3,80%	70,00%	126.699.892,18
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,80%	20,00%	44.571.885,69
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	10,00%	4.003.974,52	1,80%	0,00%	2,34%	2,34%	1.210.936,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,60%	10,00%	22.285.942,84
Total Renda Fixa	100,00%	144.432.043,18	64,81%	15,29%	50,70%	226,74%	



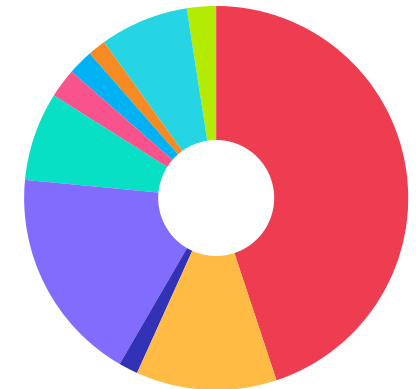
RENDA FIXA	144.432.043,18
RENDA VARIÁVEL	69.388.060,33
EXTERIOR	9.039.324,92
ESTRUTURADOS	24.549.563,21

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

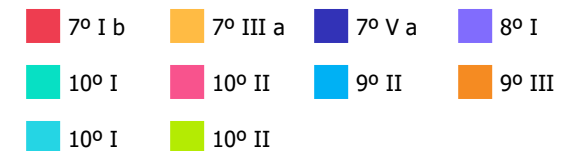


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2022)

Artigos - Renda Variável / Estruturado	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	44.838.497,12	20,12%	19,65%	22,27%	40,00%	44.305.274,25
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,93%	40,00%	89.143.771,37
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	18.472.999,19	8,29%	7,50%	10,00%	10,00%	3.812.943,65
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	6.076.564,02	2,73%	0,00%	1,55%	1,55%	-2.622.242,88
Artigo 11º	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,55%	1,55%	3.454.321,14
Total Renda Variável / Estruturado	40,00%	69.388.060,33	31,14%	27,15%	39,30%	93,10%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	5.265.472,73	2,36%	3,75%	5,00%	10,00%	17.020.470,11
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	3.773.852,19	1,69%	3,75%	5,00%	10,00%	18.512.090,65
Total Exterior	10,00%	9.039.324,92	4,06%	7,50%	10,00%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	111.060.158,93	49,83	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.177.927,03	13,09	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	12.670.331,20	5,69	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.889.000,08	4,44	0,00
TRÍGONO CAPITAL	9.875.641,40	4,43	0,21
ITAÚ UNIBANCO	8.626.206,39	3,87	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	6.397.181,88	2,87	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.970.627,99	2,68	0,06
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.005.805,24	1,80	0,24
BANCO J. SAFRA S/A	3.975.744,39	1,78	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.748.207,54	1,68	0,80
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.179.214,06	1,43	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	3.063.695,22	1,37	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.038.678,84	1,36	0,00
KPTL	2.897.349,96	1,30	0,82
ITAÚ DTVM	2.650.844,46	1,19	0,00
PERFIN INVESTIMENTOS	2.377.046,84	1,07	0,03
GENIAL GESTÃO LTDA	255.766,98	0,11	-

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	62,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	111.126.360,94	49,86	12,44	62,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	29.301.707,72	13,15	2,85	70,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	4.003.974,52	1,80	0,00	2,34
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	44.838.497,12	20,12	19,65	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 9º, Inciso II	5.265.472,73	2,36	3,75	10,00
Artigo 9º, Inciso III	3.773.852,19	1,69	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	18.472.999,19	8,29	7,50	10,00
Artigo 10º, Inciso II	6.076.564,02	2,73	0,00	1,55
Artigo 11º	0,00	0,00	0,00	1,55
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00

