

Relatório Analítico dos Investimentos

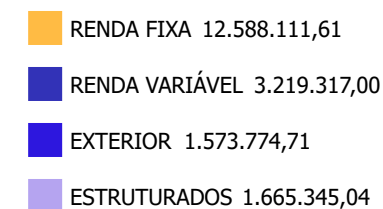
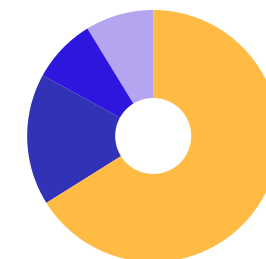
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	450.337,61	2,36%	3.276	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	478.877,12	2,51%	5.895	0,32%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	727.733,54	3,82%	25.252	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	132.522,92	0,70%	11.935	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	38.421,91	0,20%	225	0,01%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	453.952,69	2,38%	80	0,20%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	122.398,72	0,64%	13.591	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	869.567,83	4,57%	158	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	306.292,51	1,61%	19.329	0,08%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	397.914,37	2,09%	2.662	0,31%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	142.317,02	0,75%	99	0,11%	Artigo 10º, Inciso I
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	460.231,58	2,42%	186	0,15%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	814.397,67	4,28%	60.402	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	248.398,77	1,30%	785	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		351.172,78	1,84%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			19.046.548,36				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			351.172,78				Artigo 6º
PL Total			19.397.721,14				

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

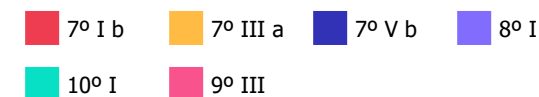
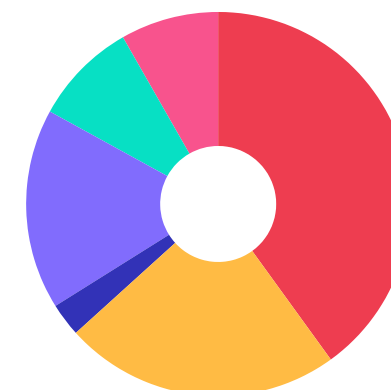
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	18,00%	59,24%	11.283.175,25
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	7.623.153,91	40,02%	13,87%	28,00%	59,24%	3.660.021,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.430.744,95	23,26%	12,66%	16,88%	50,00%	5.092.529,23
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,88%	20,00%	3.809.309,67
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	534.212,75	2,80%	0,00%	2,78%	5,00%	418.114,67
Total Renda Fixa	100,00%	12.588.111,61	66,09%	26,53%	72,54%	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%	3.219.317,00	16,90%	11,21%	15,89%	20,00%	589.992,67
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,80%	20,00%	3.809.309,67
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	1.665.345,04	8,74%	2,09%	3,77%	10,00%	239.309,80
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	4.884.662,04	25,65%	13,30%	22,46%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.573.774,71	8,26%	3,75%	5,00%	10,00%	330.880,13
Total Exterior	10,00%	1.573.774,71	8,26%	3,75%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.179.052,56	69,19	-
ITAÚ UNIBANCO	3.165.673,90	16,62	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.084.430,36	10,94	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	617.391,54	3,24	-

