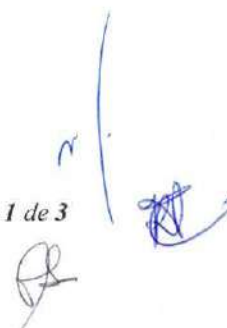


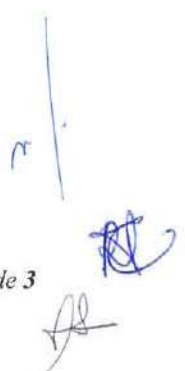
RELATORIO DE INVESTIMENTOS

DEZEMBRO 2022

Handwritten signature and initials in blue ink, located in the bottom right corner of the page.

SUMÁRIO

1. Apresentação	3
2. Parecer do Comitê de Investimentos	3
3. Aprovação do Conselho de Administração	3

Handwritten signature and initials in blue ink, located in the bottom right corner of the page. The signature appears to be a stylized name, and there are some initials or marks above it.

1. APRESENTAÇÃO

Este documento apresenta a posição da carteira de investimentos do São Roque Prev por segmentos e ativos, por tipo de risco, por instituição financeira e por limites da Política de Investimentos, e o acompanhamento da rentabilidade e dos riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos.

Tem por objetivo demonstrar os resultados das ações do deliberadas pelo Comitê de Investimentos.

Após cada reunião é elaborado uma ata que fica a disposição dos Conselhos de Administração e Fiscal para acompanhamento e homologação.

2. PARECER DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

O Comitê de Investimentos do São Roque Prev analisou e atestou a conformidade do relatório de investimentos referente ao mês dez/2022 quanto à rentabilidade e riscos das diversas modalidades de operações realizadas na aplicação dos recursos do São Roque Prev e da aderência das alocações e processos decisórios de investimento à Política de Investimentos.

3. APROVAÇÃO DO CONSELHO DE ADMINISTRAÇÃO

O Conselho de Administração, considerando os dados constantes no relatório mensal de investimentos apresentado e as explicações dos gestores, HOMOLOGA o relatório de investimentos referente ao mês de dezembro de 2022, em reunião realizada em 25 de janeiro de 2023.

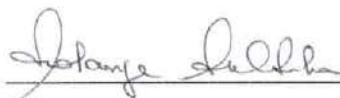
Rosana Teixeira de Carvalho



Lisete de Fátima Oliveira

Silvia Cristina de Almas de Alcântara

Solange Siqueira Duarte Silva



Mauracy Moraes de Oliveira





CRÉDITO
& MERCADO

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2022

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

7

R. R.



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE - SP
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/12/2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			131.154.367,36	31,41%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.164.349,41	0,76%	780	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.675.146,04	0,64%	553	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	528.644,99	0,13%	1.114	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	19.733.529,07	4,73%	366	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.249.669,15	1,26%	810	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
CAIXA BRASIL IDXA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.044.457,64	0,73%	963	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	11.065.820,45	2,65%	939	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.439.826,32	0,34%	739	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	15.478.070,47	3,71%	895	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.111.960,13	0,75%	87	0,93%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.933.007,10	2,38%	311	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.521.611,36	2,52%	128	1,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	33.104.421,89	7,93%	361	0,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.277.428,72	0,31%	242	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	37.145.131,52	8,90%	233	1,70%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	11.068.007,96	2,66%	316	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'
LETRA FINANCEIRA BTG	S/Info		82.473.700,26	19,75%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	D+4	Não há	21.327.713,60	5,11%	653	5,55%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.342.672,16	1,52%	44	1,04%	Artigo 8º, Inciso I



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE SÃO ROQUE PREV
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - 30/12/2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

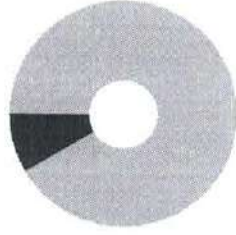
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+5	Não há	2.553.120,33	0,61%	13.917	0,38%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	D+4	Não há	2.427.153,63	0,68%	510	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NIVEL I	D+3	Não há	1.916.745,10	0,46%	2.662	1,51%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	544.054,07	0,13%	3.362	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	281.740,61	0,07%	7.148	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		36,50	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			417.592.348,34				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			36,50				Artigo 6º
PL Total			417.592.384,84				