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%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,65%	8,01%	1,72%	1,72%	8,77%	14,75%	1,98%	0,03%
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,95%	11,80%	2,37%	3,78%	13,31%	34,19%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,35%	-11,34%	-0,85%	-7,95%	-11,52%	-17,61%	0,26%	0,05%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,33%	8,76%	2,00%	2,36%	9,62%	15,81%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,51%	1,82%	1,87%	-1,42%	2,68%	2,12%	1,71%	0,05%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-3,33%	-	-1,50%	-	-	-	5,90%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,37%	8,52%	1,92%	2,25%	9,35%	15,20%	1,98%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,51%	9,07%	1,85%	2,37%	9,81%	16,80%	1,70%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,35%	8,67%	1,95%	2,36%	9,50%	15,42%	1,96%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-0,79%	6,58%	1,92%	1,77%	6,82%	10,34%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	6,33%	1,84%	1,67%	6,54%	9,78%	4,44%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	-0,66%	7,24%	1,66%	5,33%	9,26%	7,16%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	7,05%	1,58%	5,19%	9,06%	6,66%	3,35%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,62%	7,18%	1,68%	5,28%	9,18%	6,89%	3,28%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,48%	10,55%	2,58%	5,36%	11,06%	17,52%	0,61%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,94%	10,12%	2,91%	5,99%	10,86%	13,84%	0,00%	0,01%
BBIF MASTER FIDC LP 1	-0,35%	-5,93%	-1,01%	-3,89%	-6,22%	18,66%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,88%	9,52%	2,73%	5,63%	10,21%	13,23%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,41%	5,13%	0,71%	0,33%	5,90%	17,27%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-1,03%	8,23%	1,37%	3,61%	9,16%	13,36%	3,98%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,34%	7,96%	2,04%	4,07%	8,81%	10,47%	2,94%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,09%	9,45%	2,33%	4,89%	10,36%	10,78%	1,34%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,31%	-	-0,04%	0,22%	-	-	5,34%	-

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,21%	15,12%	3,17%	5,47%	17,02%	43,08%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,14%	-8,54%	-7,34%	-7,63%	-8,66%	-6,84%	-	0,07%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,03%	12,75%	2,60%	4,27%	14,37%	36,70%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	4,02%	10,38%	1,06%	3,98%	5,57%	12,95%	-	0,09%
IDIV (Benchmark)	0,78%	14,50%	2,96%	0,30%	16,33%	16,74%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	-1,19%	15,81%	4,50%	2,38%	26,39%	91,20%	14,35%	0,25%
Ibovespa (Benchmark)	-3,06%	7,31%	2,71%	1,02%	10,37%	3,30%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-8,09%	-1,66%	-1,24%	1,14%	-2,34%	-29,41%	13,47%	0,24%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-8,52%	3,31%	0,17%	0,56%	4,31%	0,47%	12,99%	0,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-7,37%	5,41%	-3,42%	-3,59%	8,72%	5,76%	14,34%	0,20%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-6,17%	8,54%	0,52%	-0,97%	8,61%	0,38%	14,39%	0,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-4,00%	1,86%	-0,17%	-4,20%	5,49%	5,43%	13,67%	0,21%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-6,72%	2,90%	-2,15%	-3,87%	6,40%	2,23%	14,68%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,00%	-1,02%	-0,85%	-4,35%	3,02%	4,37%	13,50%	0,19%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-7,76%	6,42%	-1,91%	-3,76%	10,41%	-2,99%	14,26%	0,23%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,23%	6,79%	0,62%	-0,53%	17,05%	69,16%	9,23%	0,24%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-2,90%	6,80%	1,25%	0,82%	11,61%	13,20%	10,95%	0,19%