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 '	7.623.153,91	40,02	13,87	59,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.430.744,95	23,26	12,66	50,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	534.212,75	2,80	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	3.219.317,00	16,90	11,21	20,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	1.573.774,71	8,26	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso I	1.665.345,04	8,74	2,09	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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
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%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	11,73%	3,09%	6,56%	11,73%	14,68%	0,08%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,94%	9,78%	2,53%	2,98%	9,78%	14,79%	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	-	2,71%	2,69%	-	-	0,99%	-
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,86%	9,16%	2,35%	2,91%	9,16%	12,98%	1,15%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22%	6,09%	0,17%	1,80%	6,09%	4,49%	2,47%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	1,48%	8,82%	1,74%	6,49%	8,82%	6,66%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,43%	8,58%	1,64%	6,34%	8,58%	6,10%	1,73%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
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%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	11,41%	3,98%	4,00%	11,41%	16,36%	0,60%	0,03%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,11%	-	2,97%	6,07%	-	-	0,57%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,15%	11,81%	2,65%	5,57%	11,81%	18,52%	0,16%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1,28%	13,11%	2,99%	6,33%	13,11%	-	0,24%	0,01%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,20%	13,74%	3,45%	7,17%	13,74%	21,37%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	9,30%	1,67%	4,80%	9,30%	9,89%	1,26%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	-	1,14%	1,58%	-	-	2,22%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,08%	-	0,14%	1,17%	-	-	2,95%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,37%	7,83%	-0,53%	2,43%	7,83%	12,71%	1,53%	0,02%

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
S&P 500 (Benchmark)	-5,90%	-19,44%	7,08%	1,43%	-19,44%	2,22%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-4,58%	-13,32%	8,56%	5,47%	-13,32%	12,94%	8,14%	0,22%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-4,81%	-11,92%	9,76%	6,88%	-11,92%	16,92%	8,32%	0,23%
IDIV (Benchmark)	-1,61%	12,65%	3,15%	7,71%	12,65%	5,43%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-1,10%	1,77%	-2,42%	6,62%	1,77%	-5,19%	10,52%	0,20%
Ibovespa (Benchmark)	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%	-	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-2,43%	2,64%	-0,78%	10,34%	2,64%	-9,98%	9,40%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-2,48%	-3,47%	-1,99%	5,53%	-3,47%	-8,07%	9,73%	0,19%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-2,57%	-0,76%	-2,39%	7,00%	-0,76%	-6,97%	9,73%	0,21%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,32%	7,30%	1,10%	8,81%	7,30%	-0,91%	8,95%	0,19%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	-4,80%	-8,10%	-10,28%	0,31%	-8,10%	-	11,90%	0,24%
SMLL (Benchmark)	-3,01%	-15,06%	-7,61%	5,76%	-15,06%	-28,82%	-	-
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-2,93%	-15,88%	-8,88%	4,16%	-15,88%	-32,57%	14,02%	0,30%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-2,64%	-9,45%	-6,64%	5,76%	-9,45%	-18,56%	13,31%	0,25%
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,05%	11,78%	2,78%	6,52%	11,78%	15,73%	0,56%	0,01%



