
REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE

SORRISO / MT

**RELATÓRIO ANUAL
DE
INVESTIMENTOS
2022**

14 de janeiro de 2023



ÍNDICE

1 – INTRODUÇÃO	3
2 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS	4
3 – MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA DOS INVESTIMENTOS	20
4 – DESEMPENHO (RENTABILIDADE) DOS INVESTIMENTOS	31
4.1 - Rentabilidade Relativa dos Investimentos sobre seu Benchmark	38
4.2 - Análise dos Investimentos de LONGO PRAZO	55
4.2.1 - Renda Variável	55
5 – ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA E RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021	68
6 – DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO	77
6.1 - Desempenho MENSAL da carteira de Investimento	77
6.2 - Desempenho ACUMULADO DO ANO da carteira de Investimento	81
7 – CONSIDERAÇÕES FINAIS	84
7.1 - Meta Atuarial	84
7.2 - Inflação	85
7.3 - Rentabilidade da Carteira	86
7.4 - ALM - Asset Liability Management	86
7.5 - Conclusão	90

1 - INTRODUÇÃO

A atividade de gestão dos recursos financeiros do PREVISÓ é desempenhada por GESTÃO PRÓPRIA, de acordo com o amparo legal previsto no Inciso I, § 1º, do Art. 21 da Resolução CMN 4.963/21.

Art. 15 – A gestão das aplicações dos recursos dos regimes próprios de previdência social poderá ser própria, por entidade credenciada ou mista.

§ 1º - Para fins desta resolução, considera-se:

I – gestão própria, quando as aplicações são realizadas diretamente pelo órgão ou entidade gestora do regime próprio de previdência social. (GRIFO NOSSO).

As movimentações financeiras são disponibilizadas no site do Ministério da Previdência Social de forma mensal, atendendo o prazo de informação do **DAIR - Demonstrativo das Aplicações e Investimentos dos recursos** dos RPPS para emissão do **CRP – Certidão de Regularidade Previdenciária**.

2 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI
CNPJ	13.077.418/0001-49
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa
ÍNDICE	CDI
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.
AUDITOR INDEPENDENTE	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	28/04/2011
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,2% a 0,3% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	2 - Baixo
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	12.858.761.791,29
NÚMERO DE COTISTAS **	1.060
VALOR DA COTA **	2,711319038
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	06/08/2018
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI
CNPJ	11.328.882/0001-35
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IRF – M 1
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.
AUDITOR INDEPENDENTE	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	08/12/2009
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,10% a 0,30% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	2 - Baixo
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	6.516.931.621,39
NÚMERO DE COTISTAS **	1.114
VALOR DA COTA **	3,125212858
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	05/02/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI
CNPJ	13.322.205/0001-35
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Previdência Renda Fixa
ÍNDICE	IDKA 2
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.
AUDITOR INDEPENDENTE	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	28/04/2011
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00
RESGATE MÍNIMO	0,00
SALDO MÍNIMO	0,01
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	7.489.389.892,90
NÚMERO DE COTISTAS **	987
VALOR DA COTA **	3,307626443
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	05/02/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI
CNPJ	07.111.384/0001-69
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	IRF – M
PÚBLICO ALVO	Regime Próprio de Previdência Social/EFPCs/FIs e FICs administrados pela BB DTVM
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.
AUDITOR INDEPENDENTE	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	08/12/2004
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	4.012.099.701,11
NÚMERO DE COTISTAS **	478
VALOR DA COTA **	6,523181853
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	09/10/2017
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI
CNPJ	07.442.078/0001-05
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	IMA – B
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.
AUDITOR INDEPENDENTE	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	24/07/2005
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01,
SALDO MÍNIMO	0,01
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	6.078.064.149,48
NÚMERO DE COTISTAS **	553
VALOR DA COTA **	6,834862322
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	11/10/2017
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

6

40

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI
CNPJ	07.861.554/0001-22
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	IMA – B
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
GESTOR	BB Gestão de Recursos DTVM s.a
CUSTODIANTE	Banco do Brasil S.A.
DISTRIBUIDOR	Banco do Brasil S.A.
AUDITOR INDEPENDENTE	PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDITORES INDEPENDENTES LTDA.
DATA DE INÍCIO	09/03/2006
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,3% a 0,6% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	640.688.864,31
NÚMERO DE COTISTAS **	213
VALOR DA COTA **	6,062348687
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	23/05/2016
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

9

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO
CNPJ	03.737.206/0001-97
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Referenciado – DI
ÍNDICE	CDI
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprio de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	Ernst & Young Terco Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	05/07/2006
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	1.000,00
SALDO MÍNIMO	1.000,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	2 - Baixo
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	13.943.633.561,86
NÚMERO DE COTISTAS **	1.000
VALOR DA COTA **	4,406809
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	06/05/2019
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP
CNPJ	14.386.926/0001-71
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IDKA 2
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	kPMG Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	16/08/2012
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00
RESGATE MÍNIMO	0,00
SALDO MÍNIMO	0,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	6.893.208.496,34
NÚMERO DE COTISTAS **	963
VALOR DA COTA **	2,73574
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	26/09/2018
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP
CNPJ	11.060.913/0001-10
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IMA - B 5
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	kPMG Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	09/07/2010
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00
RESGATE MÍNIMO	0,00
SALDO MÍNIMO	0,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	2 - Baixo
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	7.960.289.495,76
NÚMERO DE COTISTAS **	939
VALOR DA COTA **	3,693724
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	17/10/2019
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP
CNPJ	14.508.605/0001-00
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa Índices
ÍNDICE	IRF – M
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
DISTRIBUIDOR	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
AUDITOR INDEPENDENTE	Ernst & Young Terco Auditores Independentes S/S
DATA DE INÍCIO	16/08/2012
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	Qualquer valor
RESGATE MÍNIMO	Qualquer valor
SALDO MÍNIMO	Qualquer valor
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	1.018.108.144,60
NÚMERO DE COTISTAS **	297
VALOR DA COTA **	2,504672
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	26/09/2018
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP
CNPJ	10.740.658/0001-93
SEGMENTO	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Renda Fixa índices
ÍNDICE	IMA – B
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	kPMG Auditores independentes
DATA DE INÍCIO	08/03/2010
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,20% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,00
RESGATE MÍNIMO	0,00
SALDO MÍNIMO	0,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
RISCO DE MERCADO *	3 - Médio
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	3.466.339.701,42
NÚMERO DE COTISTAS **	739
VALOR DA COTA **	3,862857
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	17/10/2019
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP
CNPJ	30.036.235/0001-02
SEGMENTO	Investimentos Estruturados
CLASSIFICAÇÃO	Multimercados Dinâmico
ÍNDICE	S&P500
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	KPMG Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	16/10/2018
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,80% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	10.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	1.000,00
RESGATE MÍNIMO	1.000,00
SALDO MÍNIMO	5.000,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	1.723.160.287,50
NÚMERO DE COTISTAS **	8.904
VALOR DA COTA **	1,557673
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	04/01/2021
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES
CNPJ	13.058.816/0001-18
SEGMENTO	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	AÇÕES INDEXADOS
ÍNDICE	IBOV
PÚBLICO ALVO	Regimes Próprios de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	KPMG Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	29/07/2011
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,50% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00
RESGATE MÍNIMO	100,00
SALDO MÍNIMO	500,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	479.558.546,97
NÚMERO DE COTISTAS **	97
VALOR DA COTA **	2,48668
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	19/02/2021
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES
CNPJ	40.209.029/0001-00
SEGMENTO	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Ações
ÍNDICE	IFNC
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	KPMG Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	26/01/2021
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,80% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	100,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00
RESGATE MÍNIMO	100,00
SALDO MÍNIMO	50,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	21.864.406,75
NÚMERO DE COTISTAS **	351
VALOR DA COTA **	871,1669836
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	17/11/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO
CNPJ	15.154.220/0001-47
SEGMENTO	Renda Variável
CLASSIFICAÇÃO	AÇÕES SMALL CAPS
ÍNDICE	SMLL
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	PricewaterhouseCoopers Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	01/11/2012
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	1,50% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00
RESGATE MÍNIMO	100,00
SALDO MÍNIMO	500,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	5 - Muito Alto
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	569.834.602,44
NÚMERO DE COTISTAS **	6.919
VALOR DA COTA **	1,364647
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	17/12/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

INFORMAÇÕES	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
CNPJ	17.502.937/0001-68
SEGMENTO	Investimento no Exterior
CLASSIFICAÇÃO	Ações Livre
ÍNDICE	BDR
PÚBLICO ALVO	Pessoas físicas, jurídicas e Regimes Próprio de Previdência Social
ADMINISTRADOR	Caixa Econômica Federal
GESTOR	CAIXA ASSET DTVM
CUSTODIANTE	Caixa Econômica Federal
DISTRIBUIDOR	Caixa Econômica Federal
AUDITOR INDEPENDENTE	KPMG Auditores Independentes
DATA DE INÍCIO	24/06/2013
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,70% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não possui
APLICAÇÃO INICIAL	1.000,00
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100,00
RESGATE MÍNIMO	100,00
SALDO MÍNIMO	500,00
CARÊNCIA	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	4 - Alto
TAXA DE ENTRADA	Não possui
TAXA DE SAÍDA	Não possui
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	1.938.590.167,99
NÚMERO DE COTISTAS **	510
VALOR DA COTA **	4,89532131
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	03/11/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)

* Definição da própria Instituição financeira

** Informações posicionadas no último dia útil do mês.

3 - MOVIMENTAÇÃO FINANCEIRA DOS INVESTIMENTOS *

Apresentamos abaixo, a movimentação financeira dos fundos de investimento aplicados ao longo de 2022. Para sabermos a rentabilidade anual do patrimônio do RPPS, fizemos uma análise de cada aplicação da carteira de investimentos, para obtermos um melhor resultado sobre o comportamento das rentabilidades.

Em alguns meses, a Taxa de retorno apresentada nos quadros, não será a mesma taxa de rentabilidade alcançada pelo fundo de investimento pela Instituição financeira. Isso ocorre, devido à movimentação de aplicação e resgate durante os dias no mês analisado.

Para alcançarmos a taxa de rentabilidade apresentada pelo fundo de investimento é necessário que o capital (principal) fique aplicado desde o início, até o último dia do mês.

A rentabilidade das aplicações é diária, portanto, uma aplicação realizada no 20º dia do mês, não capitalizará o valor da taxa apresentada pelo fundo de investimento no último dia do mês.

* A taxa de retorno apresentada nos TÍTULOS PÚBLICOS é o somatório da rentabilidade da taxa de juros de cada Título (1,021% a.m. por exemplo), mais a variação do valor do papel de cada Título. Nas tabelas e gráficos abaixo, apresentamos a TAXA DE RETORNO desses Títulos, extraído dos juros oferecido pelo papel, mais a sua valorização ou desvalorização. Lembrando que, caso o RPPS venda esses papéis antes da data de seu vencimento, contabilmente, o valor que o RPPS receberá pelo papel, será o valor que estiver marcado “Á MERCADO” e não pelo seu VALOR DE COMPRA (Valor de Face).

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO						
1	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	6.243.548,87	-	-	49.132,74	6.292.681,62	0,787%
FEVEREIRO	6.292.681,62	-	-	51.541,57	6.344.223,19	0,819%
MARÇO	6.344.223,19	-	-	58.846,27	6.403.069,46	0,928%
ABRIL	6.403.069,46	-	-	51.231,88	6.454.301,34	0,800%
MAIO	6.454.301,34	-	-	69.479,28	6.523.780,62	1,076%
JUNHO	6.523.780,62	-	-	69.191,93	6.592.972,55	1,061%
JULHO	6.592.972,55	1.300.000,00	-	66.384,12	7.959.356,67	1,007%
AGOSTO	7.959.356,67	-	-	94.496,41	8.053.853,08	1,187%
SETEMBRO	8.053.853,08	1.450.000,00	-	89.006,98	9.592.860,06	1,105%
OUTUBRO	9.592.860,06	-	-	99.014,76	9.691.874,82	1,032%
NOVEMBRO	9.691.874,82	-	-	100.611,47	9.792.486,29	1,038%
DEZEMBRO	9.792.486,29	-	-	112.583,76	9.905.070,05	1,150%

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP						
2	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	19.319.175,38	-	-	3.634,48	19.322.809,86	0,019%
FEVEREIRO	19.322.809,86	-	-	221.487,81	19.544.297,67	1,146%
MARÇO	19.544.297,67	-	-	513.324,43	20.057.622,10	2,626%
ABRIL	20.057.622,10	-	-	280.902,37	20.338.524,47	1,400%
MAIO	20.338.524,47	-	-	173.523,42	20.512.047,89	0,853%
JUNHO	20.512.047,89	-	-	46.016,24	20.558.064,13	0,224%
JULHO	20.558.064,13	-	-	(60.123,80)	20.497.940,33	-0,292%
AGOSTO	20.497.940,33	-	-	(22.291,69)	20.475.648,64	-0,109%
SETEMBRO	20.475.648,64	-	-	104.435,70	20.580.084,34	0,510%
OUTUBRO	20.580.084,34	-	-	376.625,89	20.956.710,23	1,830%
NOVEMBRO	20.956.710,23	-	-	(147.805,22)	20.808.905,01	-0,705%
DEZEMBRO	20.808.905,01	-	-	256.770,02	21.065.675,03	1,234%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP						
3	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	43.435.692,23	-	-	39.256,23	43.474.948,46	0,090%
FEVEREIRO	43.474.948,46	-	-	456.888,91	43.931.837,37	1,051%
MARÇO	43.931.837,37	-	-	1.136.225,45	45.068.062,82	2,586%
ABRIL	45.068.062,82	-	-	692.155,46	45.760.218,28	1,536%
MAIO	45.760.218,28	-	-	349.901,47	46.110.119,75	0,765%
JUNHO	46.110.119,75	-	-	153.813,74	46.263.933,49	0,334%
JULHO	46.263.933,49	-	-	9.567,62	46.273.501,11	0,021%
AGOSTO	46.273.501,11	-	-	22.031,07	46.295.532,18	0,048%
SETEMBRO	46.295.532,18	-	-	197.745,66	46.493.277,84	0,427%
OUTUBRO	46.493.277,84	-	-	871.936,11	47.365.213,95	1,875%
NOVEMBRO	47.365.213,95	-	-	(165.179,22)	47.200.034,73	-0,349%
DEZEMBRO	47.200.034,73	-	-	435.210,25	47.635.244,98	0,922%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
4	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	17.108.621,06	-	-	(129.535,73)	16.979.085,33	-0,757%
FEVEREIRO	16.979.085,33	-	-	89.486,46	17.068.571,79	0,527%
MARÇO	17.068.571,79	-	-	522.832,17	17.591.403,96	3,063%
ABRIL	17.591.403,96	-	-	140.988,45	17.732.392,41	0,801%
MAIO	17.732.392,41	-	-	171.278,21	17.903.670,62	0,966%
JUNHO	17.903.670,62	-	-	(67.747,46)	17.835.923,16	-0,378%
JULHO	17.835.923,16	-	-	(164.951,73)	17.670.971,43	-0,925%
AGOSTO	17.670.971,43	-	-	211.379,38	17.882.350,81	1,196%
SETEMBRO	17.882.350,81	-	-	267.599,01	18.149.949,82	1,496%
OUTUBRO	18.149.949,82	-	-	213.985,43	18.363.935,25	1,179%
NOVEMBRO	18.363.935,25	-	-	(152.325,08)	18.211.610,17	-0,829%
DEZEMBRO	18.211.610,17	-	-	(43.134,69)	18.168.475,48	-0,237%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP						
5	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	21.333.494,60	-	-	(15.316,83)	21.318.177,76	-0,072%
FEVEREIRO	21.318.177,76	-	-	126.099,95	21.444.277,71	0,592%
MARÇO	21.444.277,71	-	-	182.922,23	21.627.199,94	0,853%
ABRIL	21.627.199,94	-	-	(37.264,16)	21.589.935,78	-0,172%
MAIO	21.589.935,78	-	-	127.137,10	21.717.072,88	0,589%
JUNHO	21.717.072,88	-	-	74.750,59	21.791.823,47	0,344%
JULHO	21.791.823,47	-	-	244.414,68	22.036.238,15	1,122%
AGOSTO	22.036.238,15	-	-	450.080,30	22.486.318,45	2,042%
SETEMBRO	22.486.318,45	-	-	307.010,70	22.793.329,15	1,365%
OUTUBRO	22.793.329,15	-	-	213.497,76	23.006.826,91	0,937%
NOVEMBRO	23.006.826,91	-	-	(142.501,09)	22.864.325,82	-0,619%
DEZEMBRO	22.864.325,82	-	-	330.136,07	23.194.461,89	1,444%

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP						
6	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	4.997.042,21	-	-	(37.834,46)	4.959.207,75	-0,757%
FEVEREIRO	4.959.207,75	-	-	26.136,97	4.985.344,72	0,527%
MARÇO	4.985.344,72	-	-	152.707,48	5.138.052,20	3,063%
ABRIL	5.138.052,20	-	-	41.179,55	5.179.231,75	0,801%
MAIO	5.179.231,75	-	-	50.026,50	5.229.258,25	0,966%
JUNHO	5.229.258,25	-	-	(19.787,51)	5.209.470,74	-0,378%
JULHO	5.209.470,74	-	-	(48.178,67)	5.161.292,07	-0,925%
AGOSTO	5.161.292,07	452.562,05	-	60.222,65	5.674.076,77	1,167%
SETEMBRO	5.674.076,77	-	-	84.909,26	5.758.986,03	1,496%
OUTUBRO	5.758.986,03	-	-	67.897,65	5.826.883,68	1,179%
NOVEMBRO	5.826.883,68	-	-	(48.332,81)	5.778.550,87	-0,829%
DEZEMBRO	5.778.550,87	-	-	(13.686,63)	5.764.864,24	-0,237%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI						
7	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	13.774.910,39	-	-	1.326,74	13.776.237,12	0,010%
FEVEREIRO	13.776.237,12	-	-	159.347,39	13.935.584,52	1,157%
MARÇO	13.935.584,52	751.892,18	-	373.028,98	15.060.505,68	2,677%
ABRIL	15.060.505,68	371.862,78	-	223.480,58	15.655.849,04	1,484%
MAIO	15.655.849,04	365.099,68	-	121.332,44	16.142.281,16	0,775%
JUNHO	16.142.281,16	379.327,64	-	42.955,58	16.564.564,38	0,266%
JULHO	16.564.564,38	372.213,66	-	(36.590,00)	16.900.188,04	-0,216%
AGOSTO	16.900.188,04	-	-	(7.530,73)	16.892.657,31	-0,045%
SETEMBRO	16.892.657,31	744.427,32	-	91.266,92	17.728.351,55	0,540%
OUTUBRO	17.728.351,55	-	-	328.724,99	18.057.076,54	1,854%
NOVEMBRO	18.057.076,54	744.427,32	-	(120.271,77)	18.681.232,09	-0,640%
DEZEMBRO	18.681.232,09	737.313,34	-	232.308,97	19.650.854,40	1,244%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI						
8	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	845.321,69	-	-	(6.401,13)	838.920,56	-0,757%
FEVEREIRO	838.920,56	-	-	4.609,38	843.529,94	0,549%
MARÇO	843.529,94	-	-	25.931,15	869.461,09	3,074%
ABRIL	869.461,09	-	-	7.344,85	876.805,94	0,845%
MAIO	876.805,94	-	-	8.114,50	884.920,44	0,925%
JUNHO	884.920,44	-	-	(3.594,96)	881.325,48	-0,406%
JULHO	881.325,48	-	-	(8.369,17)	872.956,31	-0,950%
AGOSTO	872.956,31	-	-	9.208,79	882.165,10	1,055%
SETEMBRO	882.165,10	-	-	12.804,41	894.969,51	1,451%
OUTUBRO	894.969,51	-	-	10.540,34	905.509,85	1,178%
NOVEMBRO	905.509,85	-	-	(6.871,62)	898.638,23	-0,759%
DEZEMBRO	898.638,23	-	-	(2.128,29)	896.509,94	-0,237%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI						
9	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	21.013.390,28	-	-	(26.745,16)	20.986.645,12	-0,127%
FEVEREIRO	20.986.645,12	-	-	119.183,16	21.105.828,27	0,568%
MARÇO	21.105.828,27	900.000,00	-	178.205,80	22.184.034,07	0,844%
ABRIL	22.184.034,07	-	-	(22.910,55)	22.161.123,52	-0,103%
MAIO	22.161.123,52	-	-	127.609,18	22.288.732,70	0,576%
JUNHO	22.288.732,70	-	-	75.416,33	22.364.149,03	0,338%
JULHO	22.364.149,03	-	-	252.998,47	22.617.147,50	1,131%
AGOSTO	22.617.147,50	-	-	464.071,09	23.081.218,59	2,052%
SETEMBRO	23.081.218,59	-	-	317.653,96	23.398.872,55	1,376%
OUTUBRO	23.398.872,55	-	-	209.342,63	23.608.215,18	0,895%
NOVEMBRO	23.608.215,18	-	-	(162.849,40)	23.445.365,78	-0,690%
DEZEMBRO	23.445.365,78	-	-	336.047,37	23.781.413,15	1,433%