2



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%	131.154.367,36	31,41%	0,00%	25,00%	50,00%	77.641.806,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	46.901.442,07	11,23%	12,00%	17,00%	50,00%	161.894.732,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	121.669.639,15	29,14%	10,00%	25,00%	60,00%	128.885.769,85
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	82.473.700,26	19,75%	0,00%	20,00%	20,00%	1.044.769,41
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	20.879.617,42
Total Renda Fixa	100,00%	382.199.148,84	91,52%	22,00%	87,00%	185,00%	



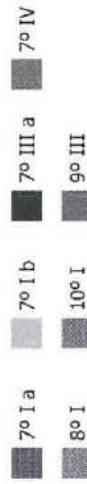
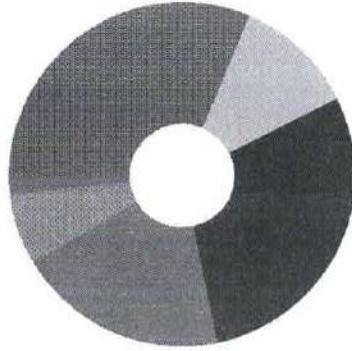
RENDA FIXA 382.199.148,84
 RENDA VARIÁVEL 27.670.385,76
 EXTERIOR 6.897.019,06
 ESTRUTURADOS 825.794,68

2

**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%	27.670.385,76	6,63%	4,00%	10,00%	15,00%	34.568.466,49
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	825.794,68	0,20%	0,00%	1,00%	5,00%	20.053.822,74
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	28.496.180,44	6,82%	4,00%	11,00%	20,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.897.019,06	1,65%	0,00%	2,00%	5,00%	13.982.598,36
Total Exterior	10,00%	6.897.019,06	1,65%	0,00%	2,00%	5,00%	



2

[Handwritten signature]



Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLI...	131.154.367,36	31,41	-
CAIXA DTVM	68.956.182,84	16,51	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.460.573,91	15,68	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	37.145.131,52	8,90	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.044.967,23	3,12	0,00
ITAÚ UNIBANCO	13.014.753,06	3,12	0,00
ITAÚ DTVM	6.342.672,16	1,52	0,00

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'	131.154.367,36	31,41	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	46.901.442,07	11,23	12,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	121.669.639,15	29,14	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	27.670.385,76	6,63	4,00	15,00
Artigo 9º, Inciso III	6.897.019,06	1,65	0,00	5,00
Artigo 10º, Inciso I	825.794,68	0,20	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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 496/3)

2



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%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	9,04%	2,36%	2,47%	9,04%	14,12%	1,30%	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%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	9,67%	2,46%	2,96%	9,67%	14,40%	1,14%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	9,51%	2,44%	2,86%	9,51%	14,19%	1,14%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,27%	5,95%	0,03%	1,67%	5,95%	3,48%	2,42%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,24%	6,20%	0,10%	1,87%	6,20%	4,57%	2,52%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22%	6,09%	0,17%	1,80%	6,09%	4,49%	2,47%	0,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,26%	6,02%	-0,06%	1,74%	6,02%	4,43%	2,58%	0,04%
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	13,00%	3,34%	6,88%	13,00%	18,58%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,13%	12,76%	3,20%	6,69%	12,76%	17,85%	0,02%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	11,41%	3,98%	4,00%	11,41%	16,36%	0,60%	0,03%

2



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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	13,13%	3,32%	6,83%	13,13%	18,83%	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%
IPCA (Benchmark)	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%	-	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1,20%	10,77%	1,97%	5,55%	10,77%	11,55%	0,56%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14%	10,70%	2,23%	5,84%	10,70%	10,58%	0,37%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,37%	7,83%	-0,53%	2,43%	7,83%	12,71%	1,53%	0,02%
LETRA FINANCEIRA BTG	-	-	-	-	-	-	-	-

27



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VarR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1,18%	13,45%	2,91%	6,55%	13,45%	18,12%	0,22%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,14%	12,03%	1,54%	8,38%	12,03%	11,10%	2,74%	0,07%
Global BDRX (Benchmark)	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,60%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	-2,72%	3,65%	-1,81%	9,14%	3,65%	-10,02%	9,33%	0,21%
ITAU FOF RPI IBOVESPATIVO FIC AÇÕES	-2,13%	4,71%	-1,49%	10,99%	4,71%	-12,72%	9,24%	0,21%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-7,51%	-26,51%	3,02%	0,69%	-26,51%	-1,18%	-	-

