

Relatório Analítico dos Investimentos

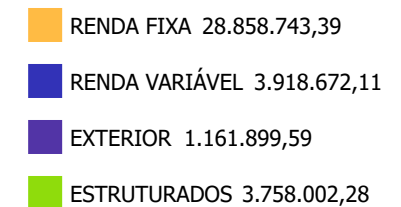
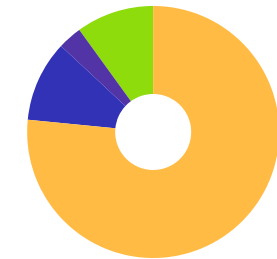
em novembro de 2022

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2022)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	224.626,50	0,60%	35.350	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	573.894,05	1,52%	25.279	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	262.993,06	0,70%	193	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	428.432,97	1,14%	7.452	0,28%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	180.893,41	0,48%	2.780	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	58.307,01	0,15%	3.014	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	258.989,29	0,69%	17	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	539.318,66	1,43%	14.293	0,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	288.536,06	0,77%	27.555	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	492.557,73	1,31%	157	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	380.805,80	1,01%	512	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	339.742,85	0,90%	127	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	2.999.832,30	7,96%	3.407	0,22%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	418.427,13	1,11%	830	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		37.080,98	0,10%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			37.697.317,37				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			37.080,98				Artigo 6º
PL Total			37.734.398,35				