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI						
10	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	25.481.391,29	-	-	(195.668,39)	25.285.722,90	-0,768%
FEVEREIRO	25.285.722,90	-	-	134.917,65	25.420.640,56	0,534%
MARÇO	25.420.640,56	-	-	765.116,74	26.185.757,30	3,010%
ABRIL	26.185.757,30	-	-	210.442,15	26.396.199,45	0,804%
MAIO	26.396.199,45	-	-	253.262,87	26.649.462,32	0,959%
JUNHO	26.649.462,32	-	-	(94.001,93)	26.555.460,39	-0,353%
JULHO	26.555.460,39	-	-	(235.159,49)	26.320.300,90	-0,886%
AGOSTO	26.320.300,90	-	-	283.219,58	26.603.520,48	1,076%
SETEMBRO	26.603.520,48	-	-	385.870,52	26.989.391,00	1,450%
OUTUBRO	26.989.391,00	-	-	322.090,16	27.311.481,16	1,193%
NOVEMBRO	27.311.481,16	-	-	(218.347,78)	27.093.133,38	-0,799%
DEZEMBRO	27.093.133,38	-	-	(59.089,98)	27.034.043,40	-0,218%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI						
11	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	10.819.072,00	-	-	66.434,68	10.885.506,68	0,614%
FEVEREIRO	10.885.506,68	-	-	80.244,11	10.965.750,79	0,737%
MARÇO	10.965.750,79	-	-	95.093,78	11.060.844,57	0,867%
ABRIL	11.060.844,57	-	-	77.389,20	11.138.233,77	0,700%
MAIO	11.138.233,77	-	-	102.649,28	11.240.883,05	0,922%
JUNHO	11.240.883,05	-	-	103.203,88	11.344.086,93	0,918%
JULHO	11.344.086,93	-	-	118.220,50	11.462.307,43	1,042%
AGOSTO	11.462.307,43	-	-	138.037,13	11.600.344,56	1,204%
SETEMBRO	11.600.344,56	-	-	125.958,83	11.726.303,39	1,086%
OUTUBRO	11.726.303,39	-	-	115.364,62	11.841.668,01	0,984%
NOVEMBRO	11.841.668,01	-	-	108.252,92	11.949.920,93	0,914%
DEZEMBRO	11.949.920,93	-	-	138.270,09	12.088.191,02	1,157%

BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI						
12	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	29.452.710,57	-	-	2.836,75	29.455.547,32	0,010%
FEVEREIRO	29.455.547,32	-	-	340.707,31	29.796.254,63	1,157%
MARÇO	29.796.254,63	-	-	780.710,32	30.576.964,95	2,620%
ABRIL	30.576.964,95	-	-	453.726,98	31.030.691,93	1,484%
MAIO	31.030.691,93	-	-	240.487,10	31.271.179,03	0,775%
JUNHO	31.271.179,03	-	-	83.214,48	31.354.393,51	0,266%
JULHO	31.354.393,51	-	-	(69.259,72)	31.285.133,79	-0,221%
AGOSTO	31.285.133,79	-	-	(13.940,67)	31.271.193,12	-0,045%
SETEMBRO	31.271.193,12	-	-	165.591,08	31.436.784,20	0,530%
OUTUBRO	31.436.784,20	-	-	582.911,30	32.019.695,51	1,854%
NOVEMBRO	32.019.695,51	-	-	(209.247,01)	31.810.448,50	-0,653%
DEZEMBRO	31.810.448,50	-	-	387.647,60	32.198.096,10	1,219%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA FIXA

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI						
13	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	18.184.952,97	-	-	142.453,25	18.327.406,22	0,783%
FEVEREIRO	18.327.406,22	-	-	146.310,93	18.473.717,15	0,798%
MARÇO	18.473.717,15	800.000,00	-	183.393,97	19.457.111,12	0,993%
ABRIL	19.457.111,12	1.100.000,00	-	152.177,59	20.709.288,71	0,782%
MAIO	20.709.288,71	550.000,00	-	220.797,61	21.480.086,32	1,066%
JUNHO	21.480.086,32	1.300.000,00	-	220.366,67	23.000.452,99	1,026%
JULHO	23.000.452,99	-	-	238.333,87	23.238.786,86	1,036%
AGOSTO	23.238.786,86	-	-	274.985,84	23.513.772,70	1,183%
SETEMBRO	23.513.772,70	1.200.000,00	-	266.305,15	24.980.077,85	1,133%
OUTUBRO	24.980.077,85	-	-	259.568,49	25.239.646,34	1,039%
NOVEMBRO	25.239.646,34	1.450.000,00	-	272.073,23	26.961.719,57	1,078%
DEZEMBRO	26.961.719,57	4.930.000,00	-	320.419,57	32.212.139,14	1,188%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL

FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP

14	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	2.575.240,11	-	-	(136.561,42)	2.438.678,69	-5,303%
FEVEREIRO	2.438.678,69	-	-	(51.076,83)	2.387.601,86	-2,094%
MARÇO	2.387.601,86	-	-	109.098,37	2.496.700,23	4,569%
ABRIL	2.496.700,23	-	-	(217.073,24)	2.279.626,99	-8,694%
MAIO	2.279.626,99	-	-	22.189,03	2.301.816,02	0,973%
JUNHO	2.301.816,02	-	-	(179.085,42)	2.122.730,60	-7,780%
JULHO	2.122.730,60	-	-	214.515,55	2.337.246,15	10,106%
AGOSTO	2.337.246,15	-	-	(75.707,33)	2.261.538,82	-3,239%
SETEMBRO	2.261.538,82	-	-	(195.050,93)	2.066.487,89	-8,625%
OUTUBRO	2.066.487,89	-	-	181.282,47	2.247.770,36	8,772%
NOVEMBRO	2.247.770,36	-	-	135.852,70	2.383.623,06	6,044%
DEZEMBRO	2.383.623,06	-	-	(116.734,35)	2.266.888,71	-4,897%

CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES

15	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	2.753.620,47	-	-	190.792,40	2.944.412,86	6,929%
FEVEREIRO	2.944.412,86	-	-	24.869,40	2.969.282,26	0,845%
MARÇO	2.969.282,26	-	-	177.892,33	3.147.174,59	5,991%
ABRIL	3.147.174,59	-	-	(314.265,57)	2.832.909,02	-9,986%
MAIO	2.832.909,02	-	-	89.552,13	2.922.461,15	3,161%
JUNHO	2.922.461,15	-	-	(329.030,58)	2.593.430,57	-11,26%
JULHO	2.593.430,57	-	-	120.114,42	2.713.544,99	4,631%
AGOSTO	2.713.544,99	-	-	166.817,77	2.880.362,76	6,148%
SETEMBRO	2.880.362,76	-	-	13.576,32	2.893.939,08	0,471%
OUTUBRO	2.893.939,08	-	-	155.160,02	3.049.099,10	5,362%
NOVEMBRO	3.049.099,10	-	-	(92.199,83)	2.956.899,27	-3,024%
DEZEMBRO	2.956.899,27	-	-	(67.480,73)	2.889.418,54	-2,282%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL

CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES

16	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.657.320,83	-	-	276.139,45	1.933.460,28	16,662%
FEVEREIRO	1.933.460,28	-	-	(23.836,33)	1.909.623,95	-1,233%
MARÇO	1.909.623,95	-	-	142.762,24	2.052.386,19	7,476%
ABRIL	2.052.386,19	-	-	(244.477,95)	1.807.908,24	-11,91%
MAIO	1.807.908,24	-	-	111.340,40	1.919.248,64	6,159%
JUNHO	1.919.248,64	-	-	(240.826,51)	1.678.422,13	-12,55%
JULHO	1.678.422,13	-	-	58.947,37	1.737.369,50	3,512%
AGOSTO	1.737.369,50	-	-	172.708,65	1.910.078,15	9,941%
SETEMBRO	1.910.078,15	-	-	57.638,75	1.967.716,90	3,018%
OUTUBRO	1.967.716,90	-	-	133.109,85	2.100.826,75	6,765%
NOVEMBRO	2.100.826,75	-	-	(260.746,39)	1.840.080,36	-12,41%
DEZEMBRO	1.840.080,36	-	-	2.863,57	1.842.943,93	0,156%

FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO

17	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.661.846,78	-	-	66.127,70	1.727.974,48	3,979%
FEVEREIRO	1.727.974,48	-	-	(89.905,30)	1.638.069,18	-5,203%
MARÇO	1.638.069,18	-	-	140.317,73	1.778.386,91	8,566%
ABRIL	1.778.386,91	-	-	(148.348,08)	1.630.038,83	-8,342%
MAIO	1.630.038,83	-	-	(31.282,08)	1.598.756,75	-1,919%
JUNHO	1.598.756,75	-	-	(260.418,30)	1.338.338,45	-16,29%
JULHO	1.338.338,45	-	-	66.663,70	1.405.002,15	4,981%
AGOSTO	1.405.002,15	-	-	149.957,25	1.554.959,40	10,673%
SETEMBRO	1.554.959,40	-	-	(30.106,21)	1.524.853,19	-1,936%
OUTUBRO	1.524.853,19	-	-	108.434,73	1.633.287,92	7,111%
NOVEMBRO	1.633.287,92	-	-	(182.747,26)	1.450.540,66	-11,19%
DEZEMBRO	1.450.540,66	-	-	(43.427,63)	1.407.113,03	-2,994%

MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO - RENDA VARIÁVEL

FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

18	SALDO INICIAL (R\$)	Aportes (R\$)	Resgates (R\$)	Rentabilidade (R\$)	SALDO FINAL (R\$)	Taxa de Retorno
JANEIRO	1.313.438,91	-	-	(128.008,24)	1.185.430,67	-9,746%
FEVEREIRO	1.185.430,67	-	-	(84.365,01)	1.101.065,66	-7,117%
MARÇO	1.101.065,66	-	-	(45.273,55)	1.055.792,11	-4,112%
ABRIL	1.055.792,11	-	-	(72.001,43)	983.790,68	-6,820%
MAIO	983.790,68	-	-	(43.650,71)	940.139,97	-4,437%
JUNHO	940.139,97	-	-	7.779,41	947.919,38	0,827%
JULHO	947.919,38	-	-	74.668,00	1.022.587,38	7,877%
AGOSTO	1.022.587,38	-	-	(40.035,44)	982.551,94	-3,915%
SETEMBRO	982.551,94	-	-	(75.851,24)	906.700,70	-7,720%
OUTUBRO	906.700,70	-	-	15.441,16	922.141,86	1,703%
NOVEMBRO	922.141,86	-	-	63.714,19	985.856,05	6,909%
DEZEMBRO	985.856,05	-	-	(47.257,17)	938.598,88	-4,794%

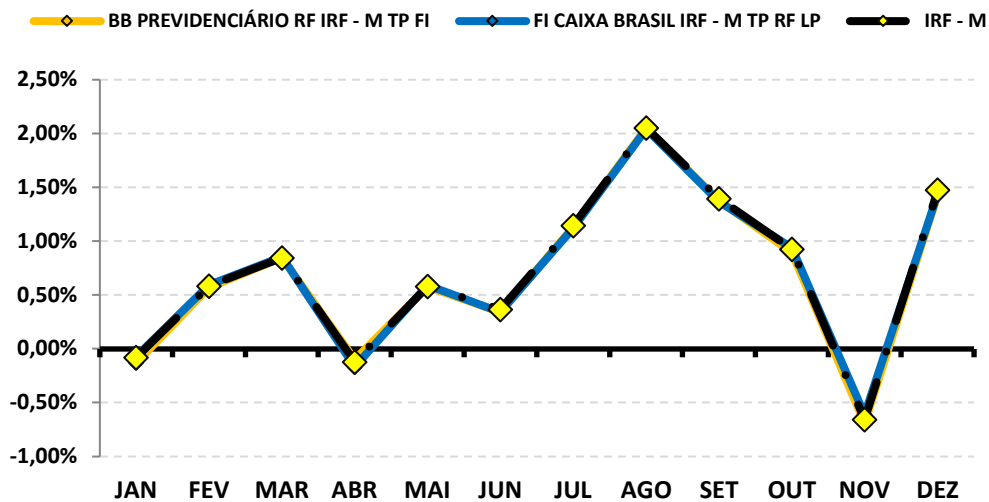
4 - DESEMPENHO (RENTABILIDADE) DOS INVESTIMENTOS

Apresentamos abaixo, o desempenho dos fundos de investimento da Carteira de Investimentos, separando as aplicações por Segmento de Renda Fixa, Renda Variável, Investimentos Estruturados, Fundos Imobiliários e Investimento no Exterior, comparado aos seus índices de Benchmark.

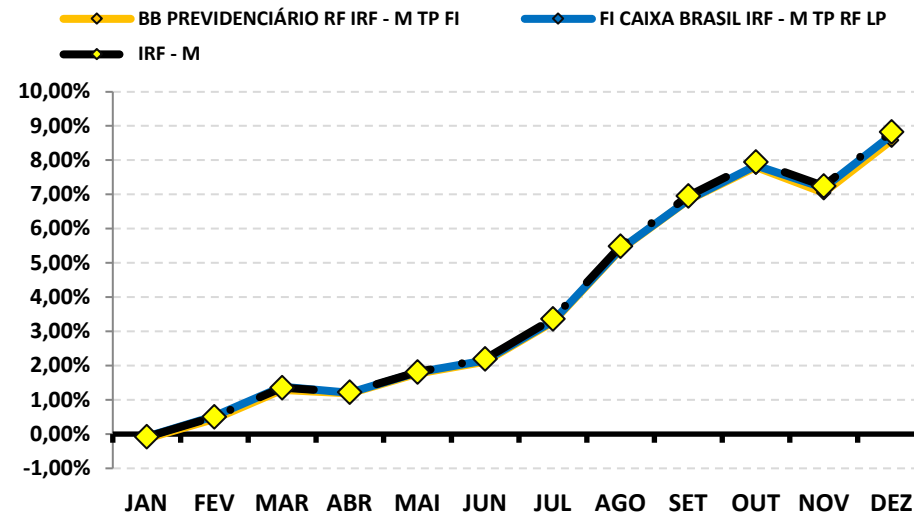
RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2022 - Fundos atrelados ao IRF - M

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ	ACUMULADO
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	-0,13%	0,57%	0,84%	-0,10%	0,58%	0,34%	1,13%	2,05%	1,38%	0,89%	-0,69%	1,43%	8,58%
14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	-0,07%	0,59%	0,85%	-0,17%	0,59%	0,34%	1,12%	2,04%	1,37%	0,94%	-0,61%	1,44%	8,73%
	IRF - M	-0,08%	0,58%	0,84%	-0,12%	0,58%	0,37%	1,15%	2,05%	1,40%	0,93%	-0,66%	1,48%	8,82%

Rentabilidade Mensal



Rentabilidade Acumulada



4 . 1 - Rentabilidade Relativa dos Investimentos sobre seu Benchmark

O **índice de Benchmark** funciona como um Índice de comparação para analisarmos o desempenho das rentabilidades de um investimento. Um fundo para ser caracterizado como um bom investimento deve acompanhar no mínimo o índice de Benchmark.

No caso dos Fundos de investimento de Renda Fixa, existem vários índices de Benchmark, como os **subíndices da ANBIMA (IMA, IRF - M e IDKA)** e o mais comum, o **índice DI**. Dependendo do tipo de análise do investidor, a poupança também serve como "**parâmetro de rentabilidade**" (Benchmark).

No caso dos Fundos de investimento em Ações ou índices de Ações, o **índice de Benchmark** mais apropriado seria o **IBOVESPA, IBR-X e etc...**

Lembrando que investimento em Renda Variável requer estratégias que visam o longo prazo e, portanto, uma análise sobre apenas um ano sobre esse tipo de investimento, torna-se um pouco tendencioso, não servindo totalmente como base para análise de retorno.

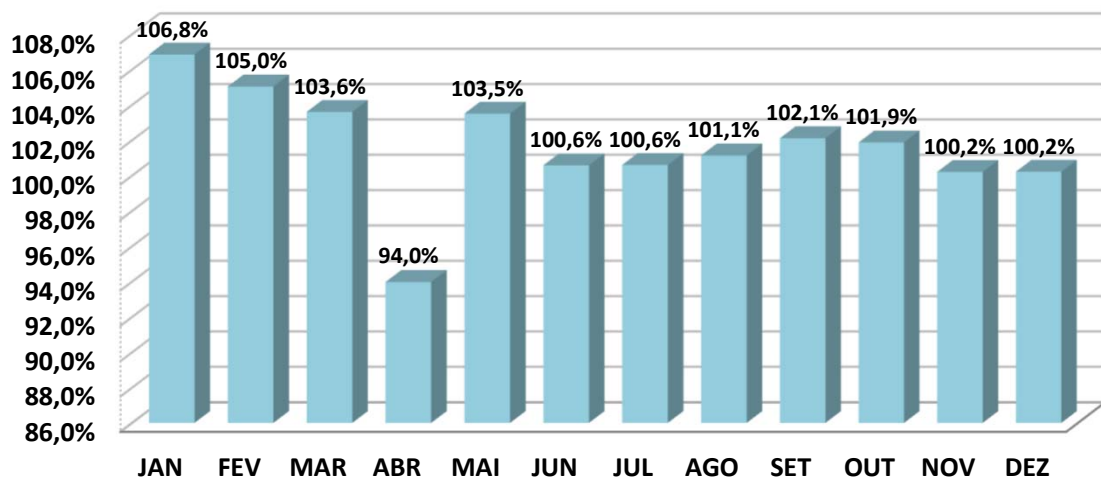
1

BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	0,78%	0,80%	0,96%	0,78%	1,07%	1,03%	1,04%	1,18%	1,09%	1,04%	1,02%	1,12%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	106,8%	105,0%	103,6%	94,0%	103,5%	100,6%	100,6%	101,1%	102,1%	101,9%	100,2%	100,2%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	AGO	1,18%	1,17%	101,14%
PIOR MÊS	ABR	0,78%	0,83%	93,98%

Oscilação do Investimento: 0,14%.

Oscilação do Benchmark: 0,14%.

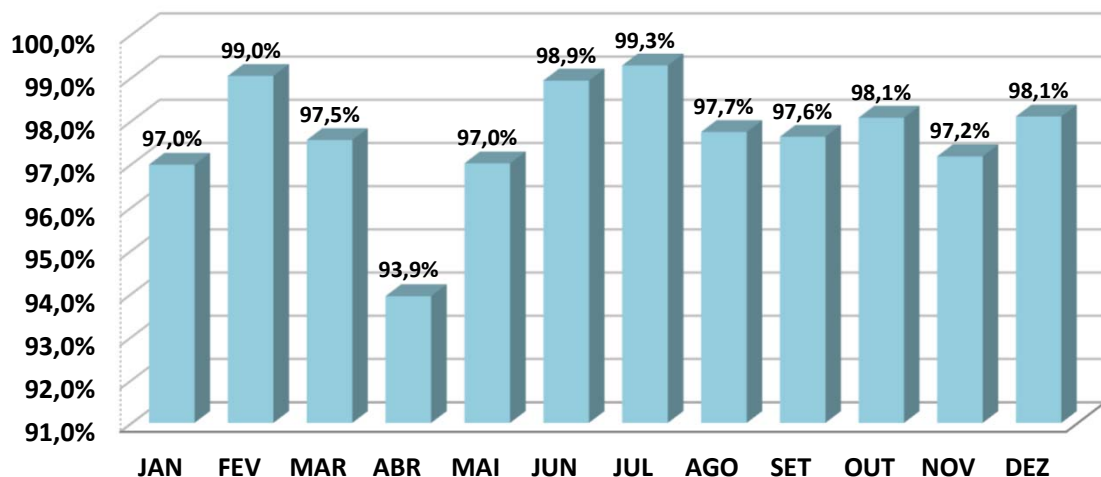
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 12,58%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 12,38%, pagando ao investidor 101,62% sobre o seu Benchmark.

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	0,61%	0,74%	0,87%	0,70%	0,92%	0,92%	1,04%	1,20%	1,09%	0,98%	0,91%	1,16%
IRF - M 1	0,63%	0,74%	0,89%	0,75%	0,95%	0,93%	1,05%	1,23%	1,11%	1,00%	0,94%	1,18%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	97,0%	99,0%	97,5%	93,9%	97,0%	98,9%	99,3%	97,7%	97,6%	98,1%	97,2%	98,1%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	AGO	1,20%	1,23%	97,74%
PIOR MÊS	JAN	0,61%	0,63%	96,98%

Oscilação do Investimento: 0,18%.

Oscilação do Benchmark: 0,18%.

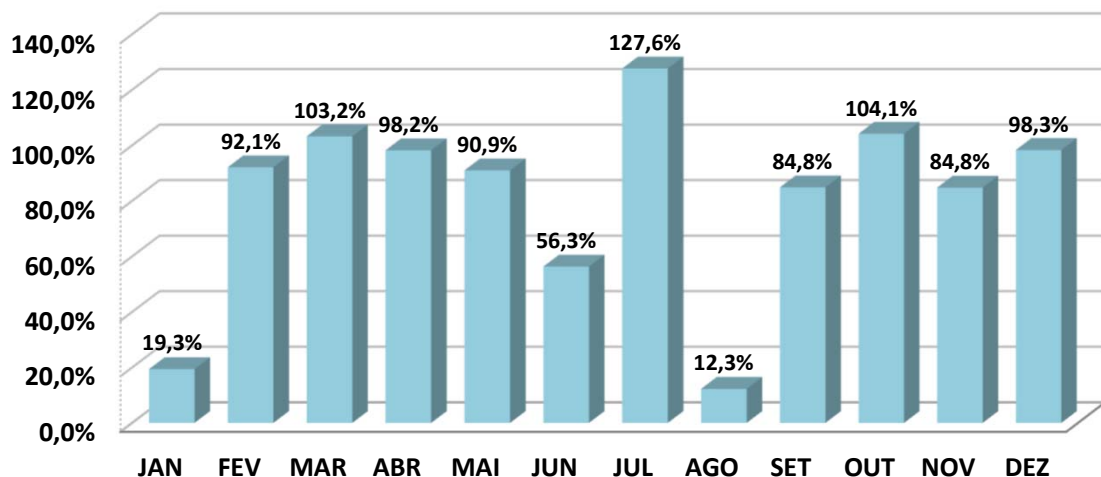
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 11,73%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 12,02%, pagando ao investidor 97,58% sobre o seu Benchmark.

BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	0,01%	1,16%	2,62%	1,48%	0,77%	0,27%	-0,22%	-0,04%	0,53%	1,85%	-0,65%	1,22%
IDKA 2	0,05%	1,26%	2,54%	1,51%	0,85%	0,47%	-0,17%	-0,36%	0,62%	1,78%	-0,77%	1,24%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	19,3%	92,1%	103,2%	98,2%	90,9%	56,3%	127,6%	12,3%	84,8%	104,1%	84,8%	98,3%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	MAR	2,62%	2,54%	103,19%
PIOR MÊS	NOV	-0,65%	-0,77%	84,76%

Oscilação do Investimento: 0,95%.

Oscilação do Benchmark: 0,97%.

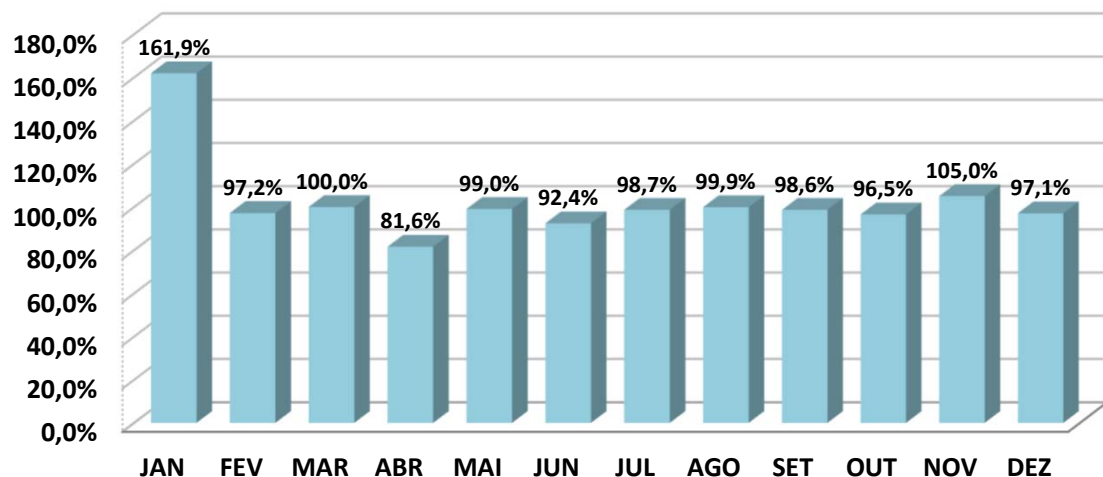
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 9,32%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 9,34%, pagando ao investidor 99,72% sobre o seu Benchmark.

BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	-0,13%	0,57%	0,84%	-0,10%	0,58%	0,34%	1,13%	2,05%	1,38%	0,89%	-0,69%	1,43%
IRF - M	-0,08%	0,58%	0,84%	-0,12%	0,58%	0,37%	1,15%	2,05%	1,40%	0,93%	-0,66%	1,48%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	161,9%	97,2%	100,0%	81,6%	99,0%	92,4%	98,7%	99,9%	98,6%	96,5%	105,0%	97,1%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	AGO	2,05%	2,05%	99,88%
PIOR MÊS	NOV	-0,69%	-0,66%	104,98%

Oscilação do Investimento: 0,77%.

Oscilação do Benchmark: 0,77%.

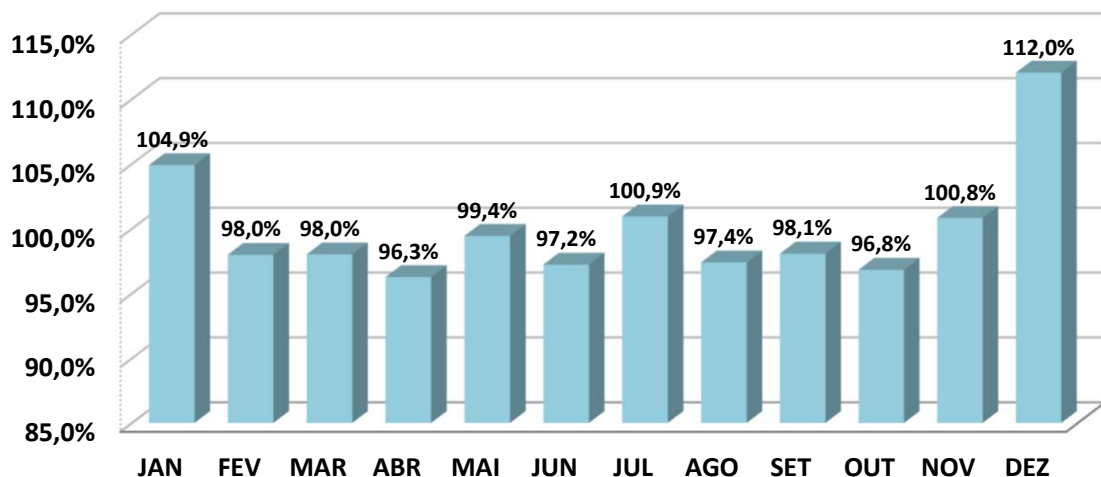
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 8,58%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 8,82%, pagando ao investidor 97,27% sobre o seu Benchmark.

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	-0,77%	0,53%	3,01%	0,80%	0,96%	-0,35%	-0,89%	1,08%	1,45%	1,19%	-0,80%	-0,22%
IMA - B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%	1,48%	1,23%	-0,79%	-0,19%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	104,9%	98,0%	98,0%	96,3%	99,4%	97,2%	100,9%	97,4%	98,1%	96,8%	100,8%	112,0%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	MAR	3,01%	3,07%	98,01%
PIOR MÊS	JUL	-0,89%	-0,88%	100,93%

Oscilação do Investimento: 1,16%.

Oscilação do Benchmark: 1,17%.

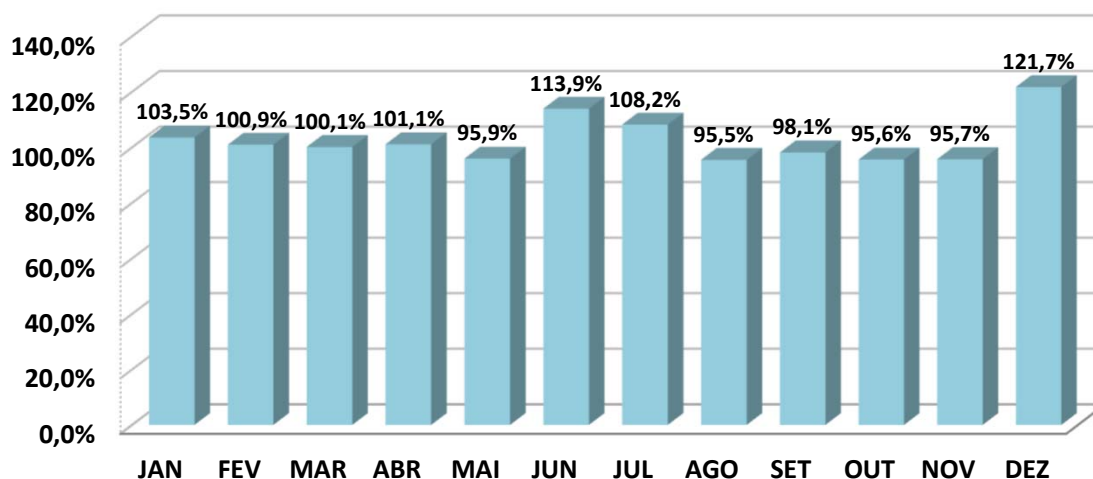
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 6,09%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 6,37%, pagando ao investidor 95,56% sobre o seu Benchmark.

BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	-0,76%	0,55%	3,07%	0,84%	0,93%	-0,41%	-0,95%	1,05%	1,45%	1,18%	-0,76%	-0,24%
IMA - B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%	1,48%	1,23%	-0,79%	-0,19%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	103,5%	100,9%	100,1%	101,1%	95,9%	113,9%	108,2%	95,5%	98,1%	95,6%	95,7%	121,7%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	MAR	3,07%	3,07%	100,10%
PIOR MÊS	JUL	-0,95%	-0,88%	108,17%

Oscilação do Investimento: 1,18%.

Oscilação do Benchmark: 1,17%.

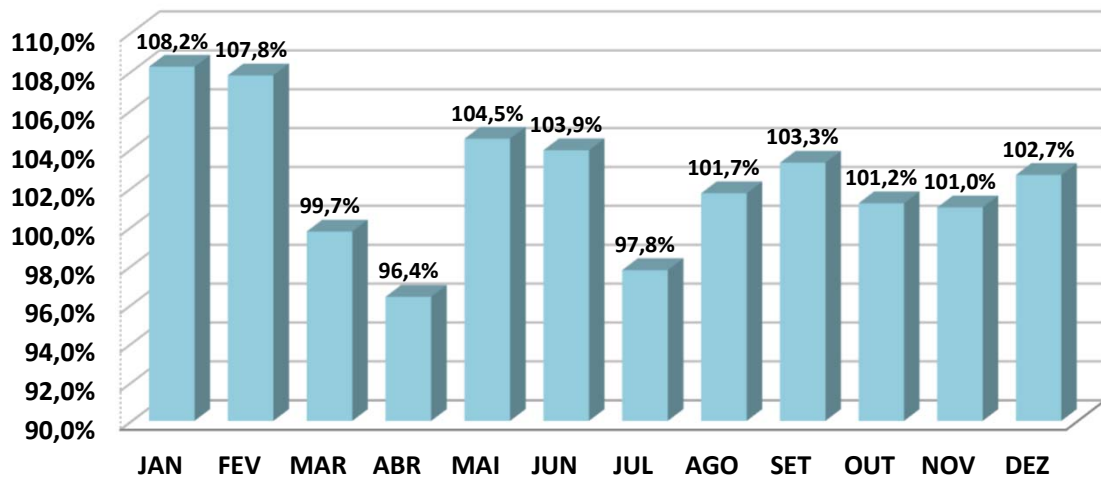
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 6,04%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 6,37%, pagando ao investidor 94,84% sobre o seu Benchmark.

FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	0,79%	0,82%	0,93%	0,80%	1,08%	1,06%	1,01%	1,19%	1,11%	1,03%	1,03%	1,15%
CDI	0,73%	0,76%	0,93%	0,83%	1,03%	1,02%	1,03%	1,17%	1,07%	1,02%	1,02%	1,12%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	108,2%	107,8%	99,7%	96,4%	104,5%	103,9%	97,8%	101,7%	103,3%	101,2%	101,0%	102,7%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	AGO	1,19%	1,17%	101,71%
PIOR MÊS	JAN	0,79%	0,73%	108,22%

Oscilação do Investimento: 0,14%.

Oscilação do Benchmark: 0,14%.

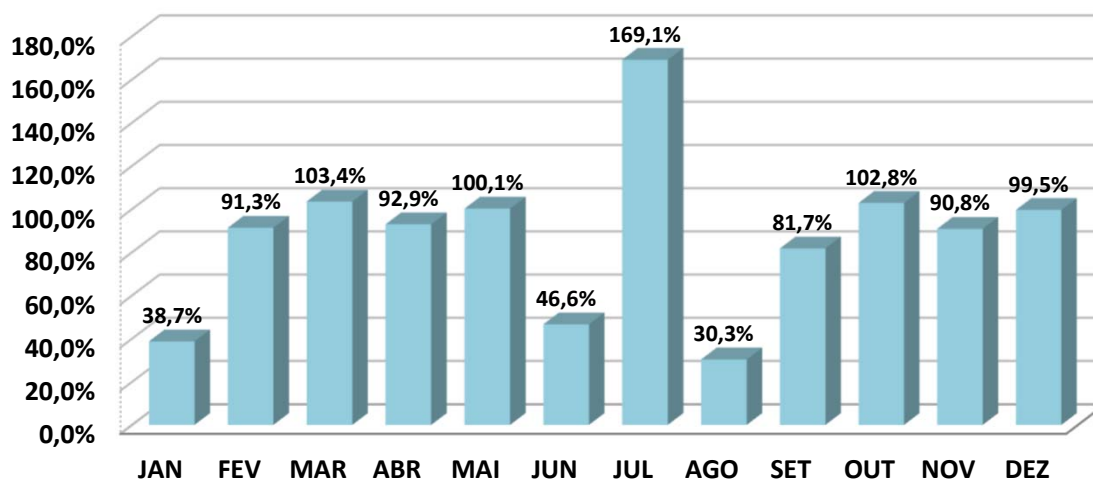
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 12,67%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 12,38%, pagando ao investidor 102,31% sobre o seu Benchmark.

FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	0,02%	1,15%	2,63%	1,40%	0,85%	0,22%	-0,29%	-0,11%	0,51%	1,83%	-0,70%	1,23%
IDKA 2	0,05%	1,26%	2,54%	1,51%	0,85%	0,47%	-0,17%	-0,36%	0,62%	1,78%	-0,77%	1,24%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	38,7%	91,3%	103,4%	92,9%	100,1%	46,6%	169,1%	30,3%	81,7%	102,8%	90,8%	99,5%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	MAR	2,63%	2,54%	103,44%
PIOR MÊS	NOV	-0,70%	-0,77%	90,80%

Oscilação do Investimento: 0,97%.

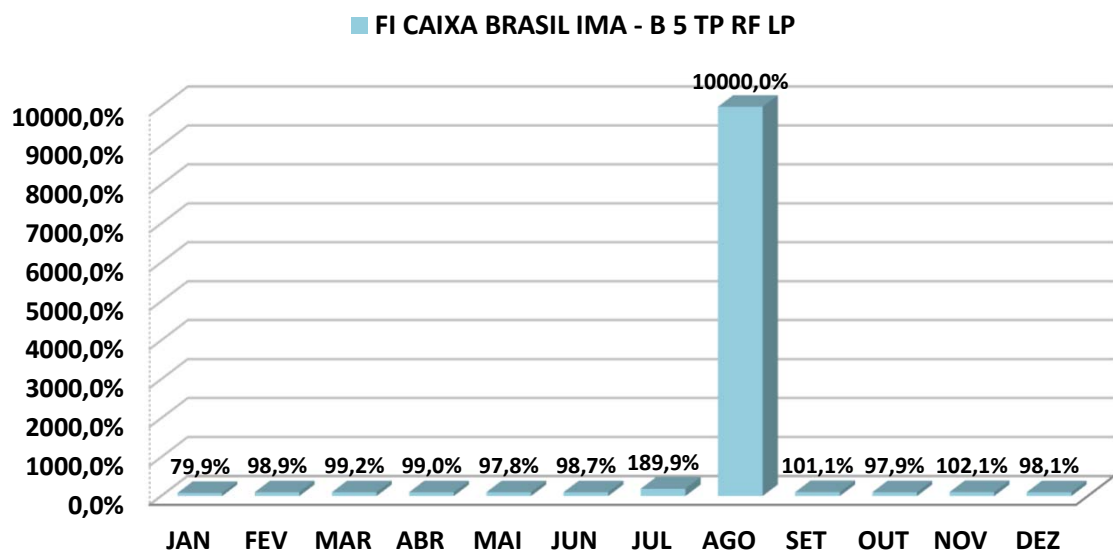
Oscilação do Benchmark: 0,97%.

Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 9,04%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 9,34%, pagando ao investidor 96,76% sobre o seu Benchmark.

FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	0,09%	1,05%	2,59%	1,54%	0,76%	0,33%	0,02%	0,05%	0,43%	1,88%	-0,34%	0,92%
IMA - B 5	0,11%	1,06%	2,61%	1,56%	0,78%	0,33%	0,01%	0,00%	0,42%	1,92%	-0,33%	0,94%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	79,9%	98,9%	99,2%	99,0%	97,8%	98,7%	189,9%	10000,0%	101,1%	97,9%	102,1%	98,1%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	MAR	2,59%	2,61%	99,18%
PIOR MÊS	NOV	-0,34%	-0,33%	102,07%

Oscilação do Investimento: 0,87%.

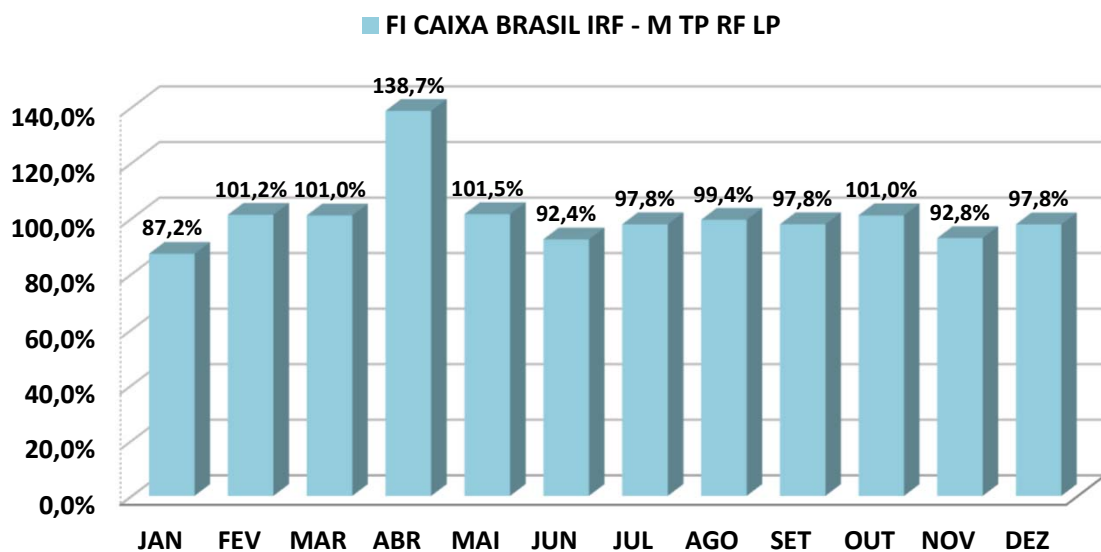
Oscilação do Benchmark: 0,88%.

Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 9,68%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 9,78%, pagando ao investidor 98,96% sobre o seu Benchmark.

FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	-0,07%	0,59%	0,85%	-0,17%	0,59%	0,34%	1,12%	2,04%	1,37%	0,94%	-0,61%	1,44%
IRF - M	-0,08%	0,58%	0,84%	-0,12%	0,58%	0,37%	1,15%	2,05%	1,40%	0,93%	-0,66%	1,48%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	87,2%	101,2%	101,0%	138,7%	101,5%	92,4%	97,8%	99,4%	97,8%	101,0%	92,8%	97,8%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	AGO	2,04%	2,05%	99,43%
PIOR MÊS	NOV	-0,61%	-0,66%	92,85%

Oscilação do Investimento: 0,76%.

Oscilação do Benchmark: 0,77%.

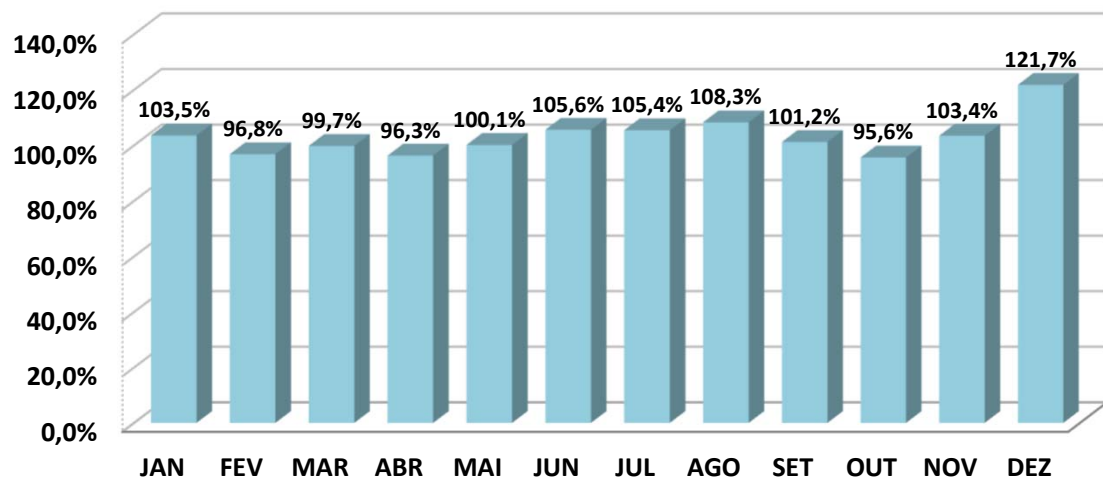
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 8,73%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 8,82%, pagando ao investidor 98,98% sobre o seu Benchmark.

FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	-0,76%	0,53%	3,06%	0,80%	0,97%	-0,38%	-0,92%	1,20%	1,50%	1,18%	-0,82%	-0,24%
IMA - B	-0,73%	0,54%	3,07%	0,83%	0,96%	-0,36%	-0,88%	1,10%	1,48%	1,23%	-0,79%	-0,19%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	103,5%	96,8%	99,7%	96,3%	100,1%	105,6%	105,4%	108,3%	101,2%	95,6%	103,4%	121,7%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	MAR	3,06%	3,07%	99,75%
PIOR MÊS	JUL	-0,92%	-0,88%	105,41%

Oscilação do Investimento: 1,19%.

Oscilação do Benchmark: 1,17%.

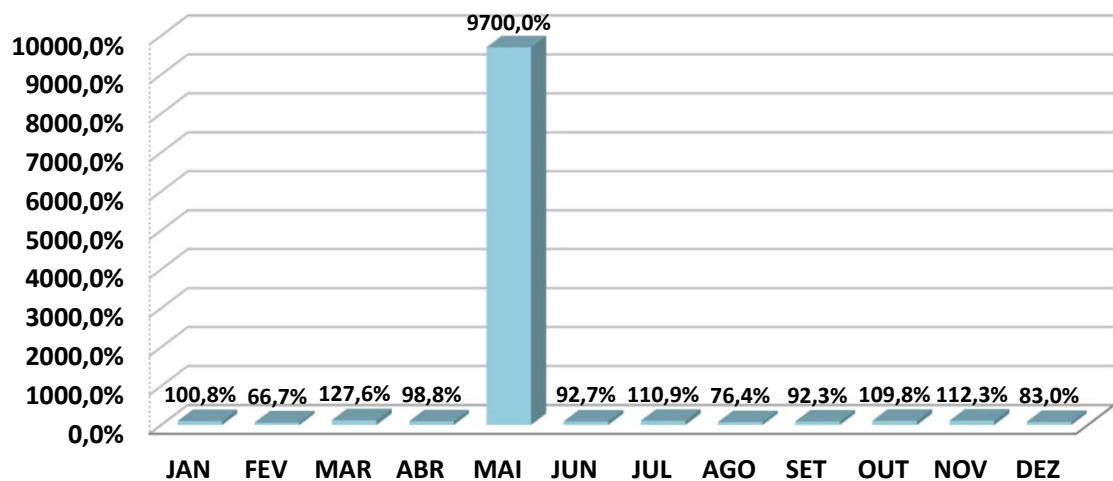
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 6,20%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 6,37%, pagando ao investidor 97,25% sobre o seu Benchmark.

FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	-5,30%	-2,09%	4,57%	-8,69%	0,97%	-7,78%	10,11%	-3,24%	-8,62%	8,77%	6,04%	-4,90%
S&P500	-5,26%	-3,14%	3,58%	-8,80%	0,01%	-8,39%	9,11%	-4,24%	-9,34%	7,99%	5,38%	-5,90%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	100,8%	66,7%	127,6%	98,8%	9700,0%	92,7%	110,9%	76,4%	92,3%	109,8%	112,3%	83,0%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	JUL	10,11%	9,11%	110,93%
PIOR MÊS	ABR	-8,69%	-8,80%	98,75%

Oscilação do Investimento: 6,78%.

Oscilação do Benchmark: 6,63%.

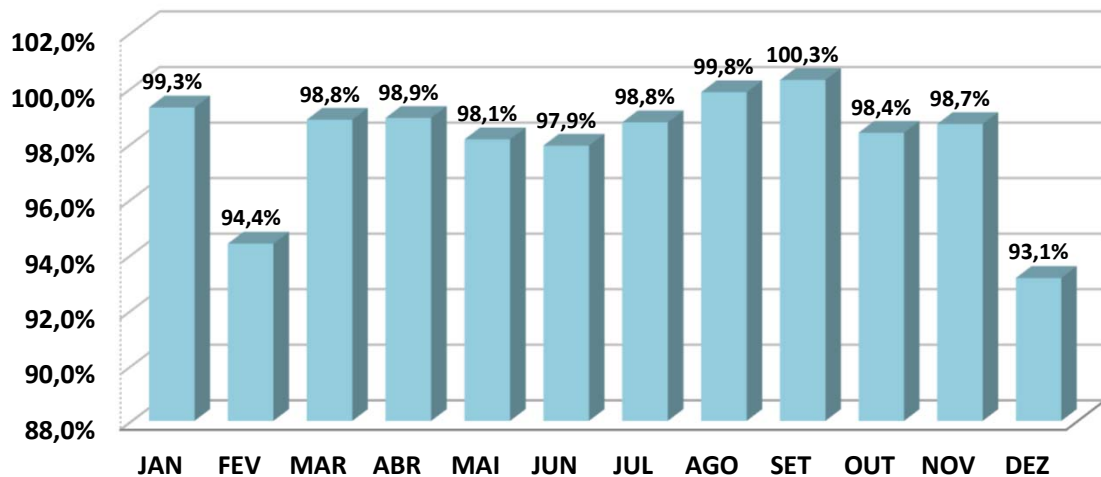
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu -11,97%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, -19,44%, pagando ao investidor 61,60% sobre o seu Benchmark.

CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	6,93%	0,84%	5,99%	-9,99%	3,16%	-11,26%	4,63%	6,15%	0,47%	5,36%	-3,02%	-2,28%
IBOV	6,98%	0,89%	6,06%	-10,10%	3,22%	-11,50%	4,69%	6,16%	0,47%	5,45%	-3,06%	-2,45%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	99,3%	94,4%	98,8%	98,9%	98,1%	97,9%	98,8%	99,8%	100,3%	98,4%	98,7%	93,1%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	JAN	6,93%	6,98%	99,28%
PIOR MÊS	JUN	-11,26%	-11,50%	97,91%

Oscilação do Investimento: 6,18%.

Oscilação do Benchmark: 6,27%.

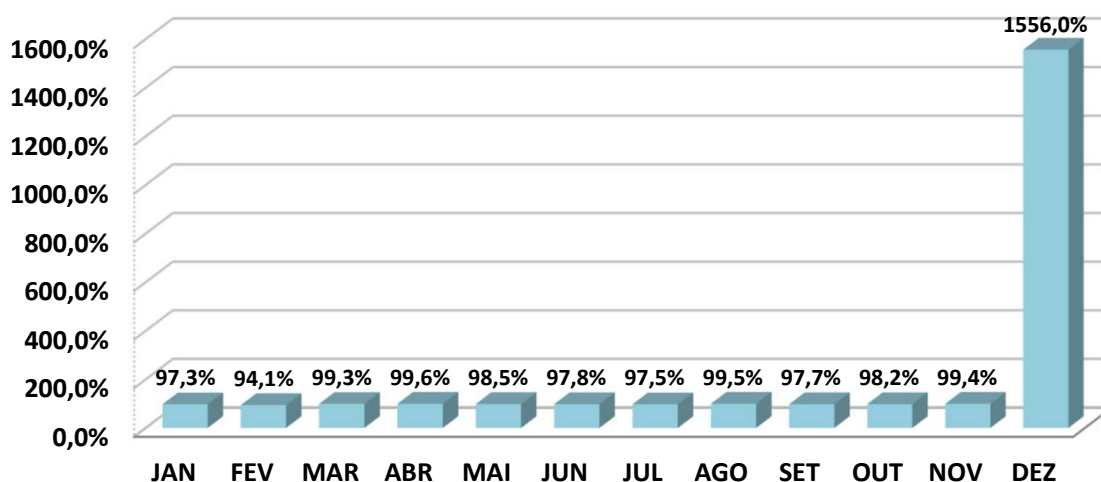
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 4,93%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 4,68%, pagando ao investidor 105,33% sobre o seu Benchmark.

CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	16,66%	-1,23%	7,48%	-11,91%	6,16%	-12,55%	3,51%	9,94%	3,02%	6,76%	-12,41%	0,16%
IFNC	17,12%	-1,31%	7,53%	-11,96%	6,25%	-12,83%	3,60%	9,99%	3,09%	6,89%	-12,48%	0,01%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	97,3%	94,1%	99,3%	99,6%	98,5%	97,8%	97,5%	99,5%	97,7%	98,2%	99,4%	1556,0%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	JAN	16,66%	17,12%	97,31%
PIOR MÊS	JUN	-12,55%	-12,83%	97,82%

Oscilação do Investimento: 9,40%.

Oscilação do Benchmark: 9,55%.

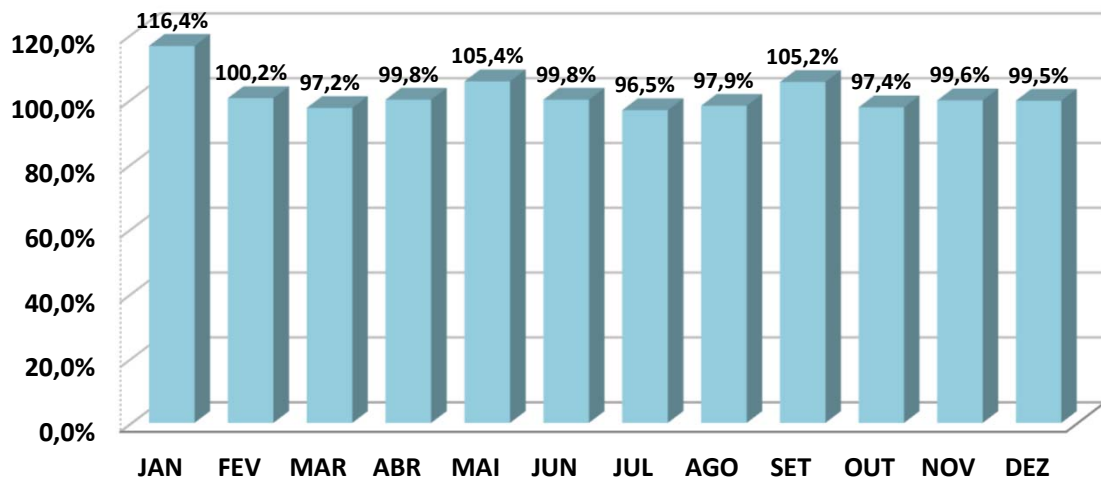
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu 11,20%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, 11,39%, pagando ao investidor 98,35% sobre o seu Benchmark.

FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	3,98%	-5,20%	8,57%	-8,34%	-1,92%	-16,29%	4,98%	10,67%	-1,94%	7,11%	-11,18%	-2,99%
SMLL	3,42%	-5,19%	8,81%	-8,36%	-1,82%	-16,33%	5,16%	10,90%	-1,84%	7,30%	-11,23%	-3,01%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	116,4%	100,2%	97,2%	99,8%	105,4%	99,8%	96,5%	97,9%	105,2%	97,4%	99,6%	99,5%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	AGO	10,67%	10,90%	97,89%
PIOR MÊS	JUN	-16,29%	-16,33%	99,76%

Oscilação do Investimento: 8,36%.

Oscilação do Benchmark: 8,43%.

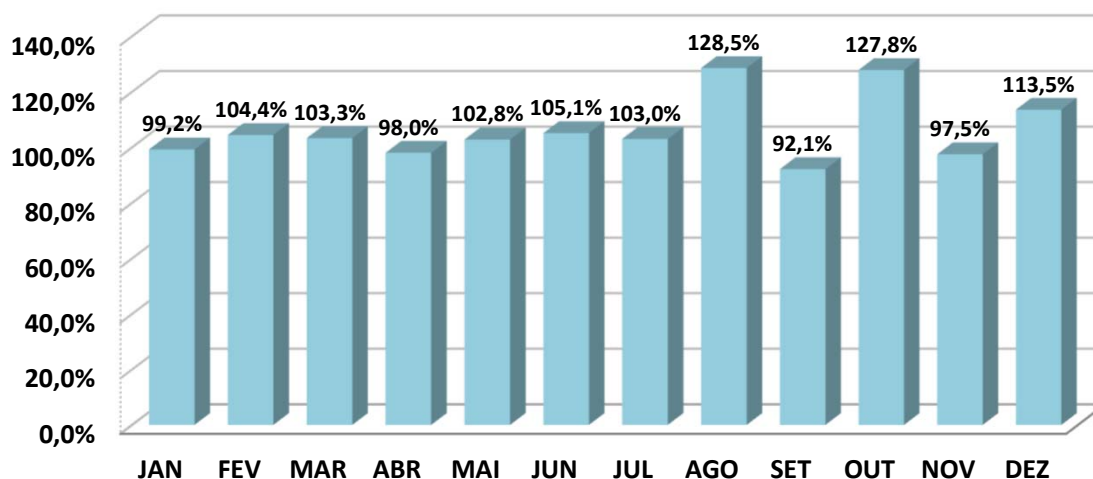
Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu -15,32%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, -15,06%, pagando ao investidor 101,73% sobre o seu Benchmark.

FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I

	JAN	FEV	MAR	ABR	MAI	JUN	JUL	AGO	SET	OUT	NOV	DEZ
RETORNO FUNDO	-9,75%	-7,12%	-4,11%	-6,82%	-4,44%	0,83%	7,88%	-3,92%	-7,72%	1,70%	6,91%	-4,79%
BDR	-9,83%	-6,82%	-3,98%	-6,96%	-4,32%	0,79%	7,65%	-3,05%	-8,38%	1,33%	7,09%	-4,22%
RETORNO SOBRE O BENCHMARK	99,2%	104,4%	103,3%	98,0%	102,8%	105,1%	103,0%	128,5%	92,1%	127,8%	97,5%	113,5%

Rentabilidade Mensal sobre o Benchmark

■ FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I



ANÁLISE SOBRE AS EXTREMIDADES DE INVESTIMENTO

DESEMPENHO	MÊS	RETORNO FUNDO	BENCHMARK	Retorno S/ Benchmark
MELHOR MÊS	JUL	7,88%	7,65%	103,01%
PIOR MÊS	JAN	-9,75%	-9,83%	99,19%

Oscilação do Investimento: 5,71%.

Oscilação do Benchmark: 5,69%.

Durante o período de aplicação, o Fundo rendeu -28,54%, enquanto seu Benchmark rendeu no mesmo período, -28,06%, pagando ao investidor 101,73% sobre o seu Benchmark.

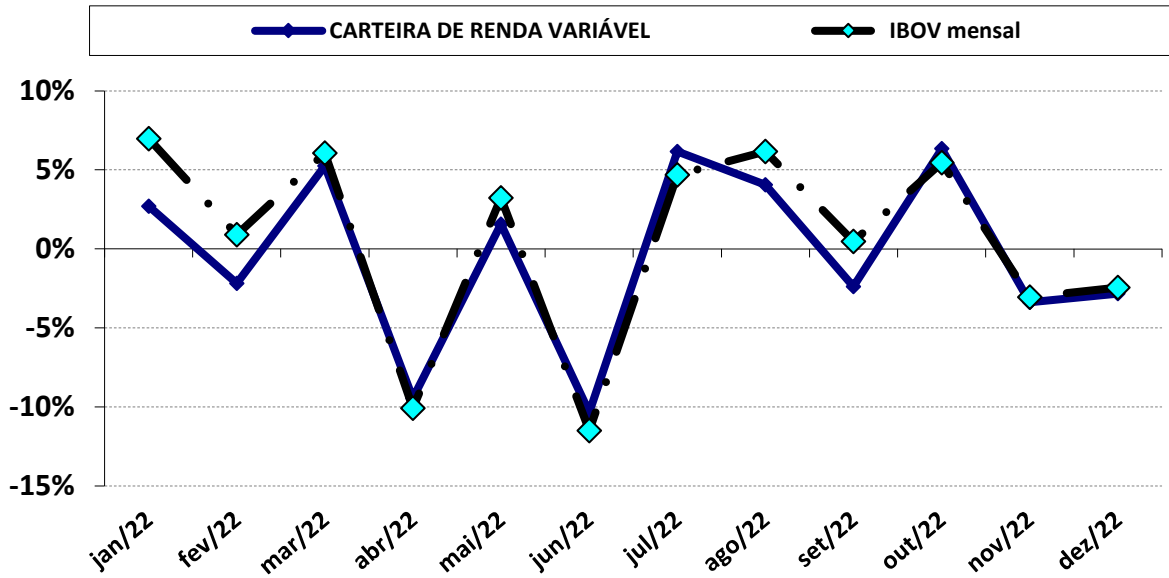
4 . 2 - Análise dos Investimentos de LONGO PRAZO

4 . 2 . 1 - Renda Variável

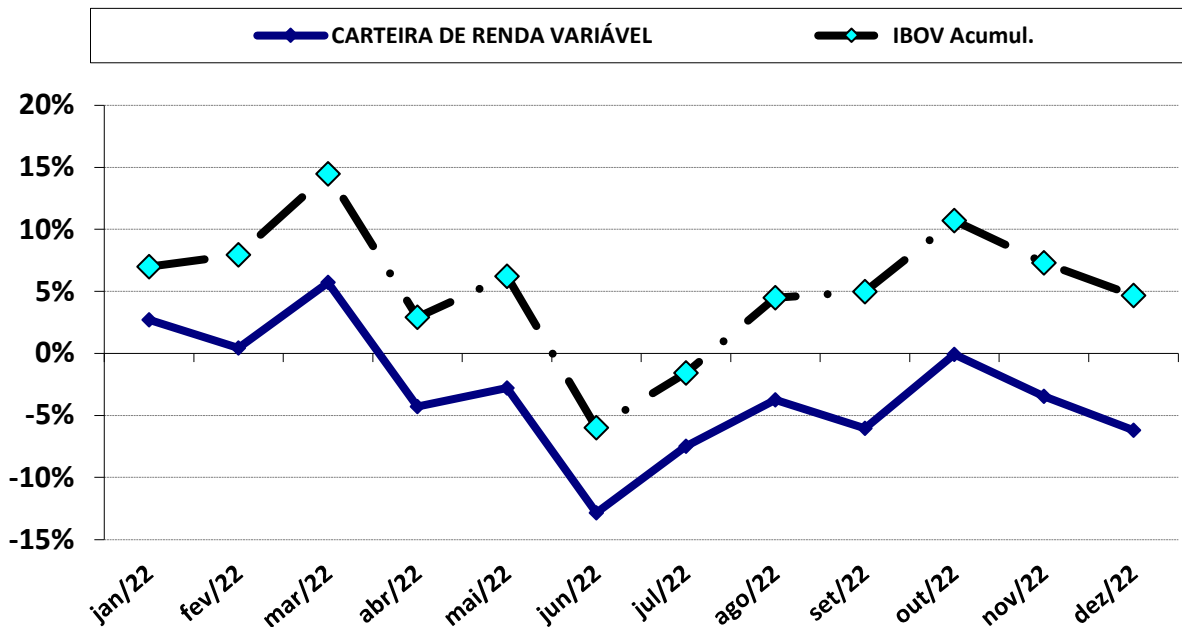
Conforme definido na Política Anual de Investimentos de 2022, os investimentos em Renda Variável ficarão aplicados, no mínimo, nos próximos 5 anos, caso apresente rentabilidade negativa. Os investimentos em Renda Variável possuem certo tipo de risco e por isso, são investimentos que visam o longo prazo.