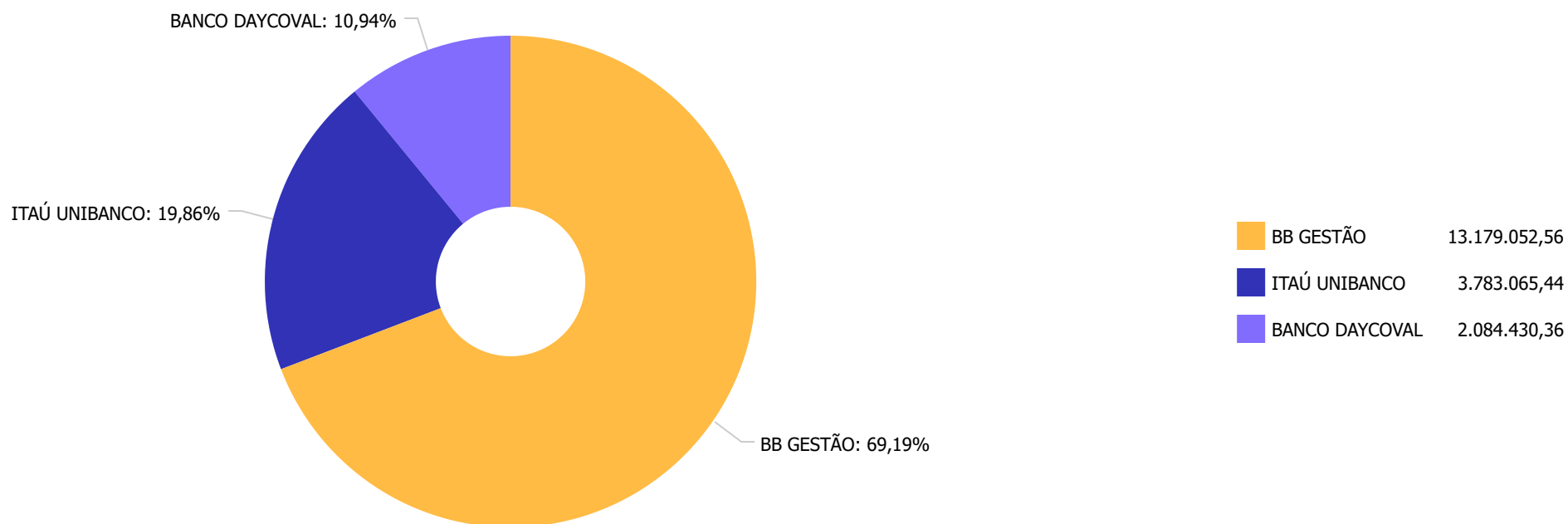
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,95%	10,93%	2,66%	5,54%	10,93%	12,48%	0,66%	0,01%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,37%	10,47%	1,18%	4,66%	10,47%	13,02%	1,12%	0,02%

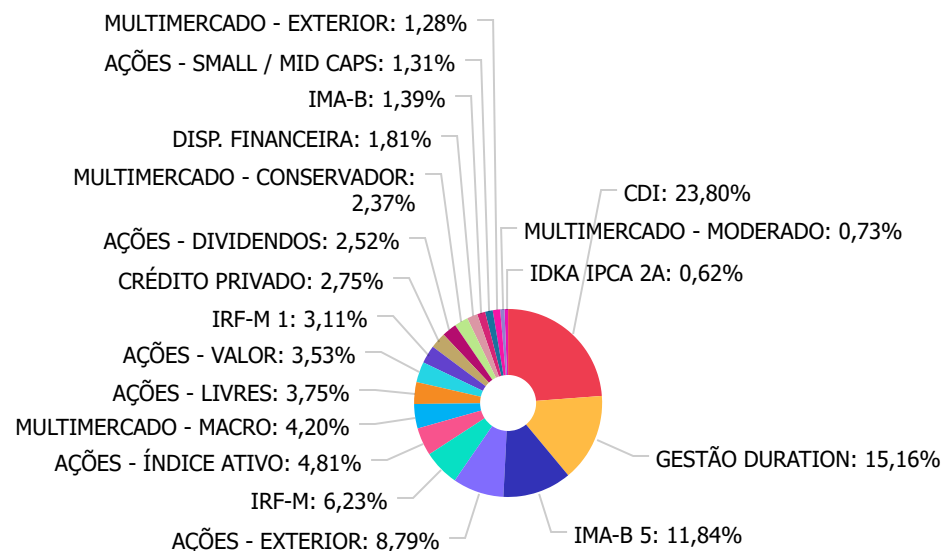
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-7,36%	-29,37%	-10,47%	2,86%	-29,37%	-32,97%	10,58%	24,48%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,79%	-25,15%	5,78%	2,55%	-25,15%	-0,08%	10,03%	19,69%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,82%	-15,97%	6,73%	1,90%	-15,97%	10,96%	9,82%	15,78%