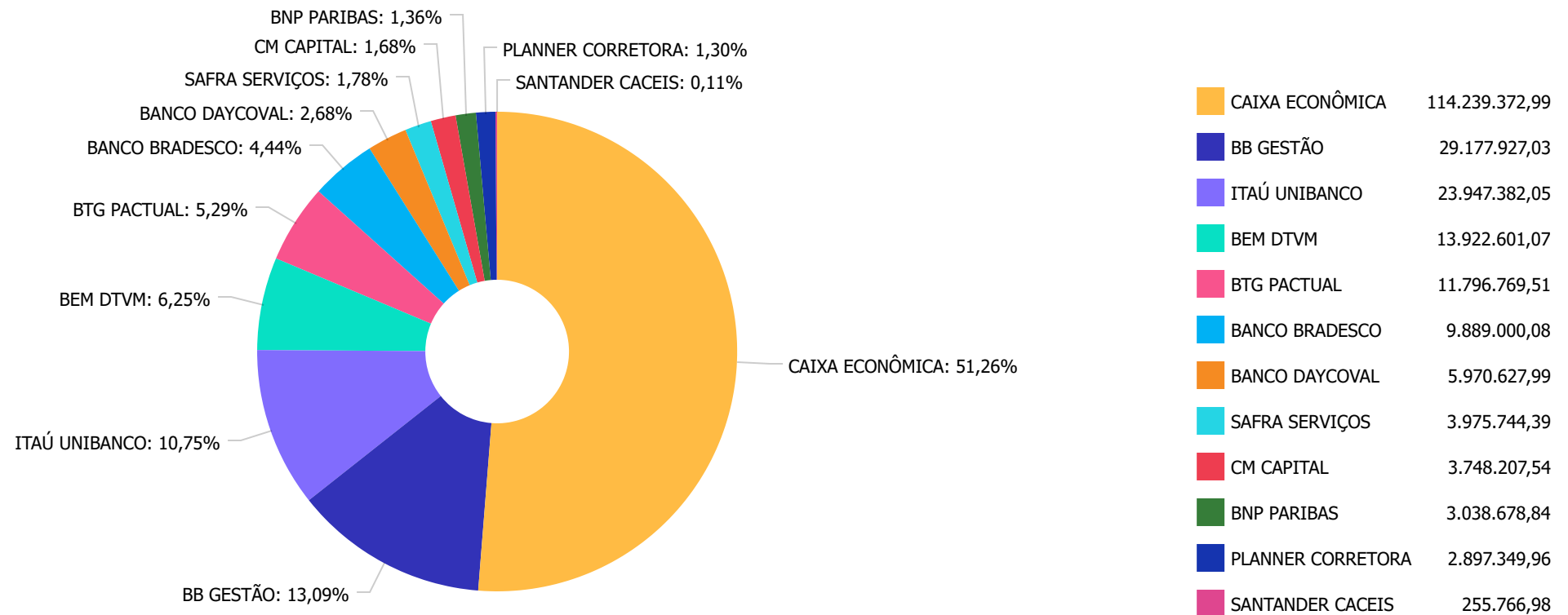
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,43%	1,51%	-0,11%	1,99%	0,06%	-17,86%	12,63%	0,18%
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,34%	10,58%	2,36%	6,77%	11,60%	12,98%	0,77%	0,02%
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	5,94%	-7,47%	5,22%	3,44%	-2,45%	26,00%	14,01%	0,24%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-1,28%	9,74%	2,00%	4,67%	11,32%	13,22%	3,97%	0,04%