CARTEIRA DE RENDA VARIÁVEL

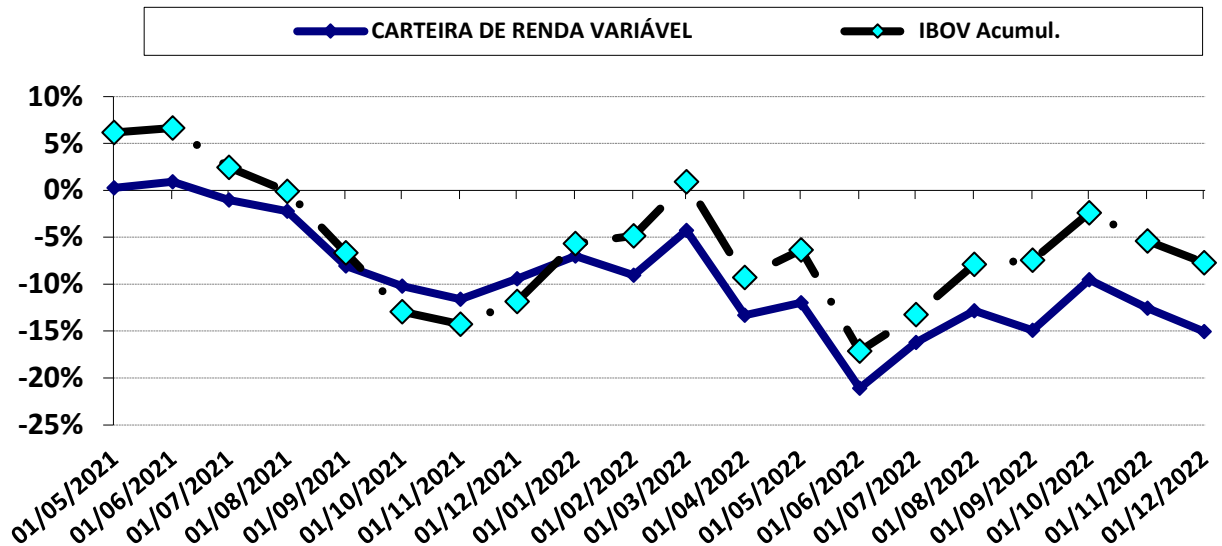
Carteira de Renda Variável - Mensal 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado (2021 a 2022)



DESEMPENHO DESDE O INÍCIO DA APLICAÇÃO

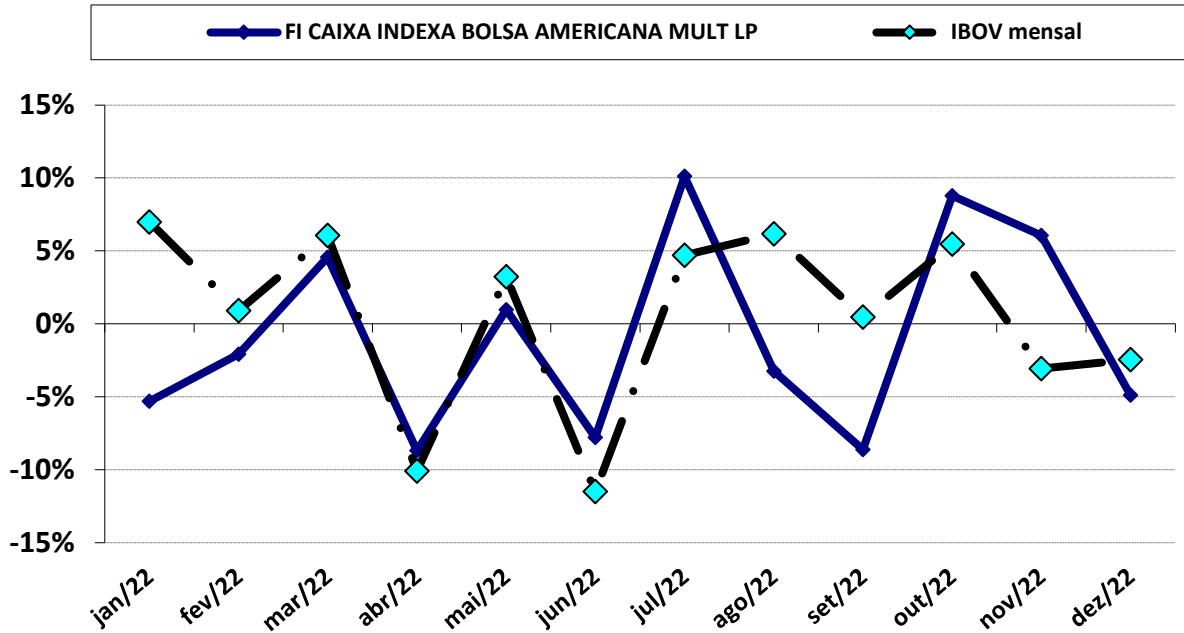
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	maio-2021	11.000.000,00
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(1.655.036,90)
SALDO FINAL	dezembro-2022	9.344.963,09

DESEMPENHO NO ANO DE 2022

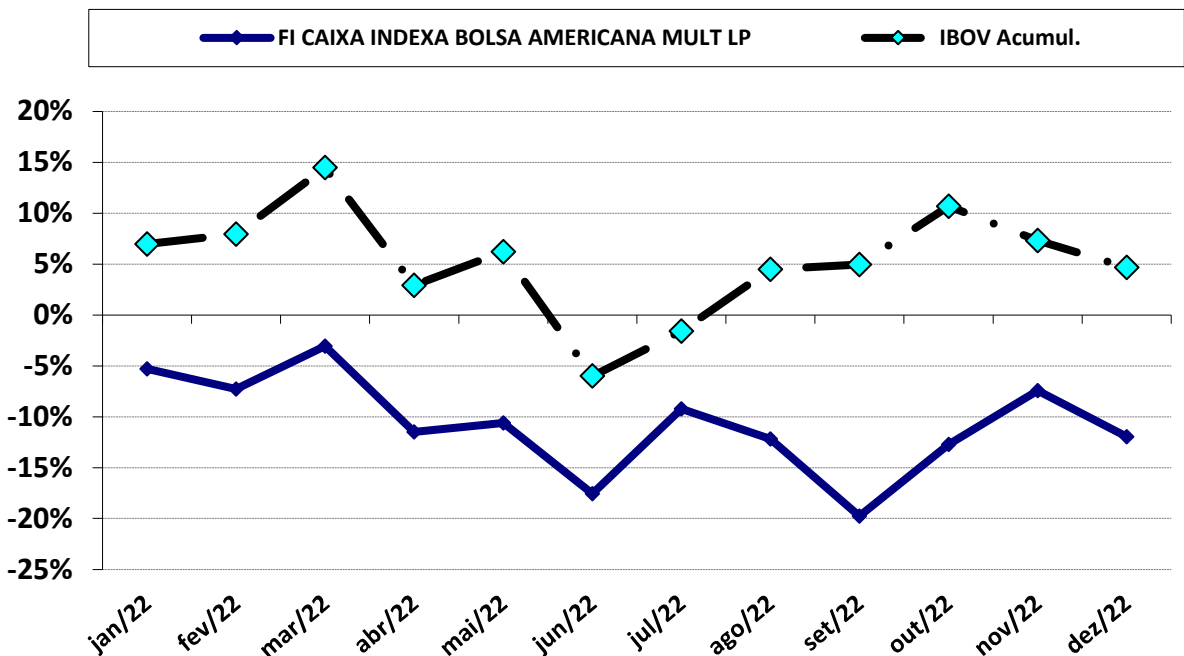
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	janeiro-2022	9.961.467,09
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(616.504,00)
SALDO FINAL	dezembro-2022	9.344.963,09

PERÍODO	JUROS ACUMULADO COM O INVESTIMENTO	
ANO	(616.504,00)	-6,19%
DESDE O INÍCIO	(1.655.036,90)	-15,05%

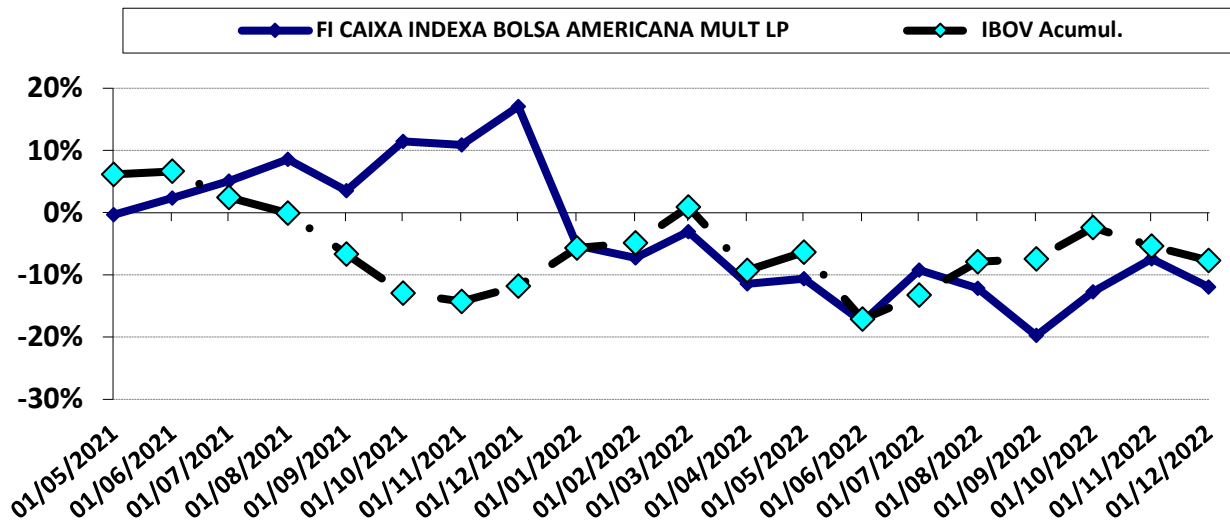
Carteira de Renda Variável - Mensal 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado (2021 a 2022)



DESEMPENHO DESDE O INÍCIO DA APLICAÇÃO

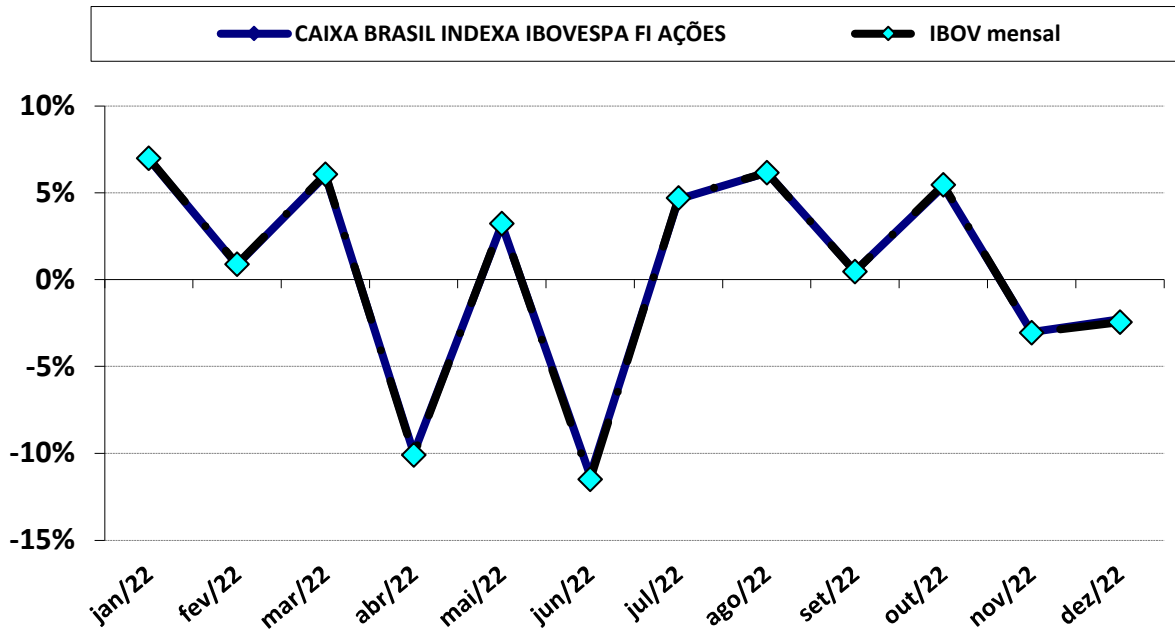
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	maio-2021	2.200.000,00
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	66.888,71
SALDO FINAL	dezembro-2022	2.266.888,71

DESEMPENHO NO ANO DE 2022

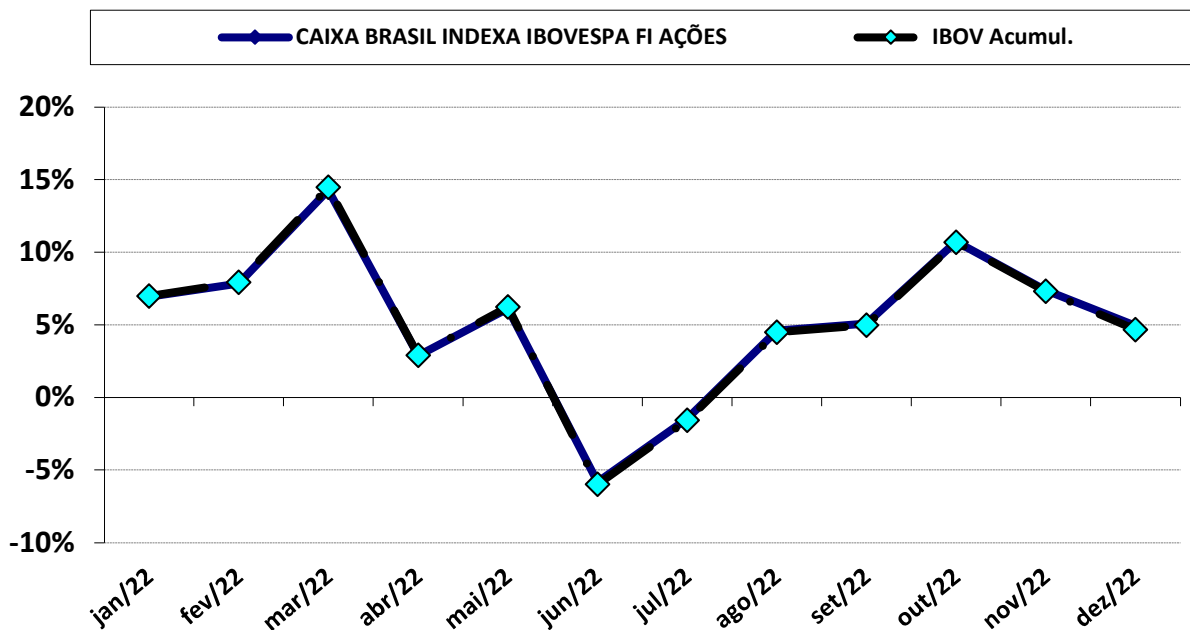
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	janeiro-2022	2.575.240,11
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(308.351,40)
SALDO FINAL	dezembro-2022	2.266.888,71

PERÍODO	JUROS ACUMULADO COM O INVESTIMENTO	
ANO	(308.351,40)	-11,97%
DESDE O INÍCIO	66.888,71	3,04%

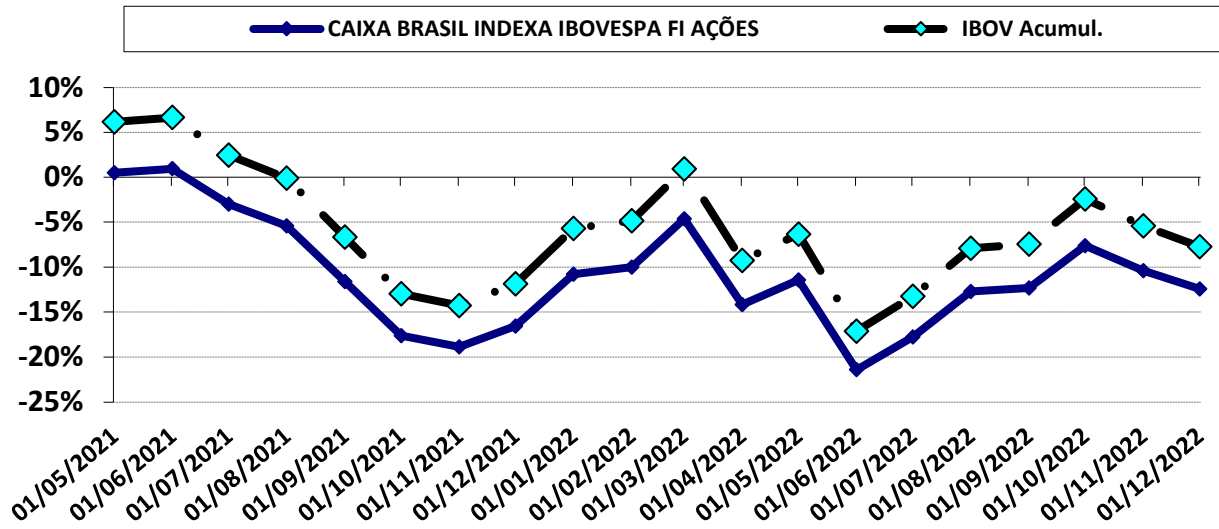
Carteira de Renda Variável - Mensal 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado (2021 a 2022)



DESEMPENHO DESDE O INÍCIO DA APLICAÇÃO

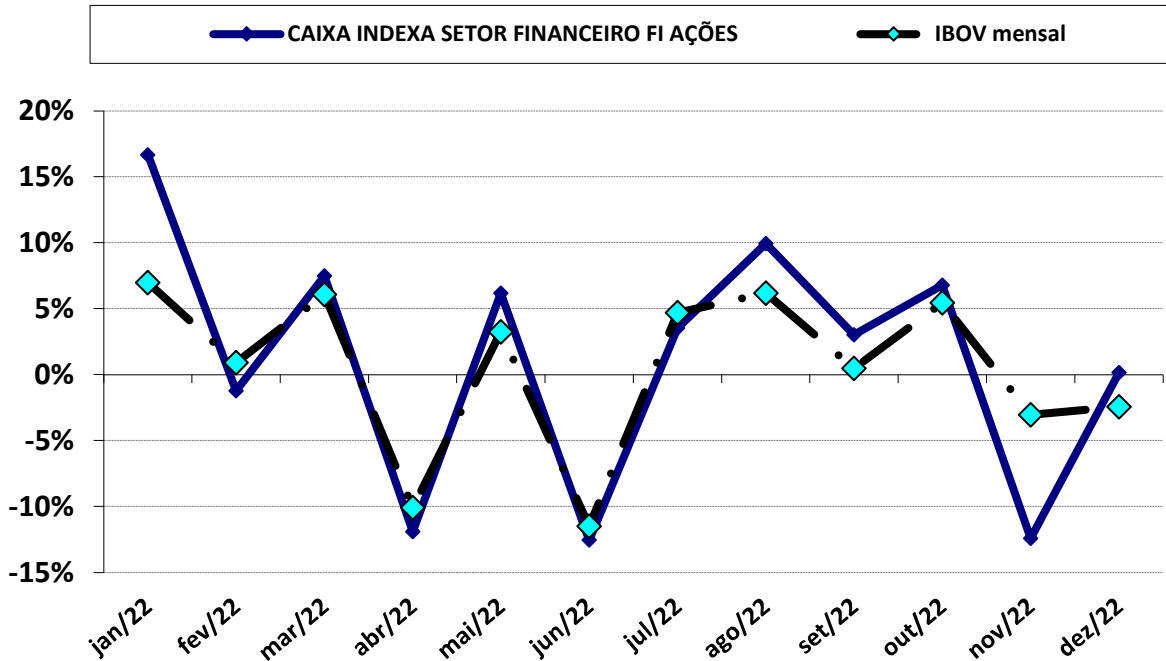
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	maio-2021	3.300.000,00
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(410.581,46)
SALDO FINAL	dezembro-2022	2.889.418,54

DESEMPENHO NO ANO DE 2022

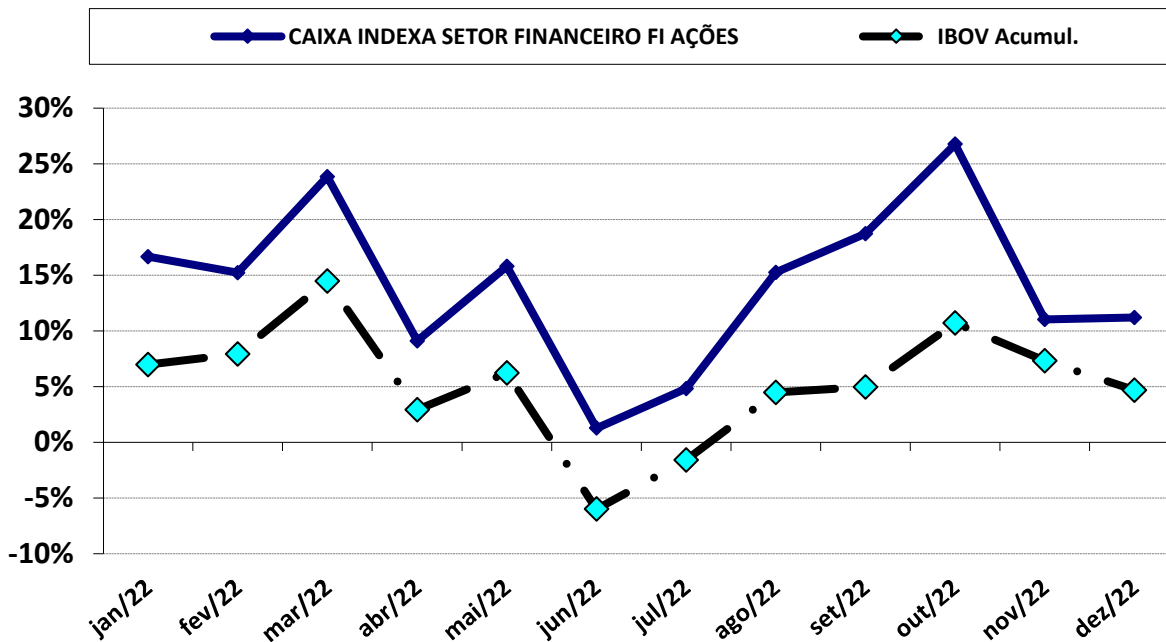
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	janeiro-2022	2.753.620,47
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	135.798,07
SALDO FINAL	dezembro-2022	2.889.418,54

PERÍODO	JUROS ACUMULADO COM O INVESTIMENTO	
ANO	135.798,07	4,93%
DESDE O INÍCIO	(410.581,46)	-12,44%

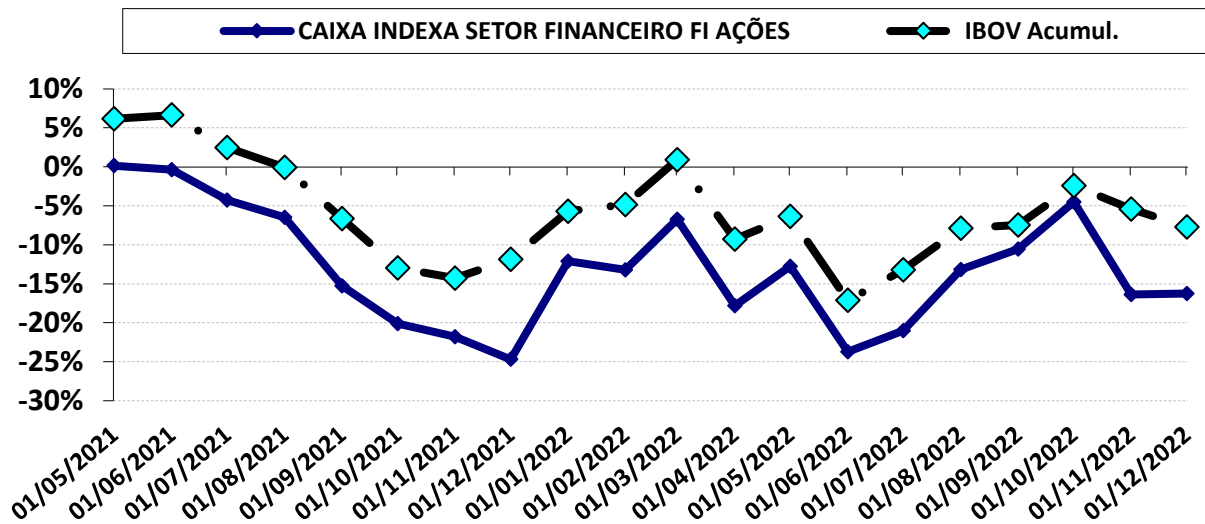
Carteira de Renda Variável - Mensal 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado (2021 a 2022)