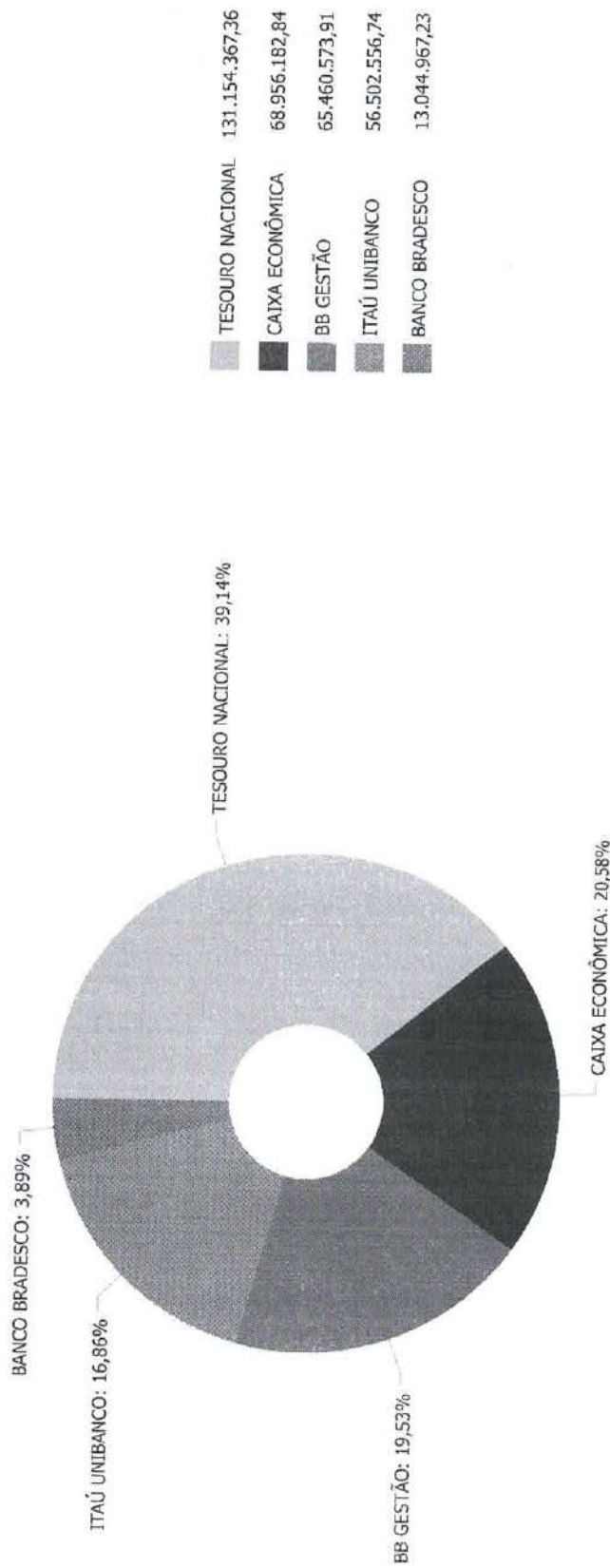
2



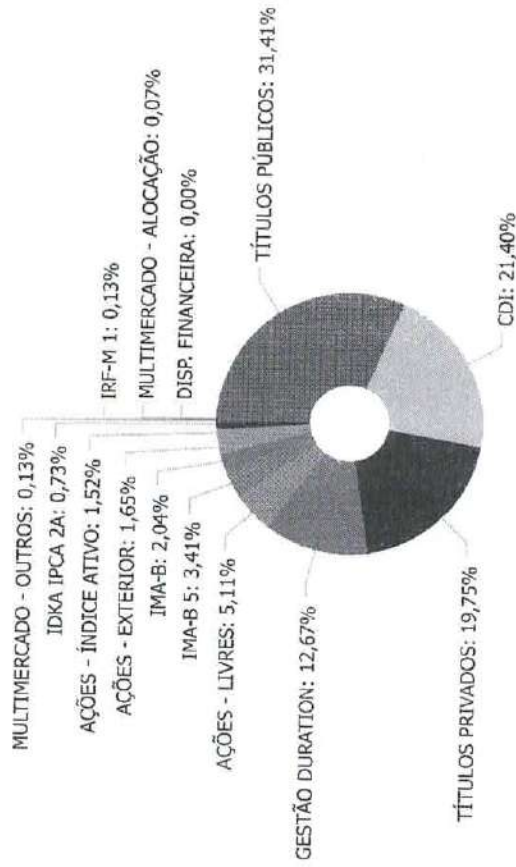
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	-7,51%	-26,51%	3,02%	0,69%	-26,51%	-1,18%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	-4,87%	-25,69%	5,52%	2,03%	-25,89%	-2,06%	10,03%	0,20%
Global BDRX (Benchmark)	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NIVEL I	-3,82%	-15,97%	6,73%	1,90%	-15,97%	10,96%	9,62%	0,16%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	-4,79%	-28,54%	3,52%	-0,98%	-28,54%	-6,74%	10,61%	0,20%

2.



22



■ TÍTULOS PÚBLICOS	131.154.367,36	■ CDI	89.347.036,49	■ TÍTULOS PRIVADOS	82.473.700,26	■ GESTÃO DURATION	52.916.411,03
■ AÇÕES - LIVRES	21.327.713,60	■ IMA-B 5	14.230.169,86	■ IMA-B	8.504.361,21	■ AÇÕES - EXTERIOR	6.897.019,06
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.342.672,16	■ IDKA IPCA 2A	3.044.457,64	■ MULTIMERCADO - OUTROS	544.054,07	■ IRF-M 1	528.644,99
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	281.740,61	■ DISP. FINANCEIRA	36,50				

Handwritten signature and initials.



Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2022)

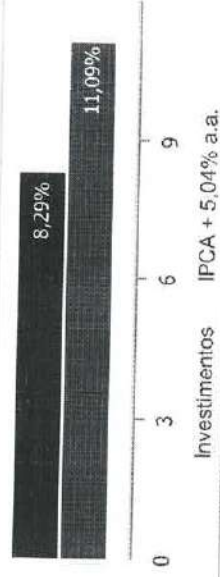
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/06/2022	19.713	4058,06717400	4.070,991195	79.996.678,20	80.251.449,43	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	04/11/2022	12.238	4.086,264032100	4.160,094633	49.999.526,70	50.902.917,93	Curva



Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

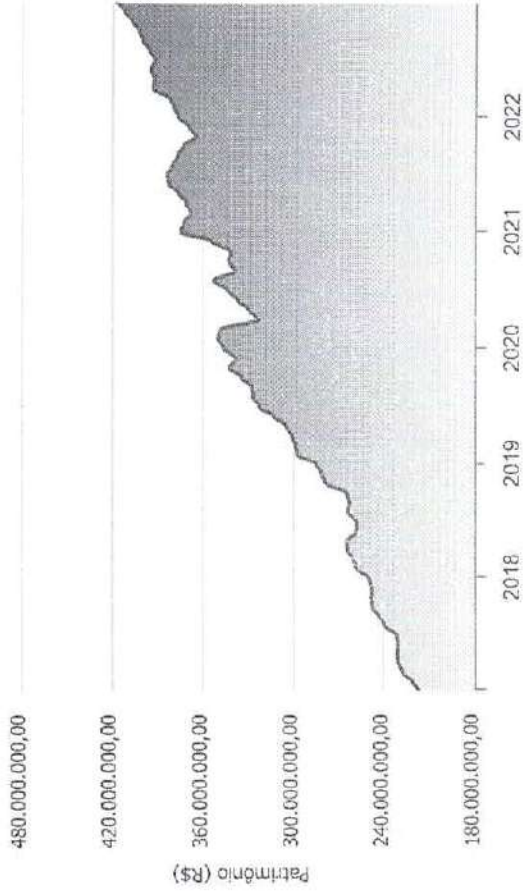
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	376.717.647,44	10.356.994,81	11.768.751,83	379.574.284,25	4.268.423,83	4.268.423,83	1,13%	1,13%	0,95%	0,95%	118,92%	2,69%
Fevereiro	379.574.284,25	2.182.841,52	2.015.508,23	382.172.076,40	2.430.358,85	6.698.782,69	0,64%	1,78%	1,38%	2,35%	75,72%	2,11%
Março	382.172.076,40	3.579.804,77	1.763.527,83	393.494.117,69	9.505.984,35	16.204.747,04	2,48%	4,30%	2,06%	4,46%	96,46%	3,06%
Abril	393.494.117,69	4.280.705,01	964.179,46	392.627.311,29	-4.183.331,95	12.021.415,09	-1,05%	3,20%	1,44%	5,96%	53,73%	2,44%
Maio	392.627.311,29	86.263.391,03	110.415.112,13	372.968.820,27	4.493.230,08	16.514.645,17	1,14%	4,38%	0,90%	6,91%	63,39%	2,39%
Junho	372.968.820,27	245.721.596,23	223.724.601,75	392.257.467,83	-2.708.348,92	13.806.286,25	-0,69%	3,67%	1,09%	8,07%	45,42%	1,94%
Julho	392.257.467,83	154.816.827,65	154.252.730,57	396.136.559,98	3.314.934,07	17.121.290,32	0,84%	4,54%	-0,27%	7,78%	68,39%	1,69%
Agosto	396.136.559,98	3.210.080,35	4.889.629,95	397.972.796,26	3.514.985,88	20.636.276,20	0,89%	5,47%	0,09%	7,87%	69,47%	2,01%
Setembro	397.972.796,26	2.928.081,02	2.178.806,48	400.500.634,12	1.780.364,32	22.416.640,52	0,45%	5,94%	0,12%	8,00%	74,24%	2,13%
Outubro	400.500.634,12	5.228.996,26	3.133.342,69	407.166.133,16	4.571.845,47	26.988.485,99	1,14%	7,14%	0,98%	9,06%	78,81%	2,50%
Novembro	407.166.133,16	56.246.202,71	53.258.666,58	412.421.674,35	2.267.945,45	29.256.431,45	0,55%	7,73%	0,80%	9,94%	77,83%	3,78%
Dezembro	412.421.674,35	5.294.546,41	2.246.845,01	417.592.348,34	2.123.032,59	31.379.464,04	0,51%	8,29%	1,05%	11,09%	74,69%	2,19%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





Evolução do Patrimônio



ANO

- 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
- SMILL
- IDIV



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.007.348,68	0,00	0,00	3.044.457,64	37.108,96	1,23%	1,23%	1,30%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.397.037,54	0,00	0,00	10.521.611,36	124.573,82	1,20%	1,20%	0,56%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	9.618.536,63	0,00	0,00	9.933.007,10	114.470,47	1,17%	1,17%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	522.598,12	0,00	0,00	528.644,99	6.046,87	1,16%	1,16%	0,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.190.533,90	0,00	0,00	5.249.668,15	59.134,25	1,14%	1,14%	0,37%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	32.734.603,93	0,00	0,00	33.104.421,89	369.617,96	1,13%	1,13%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.974.211,93	0,00	0,00	11.098.007,96	123.796,03	1,13%	1,13%	0,01%
LETRA FINANCEIRA BTG	81.570.313,63	0,00	0,00	82.473.700,26	903.386,63	1,11%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDÊNCIA...	19.546.862,97	0,00	0,00	19.733.529,07	186.666,10	0,95%	0,95%	0,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.964.719,70	0,00	0,00	11.065.820,45	101.100,75	0,92%	0,92%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.135.696,71	0,00	0,00	3.164.349,41	28.652,70	0,91%	0,91%	1,14%
TÍTULOS PÚBLICOS	130.013.022,20	0,00	0,00	131.154.367,36	1.141.345,16	0,88%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	12.289.263,49	5.294.546,41	2.246.845,01	15.478.070,47	141.105,58	0,80%	1,03%	0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.680.993,26	0,00	0,00	2.675.146,04	-5.847,24	-0,22%	-0,22%	2,47%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.443.244,69	0,00	0,00	1.439.626,32	-3.418,37	-0,24%	-0,24%	2,52%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.280.802,49	0,00	0,00	1.277.426,72	-3.373,77	-0,26%	-0,26%	2,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.120.282,07	0,00	0,00	3.111.960,13	-8.321,94	-0,27%	-0,27%	2,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	37.282.998,49	0,00	0,00	37.145.131,52	-137.866,97	-0,37%	-0,37%	1,53%
Total Renda Fixa	375.973.070,45	5.294.546,41	2.246.845,01	382.199.148,84	3.178.376,99	0,84%		0,70%