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

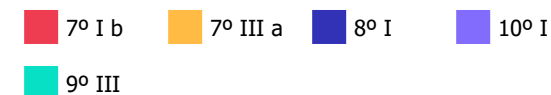
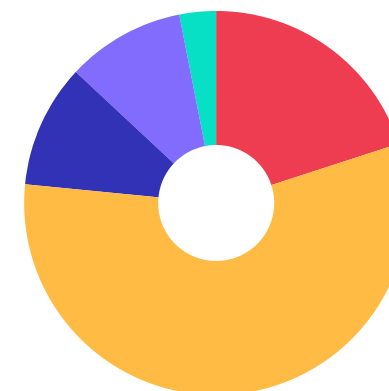
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	3.769.731,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	7.539.141,02	20,00%	0,00%	36,00%	100,00%	30.158.176,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	21.319.602,37	56,55%	0,00%	24,00%	60,00%	1.298.788,05
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	3.769.731,74
Total Renda Fixa	100,00%	28.858.743,39	76,55%	0,00%	65,00%	180,00%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2022			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.918.672,11	10,40%	0,00%	15,00%	20,00%	3.620.791,36
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	3.769.731,74
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.758.002,28	9,97%	0,00%	9,00%	10,00%	11.729,46
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	7.676.674,39	20,36%	0,00%	25,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2022			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.161.899,59	3,08%	0,00%	10,00%	10,00%	2.607.832,15
Total Exterior	10,00%	1.161.899,59	3,08%	0,00%	10,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2022)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.035.557,23	39,88	-
ITAÚ UNIBANCO	12.741.422,64	33,80	0,00
CAIXA DTVM	9.661.348,21	25,63	-
ITAÚ DTVM	258.989,29	0,69	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,77%	8,00%	1,63%	1,56%	8,90%	15,34%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,65%	8,01%	1,72%	1,72%	8,77%	14,75%	1,98%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,42%	5,70%	1,06%	5,02%	8,12%	3,49%	-	-
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,50%	5,44%	0,89%	4,74%	7,86%	2,98%	4,87%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,18%	4,54%	1,85%	1,33%	4,19%	5,03%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,20%	4,34%	1,80%	1,23%	3,99%	4,38%	6,73%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,94%	10,71%	3,09%	6,43%	11,68%	14,31%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	10,46%	3,02%	6,31%	11,40%	13,77%	0,19%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,33%	8,76%	2,00%	2,36%	9,62%	15,81%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,35%	8,67%	1,95%	2,36%	9,50%	15,42%	1,96%	0,03%
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,94%	10,12%	2,91%	5,99%	10,86%	13,84%	0,00%	0,01%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1,03%	11,44%	3,22%	6,66%	12,35%	17,14%	0,05%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,02%	11,34%	3,19%	6,57%	12,23%	16,78%	0,02%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,74%	10,36%	3,08%	3,35%	10,97%	17,53%	0,87%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	-0,06%	8,87%	1,76%	4,52%	8,86%	16,36%	1,15%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,07%	11,87%	3,31%	6,80%	12,77%	17,73%	0,06%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,48%	10,55%	2,58%	5,36%	11,06%	17,52%	0,61%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	0,66%	11,68%	2,90%	6,02%	11,96%	-	0,50%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,31%	-	-0,04%	0,22%	-	-	5,34%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	5,38%	-14,39%	3,16%	-1,26%	-10,66%	12,66%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,64%	-9,16%	4,63%	2,30%	-4,37%	21,79%	12,68%	0,23%
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	6,06%	-7,47%	5,37%	3,54%	-2,34%	26,58%	14,13%	0,24%
Global BDRX (Benchmark)	7,09%	-24,89%	-0,58%	4,59%	-23,60%	1,33%	-	-
IDIV (Benchmark)	0,78%	14,50%	2,96%	0,30%	16,33%	16,74%	-	-
BB DIVIDENDOS MIDCAPS FIC AÇÕES	-6,72%	2,90%	-2,15%	-3,87%	6,40%	2,23%	14,68%	0,21%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,67%	13,21%	2,59%	-0,24%	14,94%	10,48%	13,15%	0,18%
Ibovespa (Benchmark)	-3,06%	7,31%	2,71%	1,02%	10,37%	3,30%	-	-
BB AÇÕES EXPORTAÇÃO FIC AÇÕES	1,25%	-11,65%	3,08%	-6,66%	-4,45%	6,85%	14,89%	0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,00%	-1,02%	-0,85%	-4,35%	3,02%	4,37%	13,50%	0,19%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-16,55%	-6,16%	-4,57%	-2,86%	-0,26%	-33,38%	23,69%	0,33%
BB INFRAESTRUTURA FIC AÇÕES	-0,89%	5,70%	5,98%	2,65%	12,29%	14,66%	14,27%	0,22%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-9,13%	-7,50%	-6,28%	-6,24%	-6,11%	-13,14%	15,58%	0,23%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-4,00%	1,86%	-0,17%	-4,20%	5,49%	5,43%	13,67%	0,21%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-3,88%	5,08%	-1,60%	-2,45%	11,15%	18,17%	14,35%	0,18%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-14,29%	-22,22%	-10,22%	-10,74%	-22,23%	-40,43%	17,30%	0,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-8,42%	-0,68%	-2,01%	-0,55%	0,13%	-15,74%	13,89%	0,23%