DESEMPENHO DESDE O INÍCIO DA APLICAÇÃO

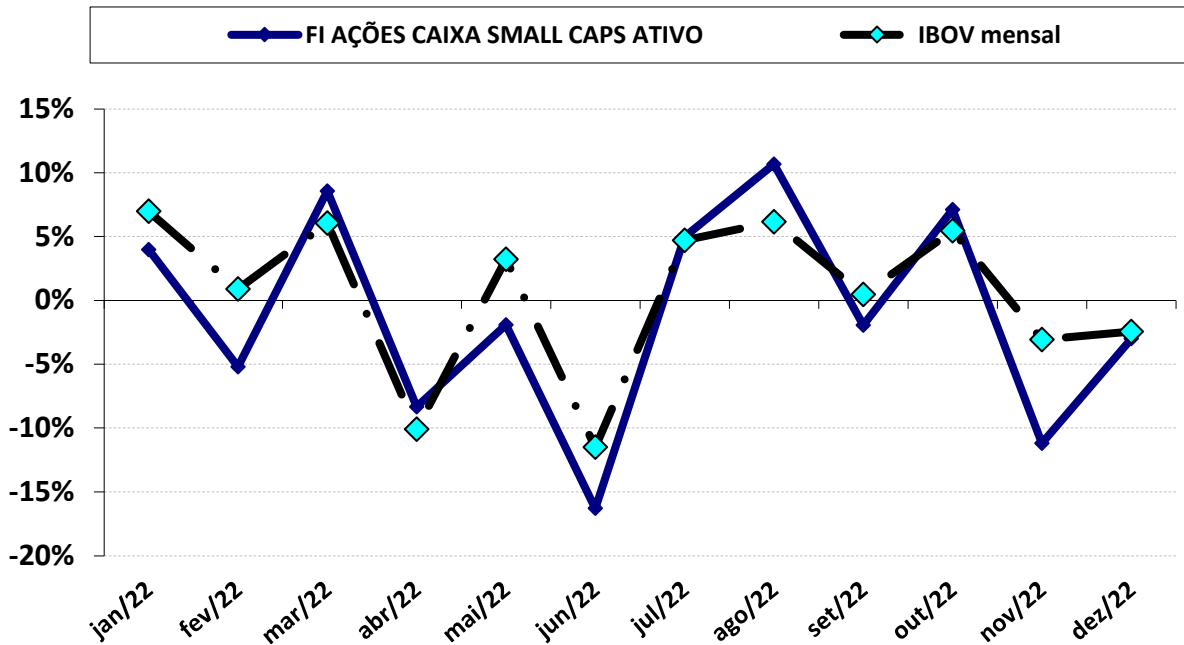
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	maio-2021	2.200.000,00
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(357.056,07)
SALDO FINAL	dezembro-2022	1.842.943,93

DESEMPENHO NO ANO DE 2022

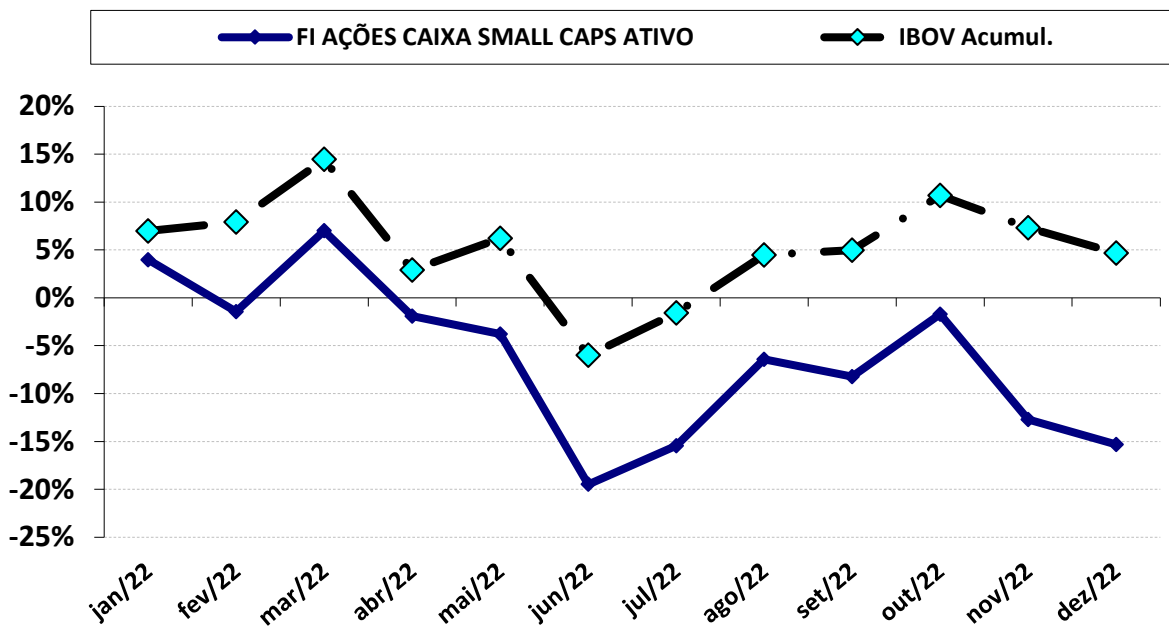
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	janeiro-2022	1.657.320,83
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	185.623,10
SALDO FINAL	dezembro-2022	1.842.943,93

PERÍODO	JUROS ACUMULADO COM O INVESTIMENTO	
ANO	185.623,10	11,20%
DESDE O INÍCIO	(357.056,07)	-16,23%

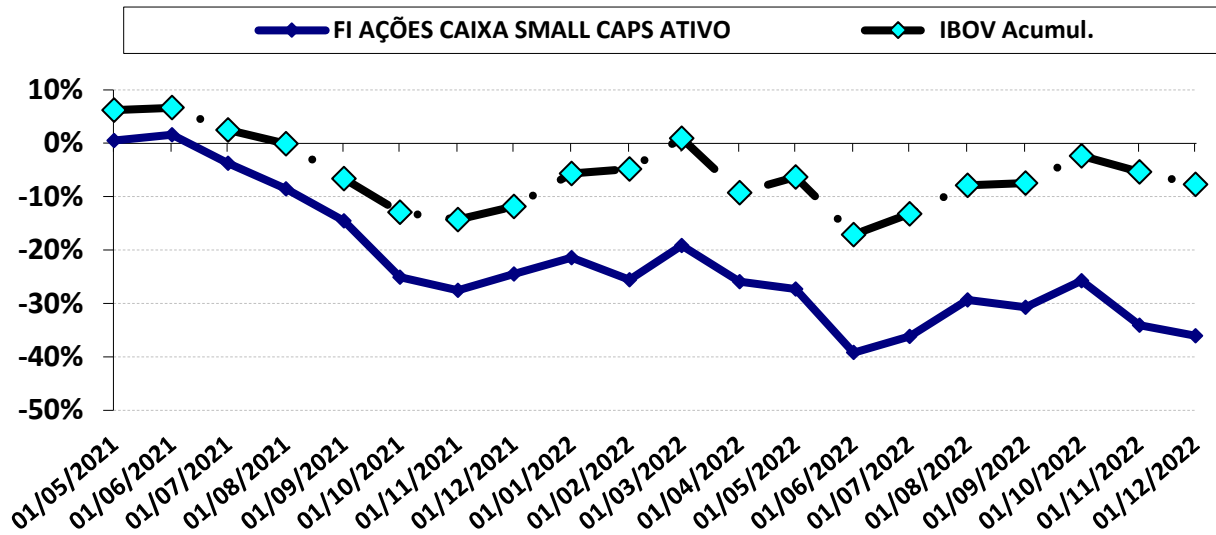
Carteira de Renda Variável - Mensal 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado (2021 a 2022)



DESEMPENHO DESDE O INÍCIO DA APLICAÇÃO

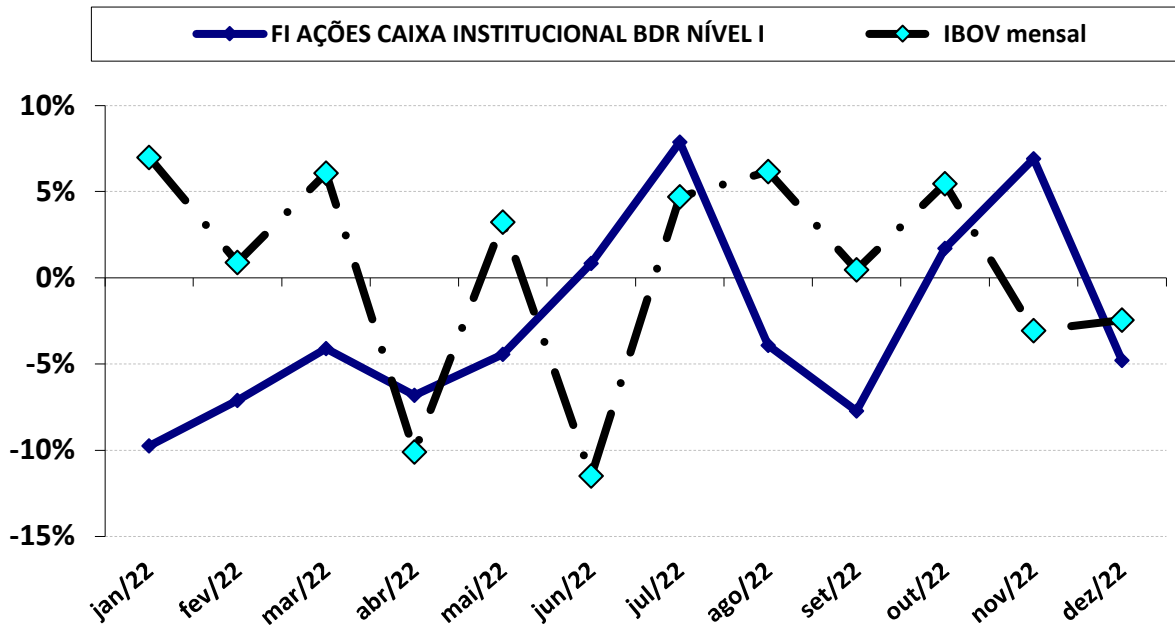
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	maio-2021	2.200.000,00
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(792.886,97)
SALDO FINAL	dezembro-2022	1.407.113,03

DESEMPENHO NO ANO DE 2022

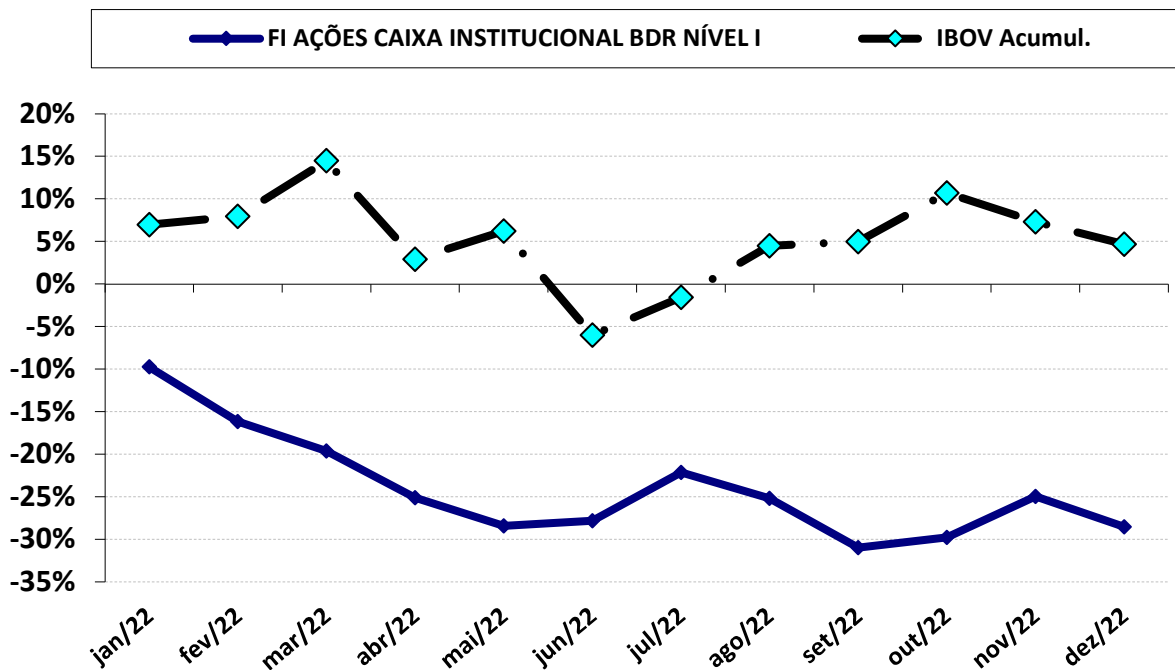
MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	janeiro-2022	1.661.846,78
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(254.733,75)
SALDO FINAL	dezembro-2022	1.407.113,03

PERÍODO	JUROS ACUMULADO COM O INVESTIMENTO	
ANO	(254.733,75)	-15,33%
DESDE O INÍCIO	(792.886,97)	-36,04%

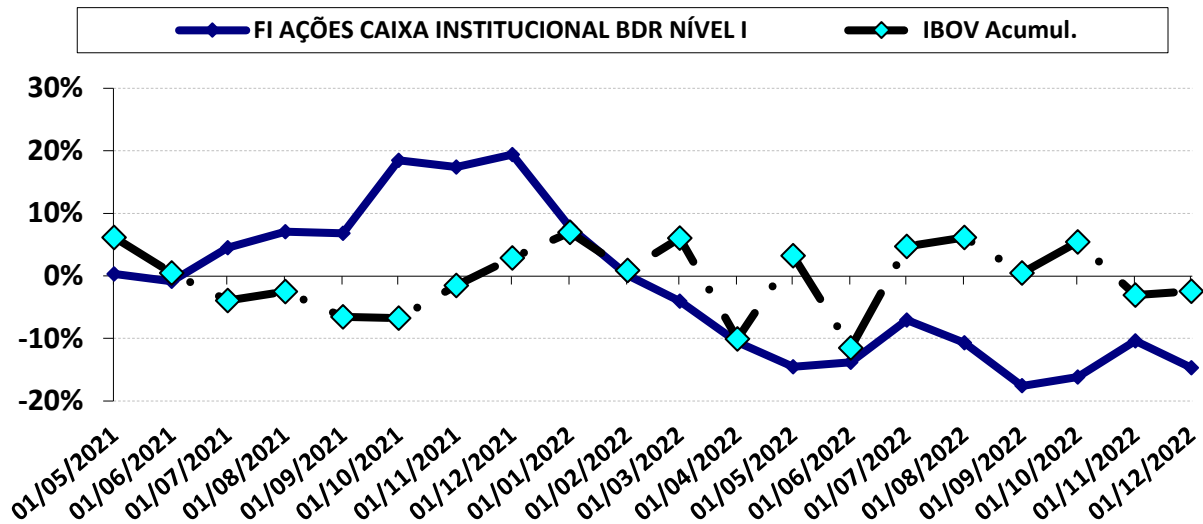
Carteira de Renda Variável - Mensal 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado 2022



Carteira de Renda Variável - Acumulado (2021 a 2022)



DESEMPENHO DESDE O INÍCIO DA APLICAÇÃO

MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	maio-2021	1.100.000,00
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(161.401,12)
SALDO FINAL	dezembro-2022	938.598,88

DESEMPENHO NO ANO DE 2022

MOVIMENTAÇÃO	PERÍODO	VALOR (R\$)
SALDO INICIAL	janeiro-2022	1.313.438,91
Aportes	-	-
Resgates	-	-
Rendimento	-	(374.840,03)
SALDO FINAL	dezembro-2022	938.598,88

PERÍODO	JUROS ACUMULADO COM O INVESTIMENTO	
ANO	(374.840,03)	-28,54%
DESDE O INÍCIO	(161.401,12)	-14,67%

5-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2022 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVISO

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
RENDA FIXA								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	84,8%	100,0%	80,4%	230.581.319,70	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	0,0%	40,0%	15,0%	43.013.719,13	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (0%)	0,0%	10,9%	40,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de "Crédito Privado"	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	TOTAL - RENDA FIXA					95,4%	273.595.038,83	
RENDA VARIÁVEL								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	2,7%	30,0%	2,1%	6.139.475,50	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	30,0%	0,0%	-	-
14	TOTAL - RENDA VARIÁVEL					2,1%	6.139.475,50	
INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	1,1%	10,0%	0,8%	2.266.888,71	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
18	TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS					0,8%	2.266.888,71	
FUNDOS IMOBILIÁRIOS								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
20	TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS					0,0%	-	
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	0,6%	10,0%	0,3%	938.598,88	-
24	TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR					0,3%	938.598,88	
EMPRÉSTIMO CONSIGNADO								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO					0,0%	-	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				1,3%	3.761.569,77	
29	PATRIMÔNIO TOTAL					100,0%	286.701.571,69	

5.1-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

RENDA FIXA

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	23.933.339,72	8,35%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	80,43%	SIM
2	14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	23.194.461,89	8,09%	SIM			
3	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	47.635.244,98	16,61%	SIM			
4	14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	21.065.675,03	7,35%	SIM			
5	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	27.034.043,40	9,43%	SIM			
6	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	23.781.413,15	8,29%	SIM			
7	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	51.848.950,51	18,08%	SIM			
8	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	12.088.191,02	4,22%	SIM			
9	03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	9.905.070,05	3,45%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	15,0%	SIM
10	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	896.509,94	0,31%	SIM			
11	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.212.139,14	11,24%	SIM			
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA			273.595.038,83	95,43%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: DEZEMBRO

RENDA VARIÁVEL

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
12	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.407.113,03	0,49%	SIM			
13	40.209.029/0001-00	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	1.842.943,93	0,64%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	2,1%	SIM
14	13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.889.418,54	1,01%	SIM			
15	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2.266.888,71	0,79%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	0,8%	SIM
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL			8.406.364,21	2,93%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: DEZEMBRO

INVESTIMENTO NO EXTERIOR

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
16	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	938.598,88	0,33%	SIM	Fundos de Ações BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	0,3%	0,0%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR			938.598,88	0,33%				

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: DEZEMBRO

5.1.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
17	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	3.575.283,84	1,25%
18	Caixa Econômica Federal	186.285,93	0,06%
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		3.761.569,77	1,31%

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS		
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	273.595.038,83	95,43%
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	8.406.364,21	2,93%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	938.598,88	0,33%
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	3.761.569,77	1,31%
PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL (1 + 2 + 3 + 4)	286.701.571,69	100,00%

* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: DEZEMBRO

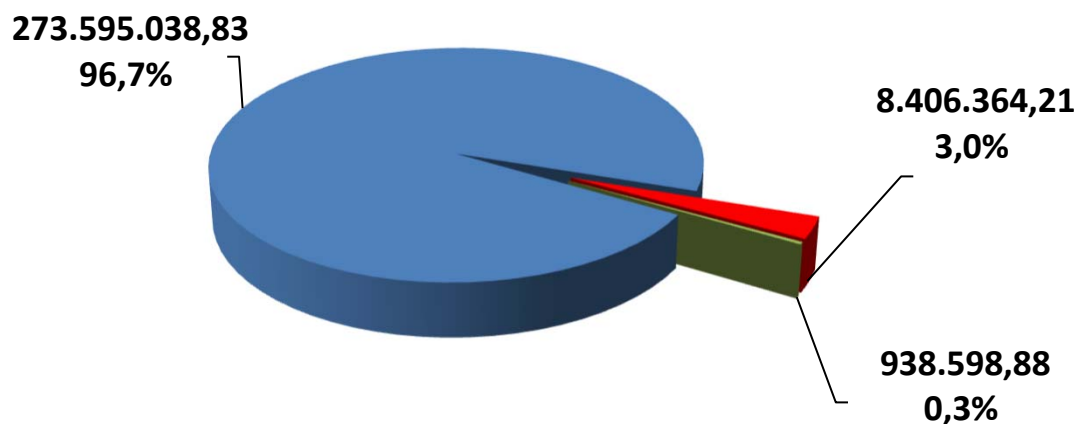
DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA

DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO (RENDA FIXA e RENDA VARIÁVEL)

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RENDA FIXA	273.595.038,83	96,7%
RENDA VARIÁVEL	8.406.364,21	3,0%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	938.598,88	0,3%
TOTAL	282.940.001,92	100,0%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / SEGMENTO

■ RENDA FIXA ■ RENDA VARIÁVEL ■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR