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



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

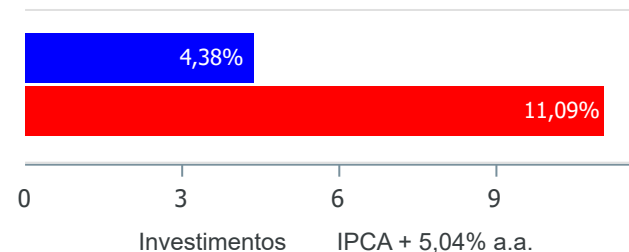


■ CDI	4.617.288,33	■ GESTÃO DURATION	2.940.265,95	■ IMA-B 5	2.296.508,24
■ AÇÕES - EXTERIOR	1.705.048,83	■ IRF-M	1.207.678,71	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	932.829,81
■ MULTIMERCADO - MACRO	814.397,67	■ AÇÕES - LIVRES	727.733,54	■ AÇÕES - VALOR	683.798,37
■ IRF-M 1	602.420,72	■ CRÉDITO PRIVADO	534.212,75	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	488.759,52
■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	460.231,58	■ DISP. FINANCEIRA	351.172,78	■ IMA-B	269.554,55
■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	254.921,64	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	248.398,77	■ MULTIMERCADO - MODERADO	142.317,02
■ IDKA IPCA 2A	120.182,36				

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	14.519.410,01	0,00	115.393,89	14.462.684,47	58.668,35	58.668,35	0,40%	0,40%	0,95%	0,95%	42,41%	3,61%
Fevereiro	14.462.684,47	1.038.382,95	628.714,67	14.876.681,66	4.328,91	62.997,26	0,03%	0,43%	1,39%	2,35%	18,43%	2,99%
Março	14.876.681,66	390.258,59	139.115,17	15.459.209,15	331.384,07	394.381,33	2,19%	2,63%	2,06%	4,46%	59,09%	3,75%
Abril	15.459.209,15	2.018.684,19	1.642.811,12	15.572.203,95	-262.878,27	131.503,06	-1,66%	0,93%	1,44%	5,96%	15,61%	3,29%
Mai	15.572.203,95	466.397,72	175.678,90	15.981.812,85	118.890,08	250.393,14	0,75%	1,69%	0,90%	6,91%	24,39%	3,49%
Junho	15.981.812,85	2.325.698,81	2.521.196,50	15.464.824,27	-321.490,89	-71.097,75	-2,01%	-0,36%	1,08%	8,07%	-4,46%	3,12%
Julho	15.464.824,27	5.211.510,57	4.412.699,85	16.592.720,17	329.085,18	257.987,43	2,02%	1,66%	-0,27%	7,78%	21,30%	3,13%
Agosto	16.592.720,17	918.848,36	374.569,96	17.370.587,17	233.588,60	491.576,03	1,36%	3,04%	0,09%	7,87%	38,65%	3,55%
Setembro	17.370.587,17	704.787,01	364.851,86	17.680.521,25	-30.001,07	461.574,96	-0,17%	2,87%	0,12%	8,00%	35,85%	3,56%
Outubro	17.680.521,25	517.491,92	239.953,55	18.381.691,62	423.632,00	885.206,96	2,36%	5,29%	0,98%	9,06%	58,42%	4,55%
Novembro	18.381.691,62	432.826,50	201.030,24	18.503.981,18	-109.506,70	775.700,26	-0,59%	4,67%	0,80%	9,94%	47,04%	5,43%
Dezembro	18.503.981,18	2.434.223,87	1.838.102,90	19.046.548,36	-53.553,79	722.146,47	-0,28%	4,38%	1,05%	11,09%	39,49%	3,34%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