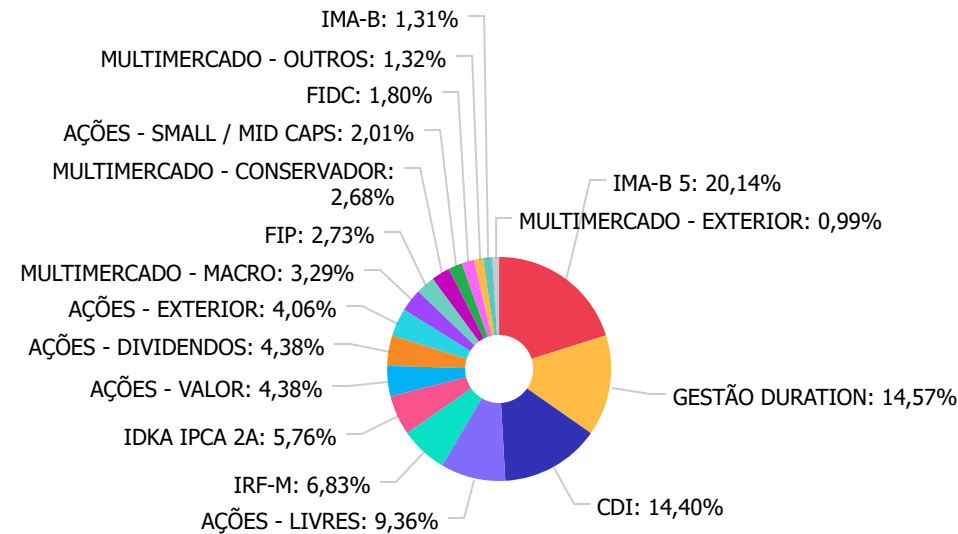
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-6,41%	-23,77%	-5,54%	1,43%	-23,86%	-22,84%	9,58%	0,24%
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%
MSCI WORLD (Benchmark)	7,55%	-20,13%	5,86%	9,14%	-17,37%	4,59%	-	-
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	5,75%	-21,49%	1,82%	5,88%	-19,26%	3,96%	17,69%	0,18%
MSCI ACWI (Benchmark)	8,36%	-20,71%	5,19%	8,20%	-18,19%	1,33%	-	-
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	1,36%	-15,70%	-3,19%	-7,28%	-13,43%	2,48%	1,97%	0,15%

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



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

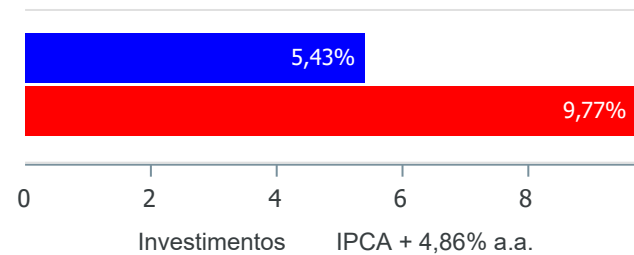


IMA-B 5	44.894.629,51	GESTÃO DURATION	32.461.176,64	CDI	32.095.153,03
AÇÕES - LIVRES	20.856.388,44	IRF-M	15.218.698,97	IDKA IPCA 2A	12.837.103,29
AÇÕES - VALOR	9.755.789,87	AÇÕES - DIVIDENDOS	9.750.265,04	AÇÕES - EXTERIOR	9.039.324,92
MULTIMERCADO - MACRO	7.340.149,97	FIP	6.076.564,02	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.970.627,99
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	4.476.053,77	FIDC	4.003.974,52	MULTIMERCADO - OUTROS	2.947.182,00
IMA-B	2.921.307,22	MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.215.039,23		

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	204.149.239,18	3.851.981,68	5.036.893,69	203.642.133,30	677.806,13	677.806,13	0,33%	0,33%	0,94%	0,94%	35,38%	3,67%
Fevereiro	203.642.133,30	8.195.616,67	5.781.128,98	206.435.138,47	378.517,48	1.056.323,61	0,18%	0,52%	1,37%	2,32%	22,22%	2,70%
Março	206.435.138,47	3.571.148,94	2.486.216,43	212.970.189,46	5.450.118,48	6.506.442,09	2,63%	3,16%	2,04%	4,41%	71,53%	3,78%
Abril	212.970.189,46	5.444.259,71	2.892.117,79	213.641.856,10	-1.880.475,28	4.625.966,81	-0,87%	2,26%	1,42%	5,90%	38,25%	2,84%
Mai	213.641.856,10	43.771.417,44	43.327.821,97	216.430.187,14	2.344.735,57	6.970.702,38	1,10%	3,38%	0,89%	6,84%	49,38%	3,95%
Junho	216.430.187,14	45.723.471,96	44.695.787,41	212.078.787,43	-5.379.084,26	1.591.618,12	-2,47%	0,82%	1,07%	7,98%	10,26%	3,21%
Julho	212.078.787,43	42.500.003,85	42.406.328,92	215.429.198,53	3.256.736,17	4.848.354,29	1,53%	2,37%	-0,29%	7,67%	30,85%	3,06%
Agosto	215.429.198,53	10.330.880,52	10.251.875,76	218.844.747,34	3.336.544,05	8.184.898,34	1,55%	3,95%	0,07%	7,75%	51,00%	3,76%
Setembro	218.844.747,34	8.201.215,07	7.834.902,62	219.079.062,15	-131.997,64	8.052.900,70	-0,06%	3,89%	0,11%	7,86%	49,47%	3,52%
Outubro	219.079.062,15	12.629.213,38	12.762.716,81	224.836.182,59	5.890.623,87	13.943.524,57	2,69%	6,68%	0,97%	8,91%	75,02%	4,11%
Novembro	224.836.182,59	7.961.718,02	7.286.342,81	222.859.428,43	-2.652.129,37	11.291.395,20	-1,18%	5,43%	0,79%	9,77%	55,57%	5,82%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