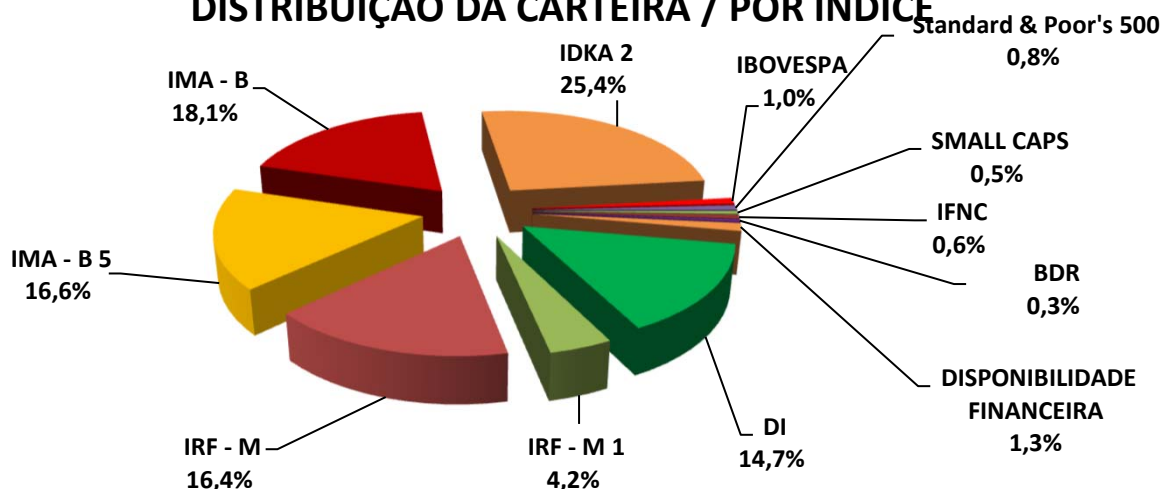


**OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).*

DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE (Benchmark)

ÍNDICE (BENCHMARK)	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
DI	42.117.209,19	14,7%
IRF - M 1	12.088.191,02	4,2%
IRF - M	46.975.875,04	16,4%
IRF - M 1+	-	0,0%
IMA - B 5	47.635.244,98	16,6%
IMA - B	51.863.893,06	18,1%
IMA - B 5+	-	0,0%
IMA - GERAL	-	0,0%
IMA - GERAL EX - C	-	0,0%
IDKA 2	72.914.625,54	25,4%
IDKA 3	-	0,0%
IPCA	-	0,0%
IPCA + 6,00% a.a.	-	0,0%
IPCA + 7,50% a.a.	-	0,0%
Multimercado	-	0,0%
IBOVESPA	2.889.418,54	1,0%
IBR - X	-	0,0%
Imobiliário - IMOB	-	0,0%
Dividendos	-	0,0%
Imobiliário - IFIX	-	0,0%
ISE	-	0,0%
ICON	-	0,0%
Standard & Poor's 500	2.266.888,71	0,8%
IGC	-	0,0%
Petrobrás	-	0,0%
SMALL CAPS	1.407.113,03	0,5%
IFNC	1.842.943,93	0,6%
Standard & Poor's 500 (BRASIL)	-	0,0%
BDR	938.598,88	0,3%
MSCI ACWI	-	0,0%
MSCI WORLD	-	0,0%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.761.569,77	1,3%
TOTAL	286.701.571,69	100%

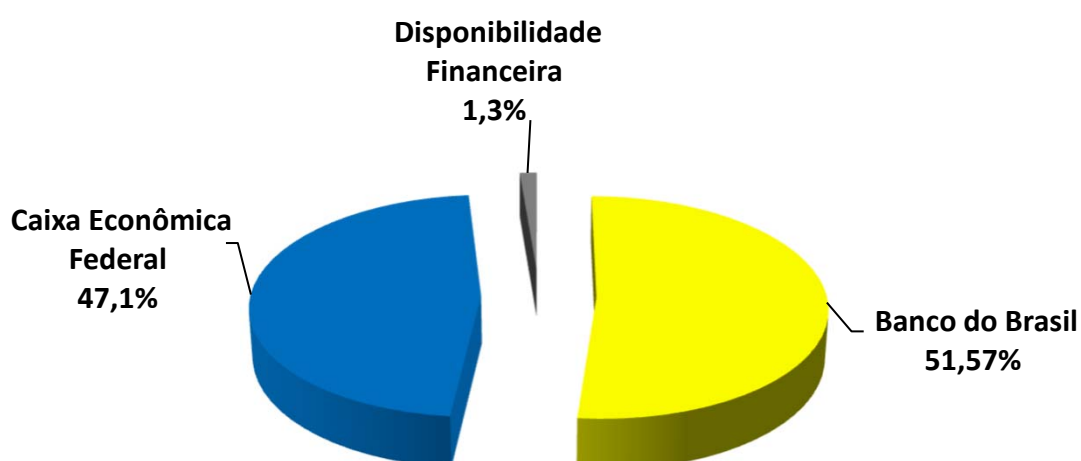
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR ÍNDICE



DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
Banco do Brasil	147.861.247,16	51,6%
Caixa Econômica Federal	135.078.754,76	47,1%
Disponibilidade Financeira	3.761.569,77	1,3%
TOTAL	286.701.571,69	100%

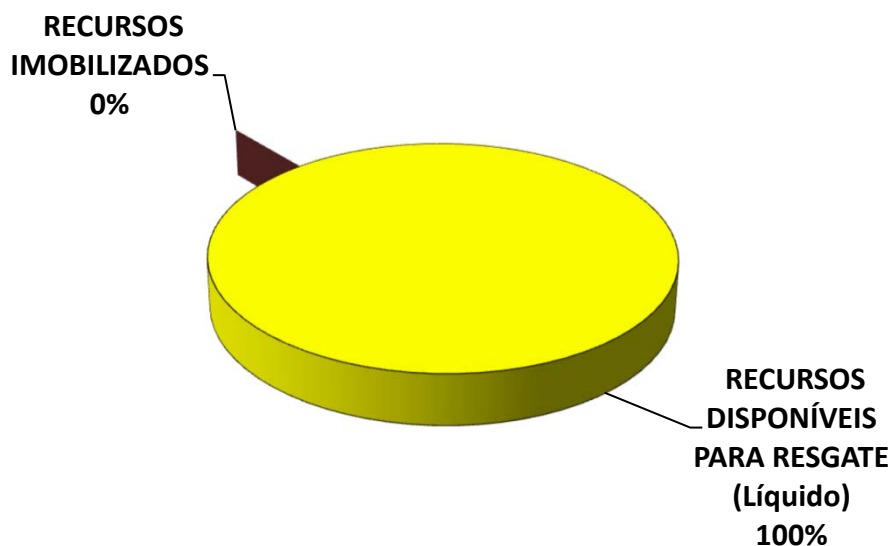
DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS E IMOBILIZADO

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RECURSOS DISPONÍVEIS PARA RESGATE (Líquido)	286.701.571,69	100,0%
RECURSOS IMOBILIZADOS	-	0,0%
TOTAL	286.701.571,69	100,0%

DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA /POR LIQUIDEZ

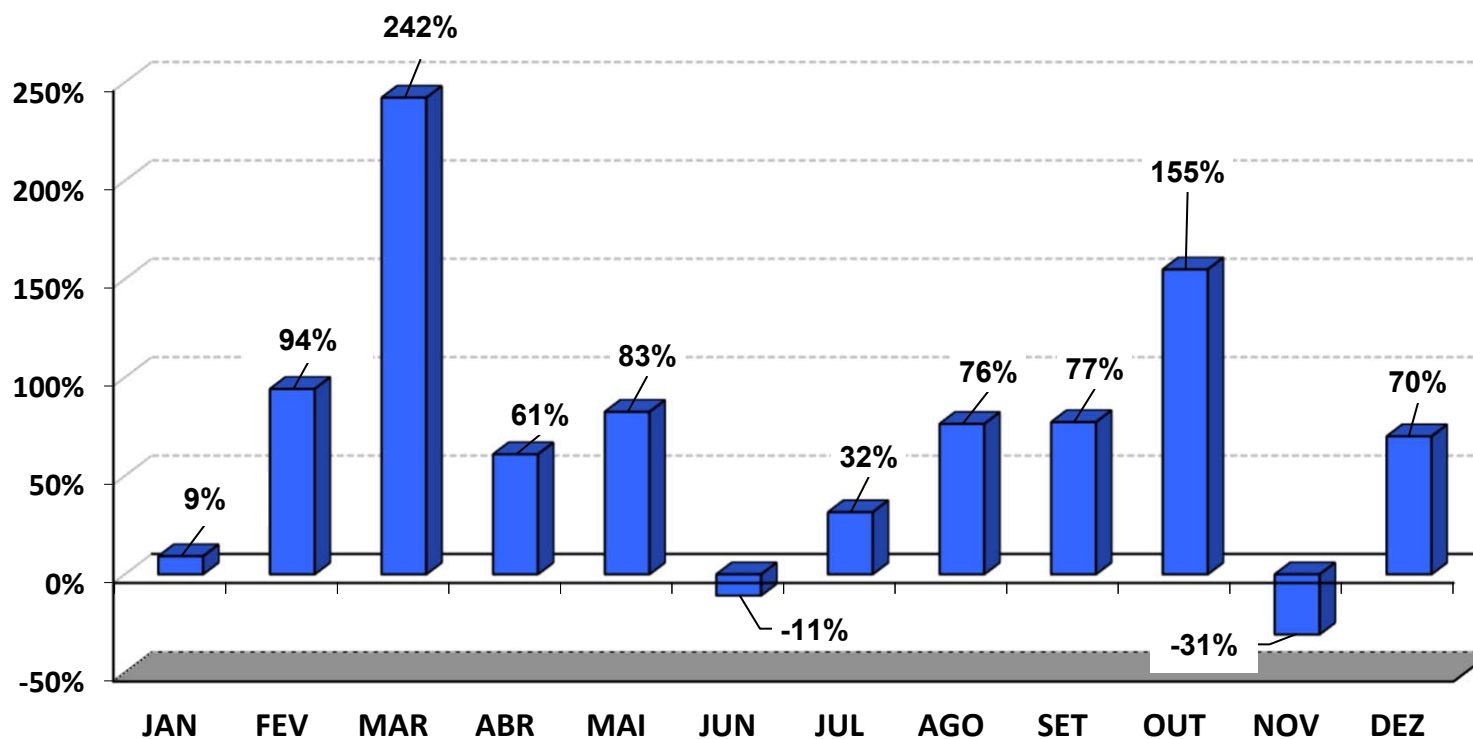


6 – DESEMPENHO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO

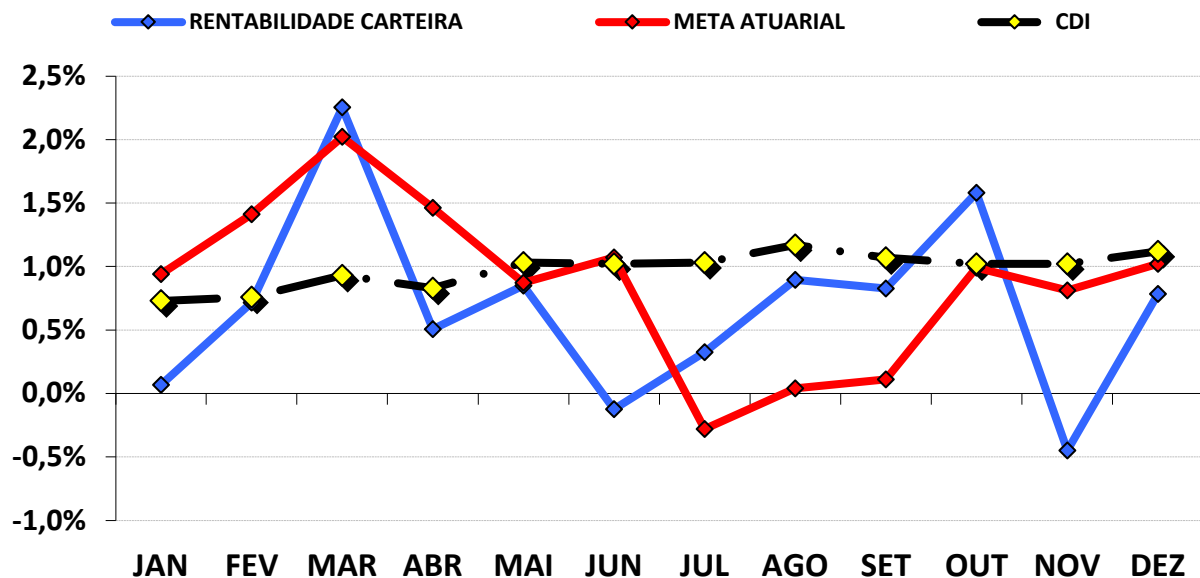
6 . 1 - Desempenho MENSAL da carteira de Investimento

MESES	VALORIZAÇÃO / DESVALORIZAÇÃO (TÍTULOS PÚBLICOS)	RENDIMENTO COM IMÓVEIS	RENTABILIDADE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO	GANHO (RETORNO) DA CARTEIRA	PATRIMÔNIO FINAL	GANHO (RETORNO) DA CARTEIRA	META ATUARIAL	CDI
JANEIRO	-	-	162.063,06	162.063,06	242.743.422,50	0,07%	0,94%	0,73%
FEVEREIRO	-	-	1.732.647,53	1.732.647,53	245.567.694,94	0,72%	1,41%	0,76%
MARÇO	-	-	5.493.135,89	5.493.135,89	252.411.669,29	2,25%	2,02%	0,93%
ABRIL	-	-	1.274.678,09	1.274.678,09	255.216.905,32	0,51%	1,46%	0,83%
MAIO	-	-	2.163.747,73	2.163.747,73	258.306.595,33	0,85%	0,87%	1,03%
JUNHO	-	-	(317.783,82)	(317.783,82)	259.679.043,16	-0,12%	1,07%	1,02%
JULHO	-	-	842.195,73	842.195,73	262.296.545,05	0,33%	-0,28%	1,03%
AGOSTO	-	-	2.337.710,04	2.337.710,04	266.213.144,15	0,89%	0,04%	1,17%
SETEMBRO	-	-	2.186.364,87	2.186.364,87	270.083.827,06	0,83%	0,11%	1,07%
OUTUBRO	-	-	4.264.928,37	4.264.928,37	276.201.521,94	1,58%	0,99%	1,02%
NOVEMBRO	-	-	(1.228.919,97)	(1.228.919,97)	276.758.971,45	-0,45%	0,81%	1,02%
DEZEMBRO	-	-	2.159.317,80	2.159.317,80	286.701.571,69	0,78%	1,02%	1,12%

RENTABILIDADE DA CARTEIRA SOBRE O ÍNDICE CDI (Mês)

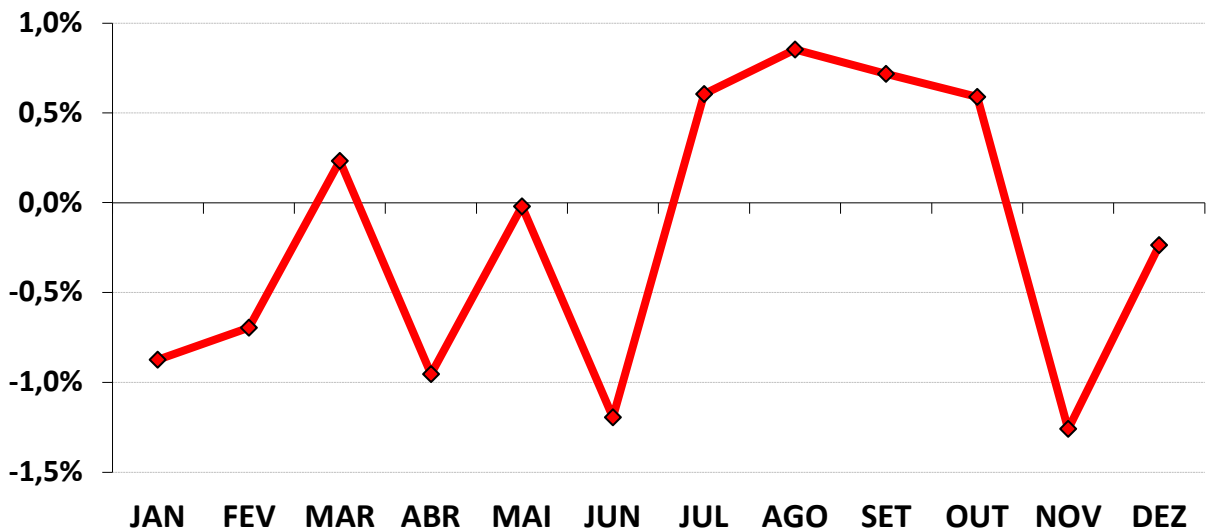


RENTABILIDADE DA CARTEIRA (mês) 2022



O gráfico do comportamento mensal mostra o resultado da Gestão de Investimentos do RPPS que conseguiu diversificar bem a carteira, mantendo estabilidade nos ganhos, mesmo com as condições macroeconômicas desfavoráveis, tanto a nível Interno como Externo. Até o 1º Trimestre/2022 a carteira apresentou um ganho crescente com a expectativa da volta da normalidade pós pandemia. A partir do 2º Trimestre/2022, a carteira apresentou "uma pausa" no crescimento devido a guerra na Ucrânia e a resiliência da inflação que, mesmo com a alta da Taxa Selic, não só, não arrefeceu como nos meses de março e abril tivemos a maior inflação para estes meses, desde 1994 e 1996, respectivamente. A Taxa Selic, projetada no início do ano em fechar em 11,75% passou a ser projetada finalizar em 13,75%. Em junho/2022, visando combater a alta da inflação o Governo Federal aprovou uma Lei que limitava a cobrança de ICMS sobre combustíveis, energia, transporte coletivo e telecomunicações, gerando incertezas quanto ao teto de gastos do Governo, já que essa medida iria reduzir Receita. No Exterior, a alta da inflação nos Países Desenvolvidos (que ultrapassou o histórico ocorrido a 40 anos) e o aumento da Taxa de Juros no E.U.A, contribuíram negativamente sobre o trimestre. No 4º Trimestre/2022 tivemos instabilidade no Mercado Financeiro, por conta das propostas do Governo de transição que queria extinguir o Teto de Gastos nos próximos 4 anos, elevar o valor do Auxílio Brasil (Bolsa Família) e a suplementação de R\$ 200 Bilhões de reais no orçamento federal/2023, trazendo mais incertezas sobre a Política Fiscal.

CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL (Mês) 2022



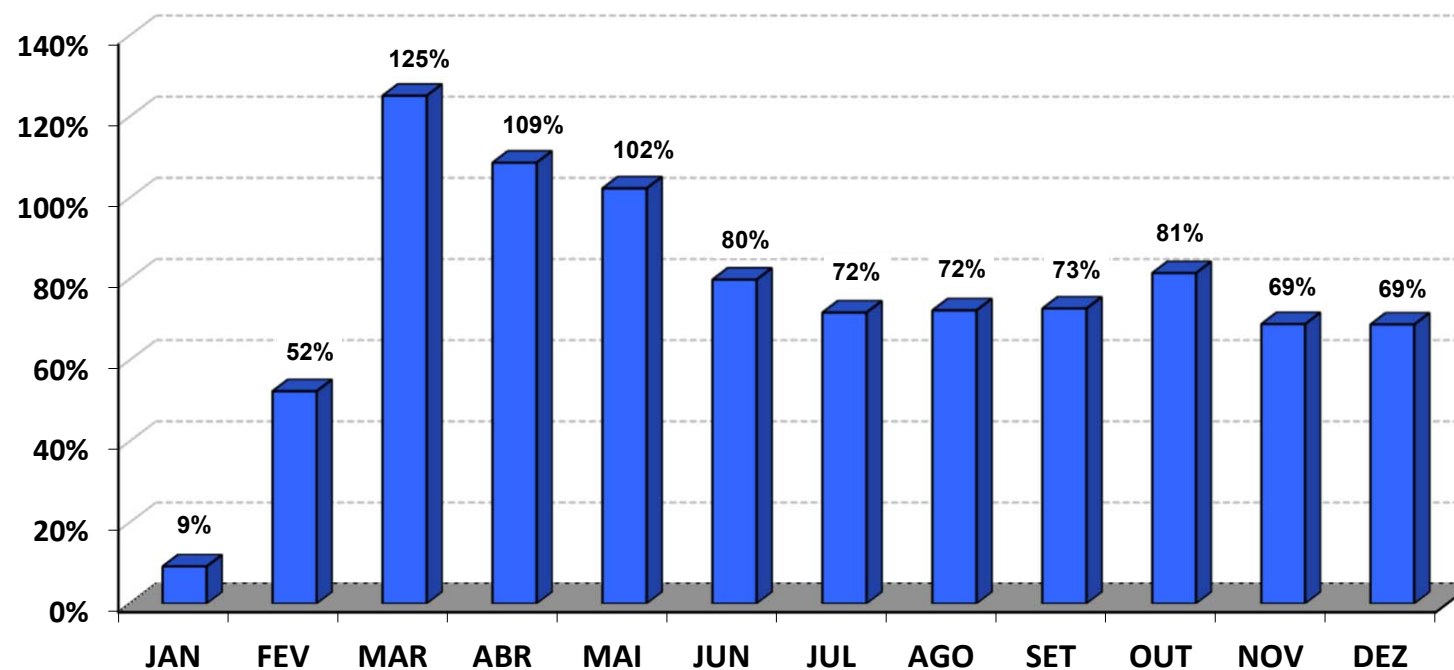
Podemos observar pelo gráfico acima, que em apenas 5 meses do ano, a carteira bateu ou ficou acima da Meta Atuarial.