23



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAU FOF RPI BOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.480.447,13	0,00	0,00	6.342.672,16	-137.774,97	-2,13%	-2,13%	9,24%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIC AÇÕES	21.922.863,95	0,00	0,00	21.327.713,60	-595.150,35	-2,71%	-2,71%	9,33%
Total Renda Variável	28.403.311,08	0,00	0,00	27.670.385,76	-732.925,32	-2,58%		9,31%



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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	537.792,53	0,00	0,00	544.054,07	6.261,54	1,16%	1,16%	0,22%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	281.352,28	0,00	0,00	281.740,61	388,33	0,14%	0,14%	2,74%
ITAU FIC AÇÕES BDR NIVEL I	1.992.874,78	0,00	0,00	1.916.745,10	-76.129,68	-3,82%	-3,82%	9,82%
CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NIVEL I	2.549.357,52	0,00	0,00	2.427.153,63	-122.203,89	-4,79%	-4,79%	10,61%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NIVEL I	2.683.855,71	0,00	0,00	2.553.120,33	-130.735,38	-4,87%	-4,87%	10,03%
Total Exterior	8.045.232,82	0,00	0,00	7.722.813,74	-322.419,08	-4,01%		9,20%



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
TÍTULOS PÚBLICOS	78.211.889,77	49.989.526,72	0,00	131.154.367,36	2.942.950,87	2,30%	-
LETRA FINANCEIRA BTG	80.270.239,23	0,00	0,00	82.473.700,28	2.203.461,03	2,75%	-
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	41.960.811,30	0,00	10.000.000,00	33.104.421,89	1.143.610,59	2,73%	3,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	19.537.465,05	0,00	574.164,97	19.733.529,07	770.228,99	3,94%	3,98%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.490.009,56	0,00	10.000.000,00	9.933.007,10	442.997,54	2,27%	3,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	14.340.407,34	16.768.218,66	16.064.689,71	15.478.070,47	434.134,18	1,40%	2,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	26.888.720,38	0,00	22.000.000,00	5.249.668,15	360.947,77	1,34%	2,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.741.049,38	0,00	0,00	11.068.007,96	356.958,58	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.600.537,62	0,00	0,00	11.065.820,45	265.282,63	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	10.318.145,73	0,00	0,00	10.521.611,36	203.465,63	1,97%	1,97%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.088.890,30	0,00	0,00	3.164.349,41	75.459,11	2,44%	2,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.974.279,01	0,00	0,00	3.044.457,64	70.178,63	2,36%	2,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	512.818,80	0,00	0,00	528.644,99	15.826,19	3,09%	3,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.670.727,48	0,00	0,00	2.675.146,04	4.418,56	0,17%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.438.358,19	0,00	0,00	1.439.826,32	1.468,13	0,10%	0,10%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.110.980,30	0,00	0,00	3.111.960,13	979,83	0,03%	0,03%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.276.134,96	0,00	0,00	1.277.428,72	-706,24	-0,06%	-0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	37.342.764,43	0,00	0,00	37.145.131,52	-197.632,91	-0,53%	-0,53%
Total Renda Fixa	364.976.229,03	66.767.745,38	58.638.854,68	382.199.148,84	9.094.029,11	2,44%	

[Handwritten signatures and initials]



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
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	528.696,87	0,00	0,00	544.054,07	15.357,20	2,90%	2,90%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	277.456,21	0,00	0,00	281.740,61	4.284,40	1,54%	1,54%
ITAU FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	6.430.365,92	0,00	0,00	6.342.872,16	-95.693,76	-1,49%	-1,49%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	21.719.917,20	0,00	0,00	21.327.713,60	-392.203,60	-1,81%	-1,81%
Total Renda Variável	28.964.436,20	0,00	0,00	28.496.180,44	-468.255,76	-1,62%	