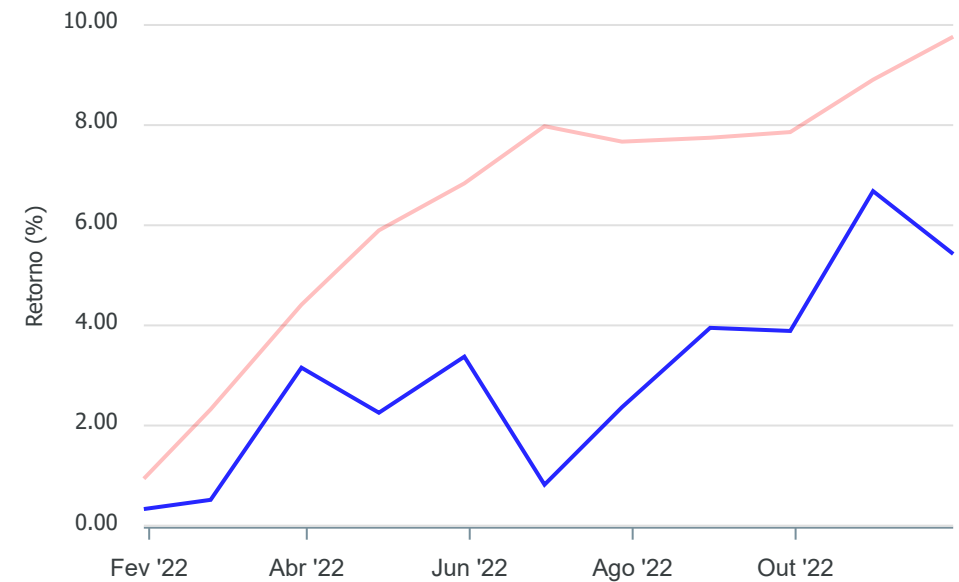
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Novembro/2022

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	653.088,16	26.874,51	15.264,80	670.716,19	6.018,32	0,89%	0,93%	0,00%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	25.653.606,28	0,00	777.856,83	25.061.921,35	186.171,90	0,73%	-2,31%	5,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	6.042.634,10	0,00	0,00	6.071.660,25	29.026,15	0,48%	0,48%	0,61%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	231.933,90	4.842.953,54	4.790.170,52	290.855,24	6.138,32	0,12%	0,88%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.893.221,04	0,00	0,00	9.901.845,36	8.624,32	0,09%	0,09%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.414.194,94	1.591.889,97	190.000,00	5.805.779,22	-10.305,69	-0,17%	-0,35%	1,96%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.923.045,99	0,00	0,00	9.889.000,08	-34.045,91	-0,34%	-0,34%	2,94%
BBIF MASTER FIDC LP 1	256.658,67	0,00	0,00	255.766,98	-891,69	-0,35%	-0,35%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.761.487,84	0,00	0,00	3.748.207,54	-13.280,30	-0,35%	-0,35%	0,26%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.236.384,56	0,00	0,00	3.224.485,64	-11.898,92	-0,37%	-0,37%	1,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.468.484,70	1.500.000,00	960.000,00	10.948.123,52	-60.361,18	-0,50%	-0,71%	2,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.123.215,85	0,00	0,00	1.117.459,04	-5.756,81	-0,51%	-0,51%	1,70%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.839.840,55	0,00	0,00	14.763.657,59	-76.182,96	-0,51%	-0,51%	1,71%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.291.899,54	0,00	0,00	10.228.152,95	-63.746,59	-0,62%	-0,62%	3,28%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.671.221,97	0,00	553.050,66	19.983.248,02	-134.923,29	-0,65%	-3,33%	5,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.901.405,35	0,00	0,00	1.888.979,77	-12.425,58	-0,65%	-0,65%	1,98%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.025.209,90	0,00	0,00	4.990.546,02	-34.663,88	-0,69%	-0,69%	3,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.944.850,49	0,00	0,00	2.921.307,22	-23.543,27	-0,80%	-0,80%	4,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	12.802.246,65	0,00	0,00	12.670.331,20	-131.915,45	-1,03%	-1,03%	3,98%
Total Renda Fixa	144.134.630,48	7.961.718,02	7.286.342,81	144.432.043,18	-377.962,51	-0,26%		3,35%