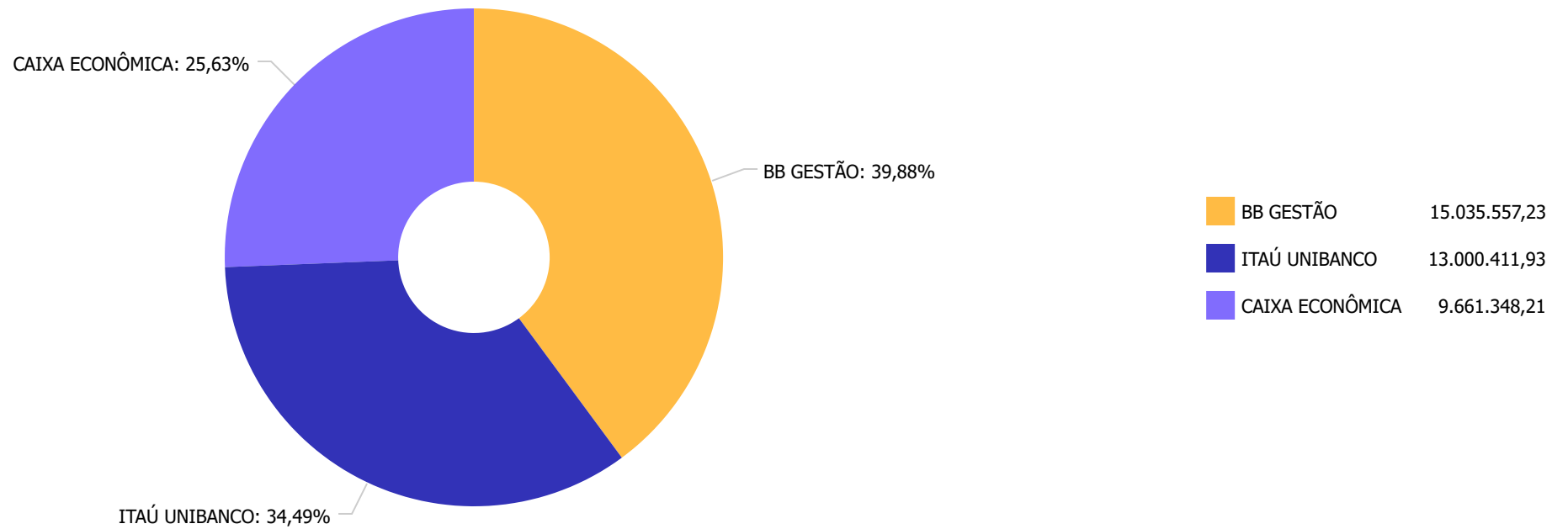
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2022 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-7,52%	10,91%	-1,70%	0,83%	14,30%	10,35%	15,71%	0,23%
SMLL (Benchmark)	-11,23%	-12,42%	-6,49%	-8,76%	-9,10%	-21,09%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-9,33%	-6,99%	-5,34%	-6,99%	-3,72%	-10,06%	16,23%	0,25%
CDI (Benchmark)	1,02%	11,12%	3,15%	6,50%	11,97%	16,20%	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,74%	12,14%	2,94%	6,52%	13,03%	17,02%	0,33%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,26%	12,99%	3,63%	7,14%	14,60%	17,14%	2,64%	0,04%

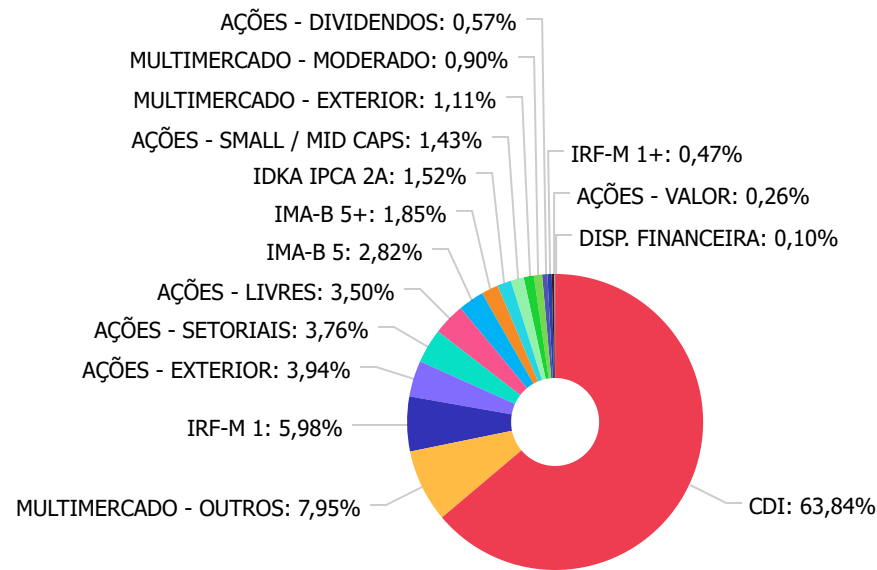
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2022 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	7,09%	-24,89%	-0,58%	4,59%	-23,60%	1,33%	-	-
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	-21,38%	5,20%	8,22%	-19,03%	5,66%	20,07%	20,12%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-	-9,48%	3,92%	-0,57%	-5,34%	13,06%	11,21%	19,80%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	-24,94%	1,73%	5,37%	-23,66%	-1,36%	21,72%	20,05%