- 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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.186.545,68	4.105,28	0,00	1.207.678,71	17.027,75	1,43%	1,43%	1,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.057.604,73	0,00	0,00	1.071.132,39	13.527,66	1,28%	1,28%	0,24%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	527.889,08	0,00	0,00	534.212,75	6.323,67	1,20%	1,20%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	595.529,97	0,00	0,00	602.420,72	6.890,75	1,16%	1,16%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	824.007,24	0,00	0,00	833.455,05	9.447,81	1,15%	1,15%	0,16%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	270.750,61	0,00	0,00	273.763,62	3.013,01	1,11%	1,11%	0,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.437.326,89	539.658,78	429.951,91	1.566.672,66	19.638,90	0,99%	1,12%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	458.661,90	603.491,10	300.000,00	772.656,80	10.503,80	0,99%	0,77%	1,26%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	67.424,76	4.868,78	4.659,89	68.329,69	696,04	0,96%	1,03%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	796.330,23	0,00	0,00	803.934,92	7.604,69	0,95%	0,95%	0,60%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	121.134,96	0,00	0,00	122.241,84	1.106,88	0,91%	0,91%	1,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	182.099,93	0,00	183.726,23	1.626,30	0,89%	-0,08%	2,95%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.536.945,22	0,00	0,00	1.550.217,61	13.272,39	0,86%	0,86%	1,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	615.125,34	0,00	500.000,00	120.182,36	5.057,02	0,82%	1,22%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	568.546,03	800.000,00	0,00	1.379.072,06	10.526,03	0,77%	1,32%	0,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	491.982,82	300.000,00	0,00	795.194,34	3.211,52	0,41%	0,32%	2,22%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	86.015,92	0,00	0,00	85.828,32	-187,60	-0,22%	-0,22%	2,47%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	619.683,04	0,00	0,00	617.391,54	-2.291,50	-0,37%	-0,37%	1,53%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	605.829,64	0,00	603.491,10	0,00	-2.338,54	-0,39%	-	-
Total Renda Fixa	11.867.334,06	2.434.223,87	1.838.102,90	12.588.111,61	124.656,58	1,00%		0,88%

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	455.437,78	0,00	0,00	460.231,58	4.793,80	1,05%	1,05%	0,56%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	140.978,16	0,00	0,00	142.317,02	1.338,86	0,95%	0,95%	0,66%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	811.421,55	0,00	0,00	814.397,67	2.976,12	0,37%	0,37%	1,12%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	455.345,78	0,00	0,00	450.337,61	-5.008,17	-1,10%	-1,10%	10,52%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	39.335,59	0,00	0,00	38.421,91	-913,68	-2,32%	-2,32%	8,95%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	490.809,32	0,00	0,00	478.877,12	-11.932,20	-2,43%	-2,43%	9,40%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	701.156,84	0,00	0,00	683.798,37	-17.358,47	-2,48%	-2,48%	9,73%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	746.901,17	0,00	0,00	727.733,54	-19.167,63	-2,57%	-2,57%	9,73%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	125.721,33	0,00	0,00	122.398,72	-3.322,61	-2,64%	-2,64%	13,31%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	136.518,27	0,00	0,00	132.522,92	-3.995,35	-2,93%	-2,93%	14,02%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	137.579,25	0,00	0,00	131.274,12	-6.305,13	-4,58%	-4,58%	8,14%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	476.853,33	0,00	0,00	453.952,69	-22.900,64	-4,80%	-4,80%	11,90%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	260.958,92	0,00	0,00	248.398,77	-12.560,15	-4,81%	-4,81%	8,32%
Total Renda Variável	4.979.017,29	0,00	0,00	4.884.662,04	-94.355,25	-1,90%		7,49%



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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	413.718,82	0,00	0,00	397.914,37	-15.804,45	-3,82%	-3,82%	9,82%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	913.293,78	0,00	0,00	869.567,83	-43.725,95	-4,79%	-4,79%	10,03%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	330.617,23	0,00	0,00	306.292,51	-24.324,72	-7,36%	-7,36%	10,58%
Total Exterior	1.657.629,83	0,00	0,00	1.573.774,71	-83.855,12	-5,06%		10,08%