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
SAFRA S&P REAIS PB FIC MULTIMERCADO	2.090.804,83	0,00	0,00	2.215.039,23	124.234,40	5,94%	5,94%	14,01%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	3.056.284,46	0,00	0,00	3.179.214,06	122.929,60	4,02%	-	-
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.950.325,00	0,00	0,00	5.970.627,99	20.302,99	0,34%	0,34%	0,77%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES V FIC MUL...	2.949.673,35	0,00	0,00	2.947.182,00	-2.491,35	-0,08%	-0,08%	3,80%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.901.414,08	0,00	0,00	2.897.349,96	-4.064,12	-0,14%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	5.464.780,44	0,00	0,00	5.399.587,63	-65.192,81	-1,19%	-1,19%	14,35%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.435.070,55	0,00	0,00	7.340.149,97	-94.920,58	-1,28%	-1,28%	3,97%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	4.578.342,73	0,00	0,00	4.476.053,77	-102.288,96	-2,23%	-2,23%	9,23%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3.155.335,00	0,00	0,00	3.063.695,22	-91.639,78	-2,90%	-2,90%	10,95%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.992.649,02	0,00	0,00	2.902.850,94	-89.798,08	-3,00%	-3,00%	13,50%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	2.486.363,71	0,00	0,00	2.386.831,18	-99.532,53	-4,00%	-4,00%	13,67%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	4.038.534,17	0,00	0,00	3.789.243,71	-249.290,46	-6,17%	-6,17%	14,39%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	4.663.901,33	0,00	0,00	4.350.677,41	-313.223,92	-6,72%	-6,72%	14,68%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.324.607,56	0,00	0,00	4.005.805,24	-318.802,32	-7,37%	-7,37%	14,34%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.567.769,14	0,00	0,00	2.377.046,84	-190.722,30	-7,43%	-7,43%	12,63%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.294.374,72	0,00	0,00	3.038.678,84	-255.695,88	-7,76%	-7,76%	14,26%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.959.921,96	0,00	0,00	6.397.181,88	-562.740,08	-8,09%	-8,09%	13,47%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.897.590,26	0,00	0,00	2.650.844,46	-246.745,80	-8,52%	-8,52%	12,99%
Total Renda Variável	71.807.742,31	0,00	0,00	69.388.060,33	-2.419.681,98	-3,37%		10,58%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.652.536,92	0,00	0,00	1.760.705,16	108.168,24	6,55%	6,55%	21,05%
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	2.415.695,88	0,00	0,00	2.554.546,14	138.850,26	5,75%	5,75%	17,69%
BB GLOBAIS HEDGE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI AÇÕES	2.674.548,54	0,00	0,00	2.710.926,59	36.378,05	1,36%	1,36%	1,97%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.151.028,46	0,00	0,00	2.013.147,03	-137.881,43	-6,41%	-6,41%	9,58%
Total Exterior	8.893.809,80	0,00	0,00	9.039.324,92	145.515,12	1,64%		11,83%

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.