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 GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.419.499,65	0,00	0,00	2.553.120,33	133.620,68	5,52%	5,52%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.795.802,16	0,00	0,00	1.916.745,10	120.942,94	6,73%	6,73%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.344.667,08	0,00	0,00	2.427.153,63	82.486,55	3,52%	3,52%
Total Exterior	6.559.968,89	0,00	0,00	6.897.019,06	337.050,17	5,14%	

2



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 (%)	(%) Instít
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	129.996.204,92	2.314.308,07	131.154.367,36	3.472.470,51	2,67%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	44.360.024,71	0,00	42.000.000,00	5.249.668,15	2.889.643,44	6,51%	10,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	38.584.501,46	0,00	38.000.000,00	3.164.349,41	2.579.847,96	6,69%	9,51%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	120.617.204,61	89.996.678,20	33.104.421,89	2.483.895,48	2,06%	12,76%
LETRA FINANCEIRA BTG	0,00	60.000.000,00	0,00	82.473.700,26	2.473.700,26	3,09%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	31.654.599,46	10.000.000,00	33.000.000,00	11.065.820,45	2.411.220,99	5,79%	9,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	24.867.765,58	10.000.000,00	0,00	37.145.131,52	2.277.365,94	6,53%	7,83%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	18.692.461,02	0,00	9.617.241,10	10.521.611,36	1.446.391,44	7,74%	10,77%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	5.686.679,40	64.346.196,31	55.855.967,90	15.478.070,47	1.301.162,66	1,86%	11,26%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	0,00	30.438.299,00	21.773.824,71	9.933.007,10	1.268.532,81	4,17%	13,00%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	29.236.473,76	0,00	29.000.000,00	1.277.428,72	1.041.954,96	3,56%	6,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	21.191.116,19	560.925,27	20.000.000,00	2.675.146,04	923.104,58	4,24%	6,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	18.613.923,23	0,00	19.000.000,00	528.644,39	914.721,76	4,91%	11,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	0,00	69.161.162,10	67.000.000,01	3.044.457,64	863.295,56	1,28%	9,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	0,00	20.000.000,00	1.135.090,24	19.733.529,07	866.619,31	4,34%	11,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	10.326.860,09	0,00	11.096.007,96	771.147,87	7,47%	13,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	15.837.848,60	0,00	15.000.000,00	1.439.826,32	601.977,72	3,80%	6,19%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	11.200.738,14	0,00	11.664.474,29	0,00	463.736,15	4,14%	6,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9.809.541,60	10.212.120,16	17.212.120,16	3.111.960,13	302.418,53	1,51%	5,95%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	22.000.000,00	22.106.008,73	0,00	106.008,73	0,48%	12,59%



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
Total Renda Fixa	269.734.673,15	577.658.972,46	494.675.713,41	382.199.148,84	29.481.216,64	8,36%	

3

A
A



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	13.871.260,04	0,00	15.161.162,10	0,00	1.289.902,06	9,30%	4,78%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	19.267.759,40	0,00	20.000.000,00	544.054,07	1.276.294,67	6,62%	13,45%
ITAÚ FOF RPI BOVESPAATIVO FIC AÇÕES	15.515.214,23	0,00	10.000.000,00	6.342.672,16	827.457,93	5,33%	4,71%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	20.576.212,61	0,00	0,00	21.327.713,60	751.500,99	3,65%	3,65%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	17.602.673,28	0,00	18.000.000,00	281.740,61	679.067,33	3,86%	12,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	11.027.239,75	0,00	10.326.860,09	0,00	-700.379,66	-6,35%	-9,36%
Total Renda Variável	97.860.359,31	0,00	73.488.022,19	28.496.180,44	4.123.843,32	4,21%	

2



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 (%)	(%) Instít
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.280.935,32	0,00	0,00	1.916.745,10	-364.190,22	-15,97%	-15,97%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.445.214,89	0,00	0,00	2.553.120,33	-892.094,56	-25,89%	-25,89%
CAIXA INSTITUCIONAL FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.396.464,77	2.447.767,31	2.447.767,31	2.427.153,63	-969.311,14	-16,59%	-28,54%
Total Exterior	9.122.614,98	2.447.767,31	2.447.767,31	6.897.019,06	-2.225.595,92	-19,24%	



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 aliquotas 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.