Analisando o cumprimento da Meta Atuarial de forma mensal, o RPPS oscilou esse cumprimento, chegando a ficar distante por conta de -1,26% e conseguiu cumprir a Meta, ficando até um pouco acima da Meta Atuarial, por conta de 0,85%.

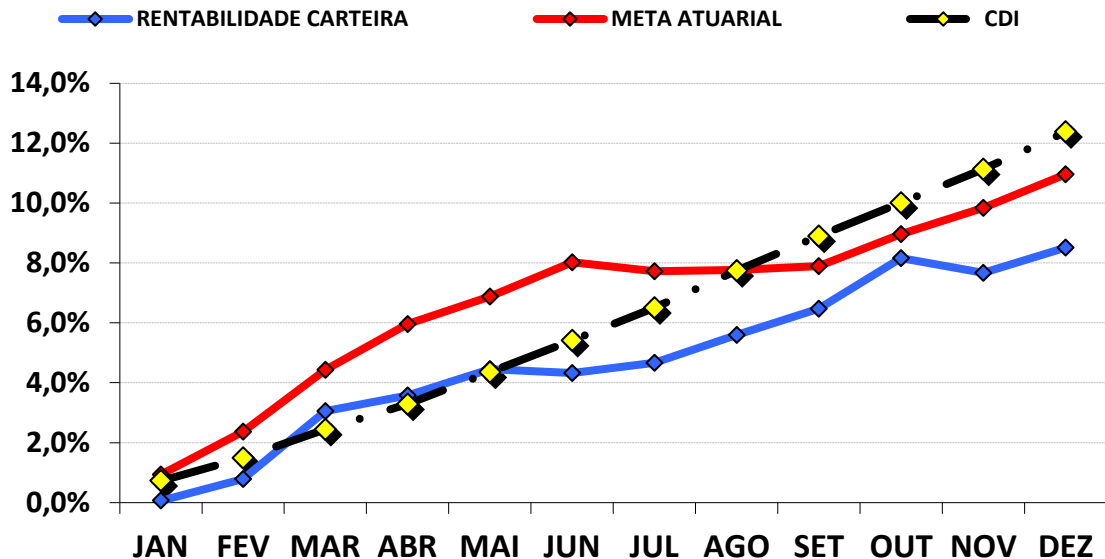
6 . 2 - Desempenho ACUMULADO DO ANO da carteira de Investimento

MESES	VALORIZAÇÃO / DESVALORIZAÇÃO (TÍTULOS PÚBLICOS)	RENDIMENTO COM IMÓVEIS	RENTABILIDADE DOS FUNDOS DE INVESTIMENTO	GANHO (RETORNO) DA CARTEIRA	PATRIMÔNIO FINAL	GANHO (RETORNO) DA CARTEIRA	META ATUARIAL	CDI
JANEIRO			162.063,06	162.063,06	242.743.422,50	0,07%	0,94%	0,73%
FEVEREIRO			1.894.710,59	1.894.710,59	245.567.694,94	0,78%	2,37%	1,50%
MARÇO			7.387.846,48	7.387.846,48	252.411.669,29	3,05%	4,43%	2,44%
ABRIL			8.662.524,57	8.662.524,57	255.216.905,32	3,57%	5,96%	3,29%
MAIO			10.826.272,30	10.826.272,30	258.306.595,33	4,46%	6,88%	4,35%
JUNHO			10.508.488,48	10.508.488,48	259.679.043,16	4,33%	8,03%	5,42%
JULHO			11.350.684,21	11.350.684,21	262.296.545,05	4,67%	7,73%	6,50%
AGOSTO			13.688.394,25	13.688.394,25	266.213.144,15	5,60%	7,77%	7,75%
SETEMBRO			15.874.759,13	15.874.759,13	270.083.827,06	6,47%	7,89%	8,90%
OUTUBRO			20.139.687,49	20.139.687,49	276.201.521,94	8,16%	8,96%	10,01%
NOVEMBRO			18.910.767,53	18.910.767,53	276.758.971,45	7,67%	9,84%	11,14%
DEZEMBRO			21.070.085,33	21.070.085,33	286.701.571,69	8,52%	10,96%	12,38%

RENTABILIDADE DA CARTEIRA SOBRE O ÍNDICE CDI (Acumulado)



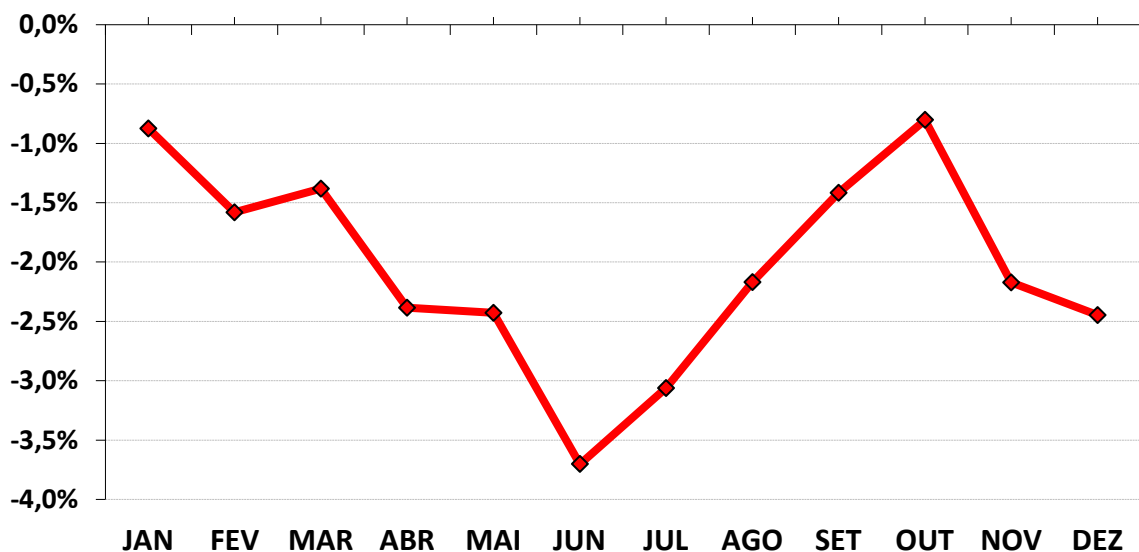
RENTABILIDADE DA CARTEIRA (Acumulada) 2022



A carteira de investimentos conseguiu uma rentabilidade de 8,52%, representando uma rentabilidade de 68,80%, sobre o índice de Benchmark CDI, que ficou em 12,38% no ano.

Como a Meta Atuarial ficou acima do nosso índice de Benchmark (CDI), a carteira de investimentos conseguiu uma rentabilidade de 77,68%, sobre a Meta Atuarial.

CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL (Acumulado) 2022



7 - CONSIDERAÇÕES FINAIS

Conforme dispõe o **§1º, do art. 43 da LRF**, as disponibilidades de caixa dos Regimes Próprios, ficarão depositados em contas separadas das demais disponibilidades do Ente e aplicadas nas condições de mercado, com observância dos limites e condições e prudência financeira, seguindo a Resolução CMN 4.963/2021.

A Reavaliação Atuarial realizada neste ano foi elaborada, baseada na expectativa de que no ano subsequente, ocorra um aumento das Provisões Matemáticas Previdenciárias de Benefício a Conceder e Benefício Concedido no mínimo no valor da Meta Atuarial, desde que se mantenham as hipóteses estudadas e estabelecidas pelo Atuário.

7.1 - META ATUARIAL

Conforme consta nas Avaliações Atuariais e na Portaria MTP 1.467/2022, as reservas previdenciárias precisam ser capitalizadas no mercado financeiro, no intuito mínimo que essas Reservas, que retornarão ao Servidor em forma de Benefício no futuro, não percam seu poder de compra. O valor nominal de cada “real” contribuído este ano seja o mesmo para os anos posteriores. Esse mínimo, para mantermos o poder de compra dos recursos financeiros, chamamos de **META ATUARIAL**.

Então, as Reservas previdenciárias constituídas são capitalizadas e procuram alcançar a Meta Atuarial que é estabelecida pelo Atuário, no momento da realização do Cálculo Atuarial. Assim, conforme a Política Anual de Investimentos/2022, as aplicações financeiras devem observar uma taxa real de Juros de 4,92% acrescido de um índice Inflacionário, que no nosso caso é o IPCA – Índice de Preços ao Consumidor Amplo.

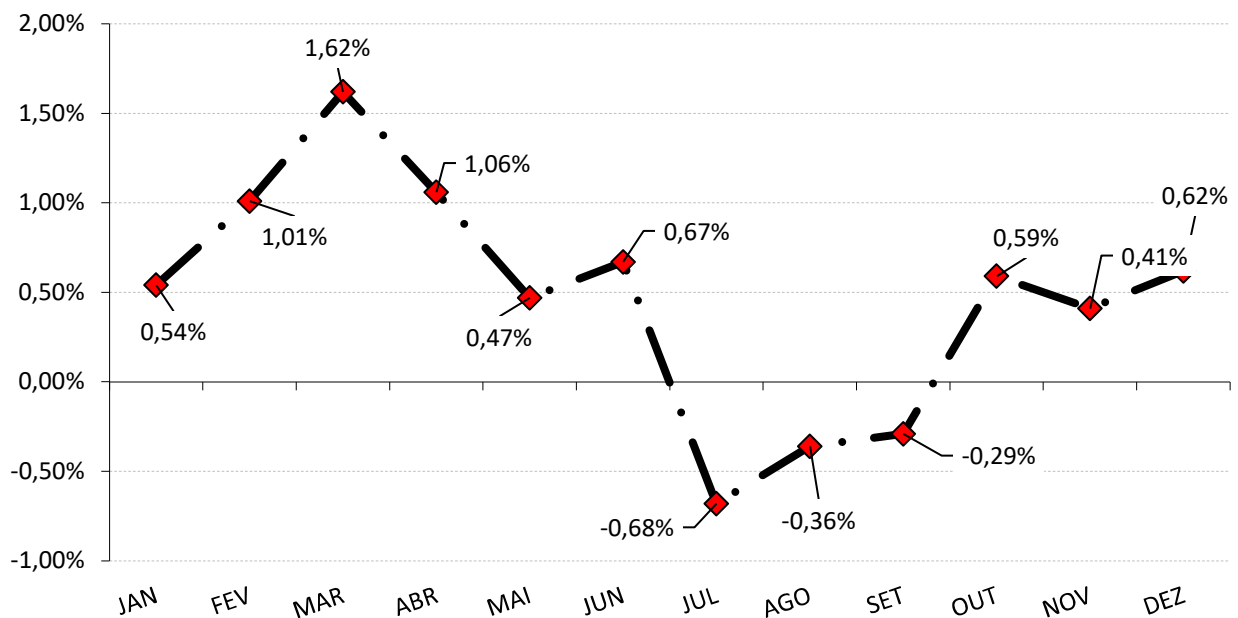
Assim, a Meta Atuarial ao final de 2022 foi de 10,96% a.a., referente á acumulação da Inflação de 5,78% a.a. (IPCA) e mais 4,92% a.a. de rentabilidade.

7.2 - INFLAÇÃO

Utilizamos o IPCA como índice inflacionário para compor a Meta Atuarial, devido a Portaria MTP 1.467/2022 não definir qual o índice inflacionário á ser utilizado pelos Institutos Previdenciários. Com isso, utilizamos o IPCA por ser tratado pelo Governo Federal como o índice oficial de inflação do país.

A acumulação do IPCA registrou uma alta de 5,78% a.a. para 2022, segundo o IBGE.

IPCA - MENSAL Índice Nacional de Preços ao Consumidor Amplo



O grupo que causou o maior impacto no IPCA em 2022 foi o grupo ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS. Este grupo apresentou inflação de anual de 2,41%, equivalente a 41,62% do IPCA.

Já o grupo que apresentou a menor inflação no ano, foi o grupo TRANSPORTES, cujo índice apresentou deflação de -0,28%, equivalente -4,84% do IPCA.

7.3 - RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Conforme a tabela e o gráfico da rentabilidade Acumulada, a carteira de investimentos do RPPS rentabilizou no acumulado do ano, 8,52% a.a.

Essa rentabilidade de 8,52% a.a. da carteira de investimentos foi ocasionada pela oscilação dos índices IMA - B, a partir do 2º Semestre/2022 e do fraco desempenho do mercado de Renda Variável. Fazendo com que a carteira de investimento alcançasse uma rentabilidade de 68,80% do nosso índice de referência.

7.4 - ALM – ASSET LIABILITY MANAGEMENT

A busca de títulos de renda fixa com adequada relação **retorno-risco, com vencimentos que coincidam com os pagamentos futuros dos benefícios**, representa um dos grandes desafios da gestão da carteira de investimentos.

A tarefa mais árdua para um administrador de um **Plano de Benefício Definido (BD)**, **que é o caso dos RPPS** é a gestão de seus ativos. Sabemos bem que retornos abaixo do esperado, no longo prazo, irão significar aumento de contribuição da parte patronal, já que o benefício está previamente definido.

Para atender a essas necessidades consultores, atuários e profissionais de investimentos desenvolveram uma série de estudos, que culminou no modelo hoje denominado por muitos de "**Asset Liability Management**" (ALM).

Os modelos de **ALM** buscam um casamento entre **os ativos e os passivos futuros**, ou seja, **o casamento de fluxos de caixa futuro**, no intuito de obter investimentos que acompanhem o fluxo projetado para o passivo e que sua estratégia de investimento não cause prejuízo e a permanência das posições aplicadas não coincidam com a necessidade de caixa do instituto para os próximos anos.

Esse tipo de análise é importante para estratégias de investimentos á longo prazo, como *Fundo de Ações, Fundos Multimercados, aplicações em Títulos Públicos, investimentos de condomínio fechado ou que possuam prazos de carência ou até mesmo para os fundos de investimento atrelados à subíndices ANBIMA.*

O mercado de renda variável possui um alto nível de **risco**, mas em compensação, quanto **maior** o risco de suas aplicações, **maior** a chance de rentabilidades excelentes. Os analistas de mercado financeiro aconselham aos investidores desse tipo de aplicação, estabelecer longos prazos para esse tipo de segmento. Segundo o Prof. Dr. Mauro Halfeld, o

mais aconselhável aos **POUPADORES**, para aplicar seus recursos financeiros em renda variável é estabelecer prazos de no mínimo **5 anos**. A História nos mostra, que aqueles que aplicam em renda variável traçando longos prazos, possuem mais chances de substanciais rentabilidades, devido possuírem mais períodos **positivos** do que **períodos negativos** de rentabilidade.

Para considerarmos a questão da segurança e liquidez nas aplicações como determina a Resolução CMN 4.693/21, os Investimentos considerados de Longo Prazo, realizados a partir de 2022, não pode coincidir com um fluxo de caixa negativo do RPPS, nos próximos 5 anos. Um fluxo de caixa negativo do RPPS antes do ano de 2028 obrigará o RPPS a vender sua posição antes da data pré-estabelecida e o risco de absorvemos um retorno menor ou até mesmo prejuízo, torna-se maior, devido à necessidade de caixa e do pagamento de benefícios.

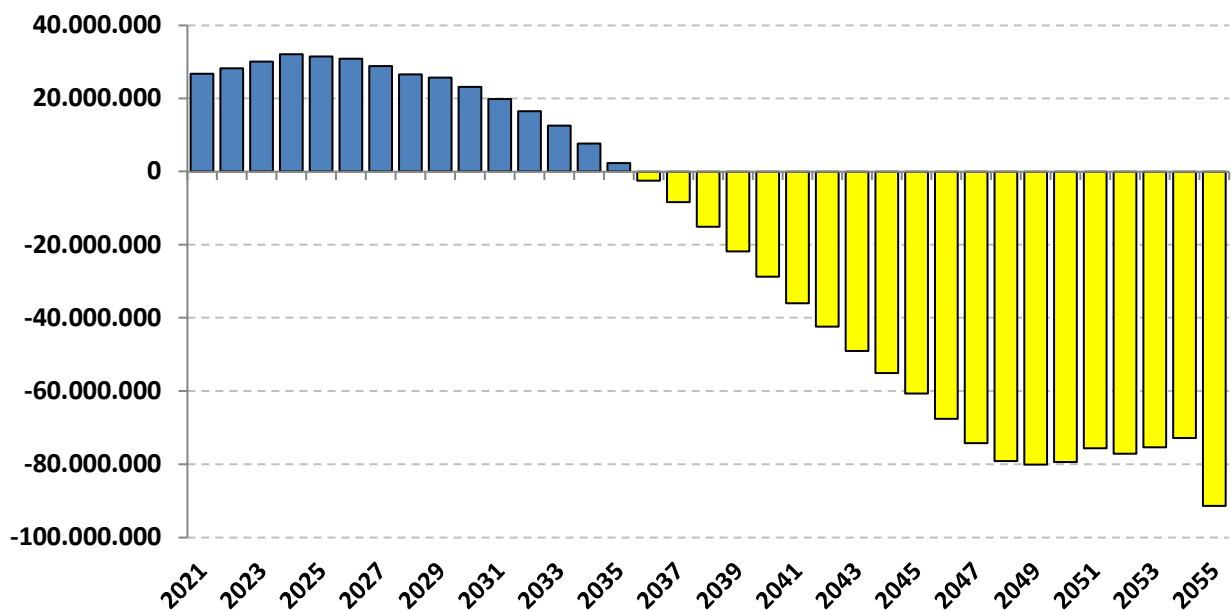
Conforme o estudo de Duration do Fluxo de Caixa realizado sobre a Avaliação Atuarial de 2021, a partir do ano de 2036, o RPPS possuirá um fluxo de caixa negativo, o que obrigará o RPPS a consumir os recursos financeiros poupados, para o pagamento de benefícios. Conforme descrito na Projeção Atuarial de 2021, esse estudo foi o mais conservador possível, pois não levou em consideração, a entrada de novos servidores concursados.

Diante da Análise realizada, as aplicações em investimentos que requerem esse tipo de estudo precisam buscar horizontes de no máximo 15 anos, para não coincidirem com o fluxo de pagamento de benefícios.

Assim, a aplicação em Fundos de Ações, Fundos Multimercados e Fundos Ações - BDR Nível I pelo RPPS, se fez em consonância com o Fluxo de pagamento de benefícios, levando em consideração a questão da segurança, rentabilidade, solvência, liquidez e transparência, conforme exige a Resolução CMN 4.963/21, não agravando os riscos em investimentos dessa magnitude.

Duration do fluxo de caixa do RPPS

(Instante em que o RPPS passará a consumir os recursos poupados)



7.5 - CONCLUSÃO

Para manter o poder de compra das Reservas Matemáticas Previdenciárias de Benefício, observou-se que o RPPS necessitava de uma rentabilidade mínima de 10,96% a.a., referente à Meta Atuarial e infelizmente, essa meta não foi alcançada em 2022.

Conforme descrito no item “6.3 Rentabilidade Acumulada da Carteira”, observou-se que a carteira de investimentos conseguiu uma rentabilidade de 8,52% a.a., contra 12,38% a.a. do Índice CDI.

Em valores monetários, a carteira de investimentos conseguiu, de Janeiro à Dezembro de 2022, uma rentabilidade de suas Reservas Previdenciárias de R\$ 21.070.085,33, enquanto que a necessidade da Meta Atuarial, era de que as Reservas Previdenciárias rentabilizassem no mínimo, R\$ 26.663.250,95, referente a Meta Atuarial.

Portanto, houve uma redução real das Reservas Previdenciárias em -2,45%.

Ou seja, dos R\$ 286.701.571,69 do patrimônio líquido ao final do ano, em termos reais, esses ativos líquidos possuem um valor de R\$ 281.108.406,07, devido R\$ (5.593.165,62) ser referente à diferença entre a rentabilidade alcançada e a necessidade da Meta Atuarial.

Essa diferença de R\$ (-5.593.165,62), terá um impacto de aumento do Déficit Atuarial e sobre as alíquotas de contribuição do ano seguinte, já que as Reavaliações Atuariais buscam o reequilíbrio do plano entre RECEITAS e DESPESAS, caso haja algum desajuste (como o não cumprimento da Meta Atuarial).

Em 2023, caso não haja nenhuma mudança significativa da massa, provavelmente teremos elevação das alíquotas, para a manutenção do poder de compra do patrimônio líquido do Instituto Previdenciário, referente à rentabilidade não alcançada.

Devido a instabilidade ocorrida no Mercado Financeiro tanto Interno, quanto Externo, a carteira de investimentos sofreu forte oscilação, principalmente no 2º e 4º Trimestre/2022 (conforme explicitado no item 6.1 - Desempenho MENSAL da carteira de Investimento), conseguindo performar bem, mantendo uma certa regularidade (estabilidade) a ponto de aproximar do cumprimento da Meta Atuarial, mas, não conseguindo cumpri-la devido a alta da inflação.

Se levarmos em consideração o rendimento médio da poupança de 0,636% a.m em 2022, e considerarmos a média do IPCA, no mesmo período, em 0,472% a.m., observaremos que é uma Inflação bastante elevada.

Diante da análise dos investimentos, verificamos presente em todas as aplicações financeiras, as condições de **segurança, rentabilidade, solvência e transparência**, conforme exige a Resolução CMN 4.963/2021.

É a análise.



Igor França Garcia

Atuário MIBA/RJ 1.659

Certificação de Especialista em Investimento - CEA

Consultor de Investimentos credenciado pela CVM