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...	1.405.319,97	943.337,31	831.219,81	1.566.672,66	49.235,19	2,10%	3,22%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.514.702,32	0,00	0,00	1.550.217,61	35.515,29	2,34%	2,34%
ITAU INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.040.050,48	0,00	0,00	1.071.132,39	31.081,91	2,99%	2,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	773.225,17	22.723,46	22.723,46	803.934,92	30.709,75	3,86%	3,98%
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	811.961,10	0,00	0,00	833.455,05	21.493,95	2,65%	2,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	560.865,02	800.000,00	0,00	1.379.072,06	18.207,04	1,34%	2,71%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	823.328,03	366.164,95	0,00	1.207.678,71	18.185,73	1,53%	1,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	584.385,88	0,00	0,00	602.420,72	18.034,84	3,09%	3,09%
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	516.397,62	0,00	0,00	534.212,75	17.815,13	3,45%	3,45%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	454.579,11	603.491,10	300.000,00	772.656,80	14.586,59	1,38%	1,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	607.899,72	0,00	500.000,00	120.182,36	12.282,64	2,02%	2,42%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	265.879,01	0,00	0,00	273.763,62	7.884,61	2,97%	2,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	502.183,57	300.000,00	14.187,64	795.194,34	7.198,41	0,90%	1,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	600.255,23	0,00	603.491,10	0,00	3.235,87	0,54%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	119.326,78	0,00	0,00	122.241,84	2.915,06	2,44%	2,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	182.099,93	0,00	183.726,23	1.626,30	0,89%	0,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	35.646,71	38.647,40	7.464,68	68.329,69	1.500,26	2,02%	2,95%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	85.686,55	0,00	0,00	85.828,32	141,77	0,17%	0,17%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	620.676,39	0,00	0,00	617.391,54	-3.284,85	-0,53%	-0,53%



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
Total Renda Fixa	11.322.368,66	3.256.464,15	2.279.086,69	12.588.111,61	288.365,49	2,34%	

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
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	226.316,37	0,00	0,00	248.398,77	22.082,40	9,76%	9,76%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	447.806,31	0,00	0,00	460.231,58	12.425,27	2,77%	2,77%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	115.758,25	5.717,83	0,00	131.274,12	9.798,04	8,07%	8,56%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	714.844,37	90.863,00	0,00	814.397,67	8.690,30	1,08%	1,18%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	138.626,10	0,00	0,00	142.317,02	3.690,92	2,66%	2,66%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	38.004,33	0,00	0,00	38.421,91	417,58	1,10%	1,10%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	482.629,63	0,00	0,00	478.877,12	-3.752,51	-0,78%	-0,78%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	131.106,59	0,00	0,00	122.398,72	-8.707,87	-6,64%	-6,64%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	461.527,07	0,00	0,00	450.337,61	-11.189,46	-2,42%	-2,42%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	145.441,46	0,00	0,00	132.522,92	-12.918,54	-8,88%	-8,88%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	697.671,57	0,00	0,00	683.798,37	-13.873,20	-1,99%	-1,99%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	715.465,37	31.497,31	0,00	727.733,54	-19.229,14	-2,57%	-2,39%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	505.988,80	0,00	0,00	453.952,69	-52.036,11	-10,28%	-10,28%
Total Renda Variável	4.821.186,22	128.078,14	0,00	4.884.662,04	-64.602,32	-1,31%	



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
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	822.034,47	0,00	0,00	869.567,83	47.533,36	5,78%	5,78%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	372.806,74	0,00	0,00	397.914,37	25.107,63	6,73%	6,73%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	342.125,16	0,00	0,00	306.292,51	-35.832,65	-10,47%	-10,47%
Total Exterior	1.536.966,37	0,00	0,00	1.573.774,71	36.808,34	2,39%	

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...	460.021,07	4.810.919,42	3.866.210,98	1.566.672,66	161.943,15	3,07%	12,59%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.617.307,90	1.014.179,04	3.005.402,45	772.656,80	146.572,31	4,04%	9,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.784.405,10	684.901,38	2.450.675,88	120.182,36	101.551,76	4,11%	9,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	320.636,48	652.092,49	0,00	1.071.132,39	98.403,42	10,12%	13,11%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.367.152,32	59.253,68	1.386.014,33	122.241,84	81.850,17	5,74%	9,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	781.758,31	42.020,43	803.934,92	64.197,04	8,21%	11,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	405.548,17	366.816,80	0,00	833.455,05	61.090,08	7,91%	11,81%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.550.217,61	50.217,61	3,35%	9,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	572.565,05	0,00	0,00	617.391,54	44.826,49	7,83%	7,83%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	562.602,26	0,00	603.491,10	0,00	40.888,84	7,27%	-
DAYCOVAL CLASSIC FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	500.000,00	0,00	534.212,75	34.212,75	6,84%	13,74%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	1.174.133,40	0,00	1.207.678,71	33.545,31	2,86%	8,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	571.750,08	0,00	602.420,72	30.670,64	5,36%	11,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,00	1.370.000,00	16.244,83	1.379.072,06	25.316,89	1,85%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	314.081,16	0,00	329.800,25	0,00	15.719,09	5,00%	9,60%
ITAÚ IDKA 2 IPCA FIC RENDA FIXA	307.327,92	0,00	322.292,24	0,00	14.964,32	4,87%	8,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	113.258,79	176.356,81	233.851,74	68.329,69	12.565,83	4,34%	11,26%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,00	263.083,80	0,00	273.763,62	10.679,82	4,06%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	800.000,00	14.187,64	795.194,34	9.381,98	1,17%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	80.898,92	0,00	0,00	85.828,32	4.929,40	6,09%	6,09%



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 TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2030 FI RENDA FIXA PRE...	0,00	182.099,93	0,00	183.726,23	1.626,30	0,89%	-
Total Renda Fixa	8.905.805,14	14.907.345,14	12.270.191,87	12.588.111,61	1.045.153,20	9,05%	

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
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	576.323,07	172.217,00	0,00	814.397,67	65.857,60	8,80%	10,47%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	411.745,01	0,00	0,00	460.231,58	48.486,57	11,78%	11,78%
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	89.495,12	340.000,00	0,00	450.337,61	20.842,49	4,85%	1,76%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	128.298,55	0,00	0,00	142.317,02	14.018,47	10,93%	10,93%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	466.576,22	0,00	0,00	478.877,12	12.300,90	2,64%	2,64%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	292.169,22	383.926,74	0,00	683.798,37	7.702,41	1,14%	-3,47%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	35.807,89	0,00	0,00	38.421,91	2.614,02	7,30%	7,30%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	615.941,70	112.851,31	0,00	727.733,54	-1.059,47	-0,15%	-0,75%
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	135.167,35	0,00	0,00	122.398,72	-12.768,63	-9,45%	-9,45%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	119.884,84	27.770,30	0,00	131.274,12	-16.381,02	-11,09%	-13,32%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	404.246,08	0,00	383.926,74	0,00	-20.319,34	-5,03%	3,65%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	157.530,44	0,00	0,00	132.522,92	-25.007,52	-15,87%	-15,87%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	282.018,75	0,00	0,00	248.398,77	-33.619,98	-11,92%	-11,92%
ITAÚ MOMENTO 30 II FIC AÇÕES	493.945,66	0,00	0,00	453.952,69	-39.992,97	-8,10%	-8,10%
Total Renda Variável	4.209.149,90	1.036.765,35	383.926,74	4.884.662,04	22.673,53	0,47%	



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
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	473.519,91	0,00	0,00	397.914,37	-75.605,54	-15,97%	-15,97%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	302.106,63	100.000,00	0,00	306.292,51	-95.814,12	-23,83%	-29,37%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	628.828,43	415.000,00	0,00	869.567,83	-174.260,60	-16,69%	-25,15%
Total Exterior	1.404.454,97	515.000,00	0,00	1.573.774,71	-345.680,26	-18,01%	

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.