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



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

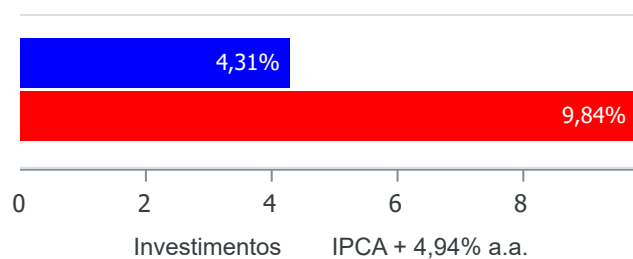


■ CDI	24.090.643,43	■ MULTIMERCADO - OUTROS	2.999.832,30	■ IRF-M 1	2.255.775,42	■ AÇÕES - EXTERIOR	1.487.717,40
■ AÇÕES - SETORIAIS	1.418.369,02	■ AÇÕES - LIVRES	1.320.502,90	■ IMA-B 5	1.063.194,32	■ IMA-B 5+	697.229,70
■ IDKA IPCA 2A	573.861,43	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	539.318,66	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	418.427,13	■ MULTIMERCADO - MODERADO	339.742,85
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	215.739,42	■ IRF-M 1+	178.039,09	■ AÇÕES - VALOR	98.924,30	■ DISP. FINANCEIRA	37.080,98

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2022

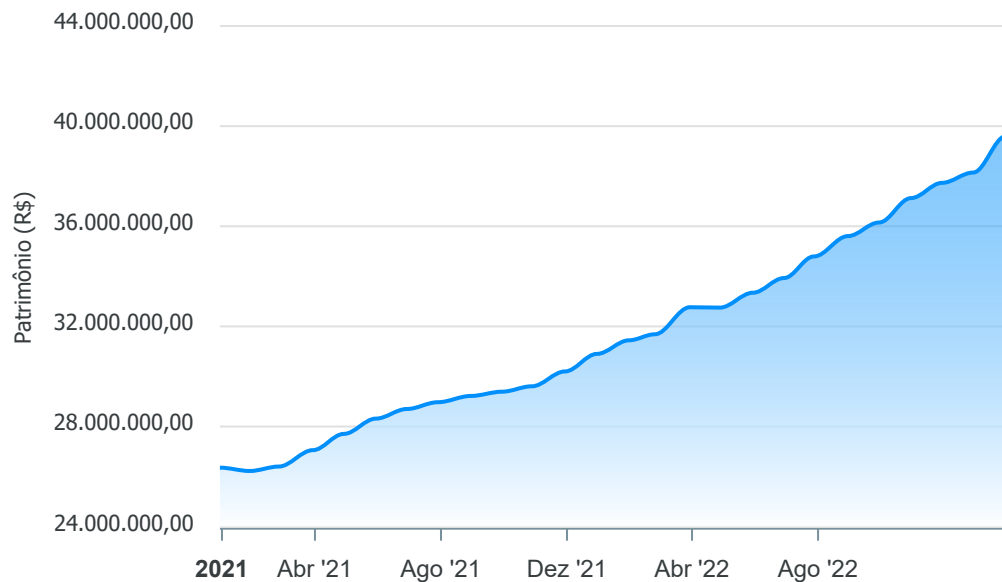
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	30.898.189,95	857.173,16	170.236,29	31.434.748,43	-150.378,39	-150.378,39	-0,48%	-0,48%	0,94%	0,94%	-50,39%	3,42%
Fevereiro	31.434.748,43	2.900.344,67	3.070.447,00	31.129.823,97	-134.822,13	-285.200,52	-0,43%	-0,90%	1,38%	2,34%	-38,66%	3,03%
Março	31.129.823,97	6.257.996,97	5.309.562,28	32.760.338,53	682.079,87	396.879,35	2,13%	1,20%	2,05%	4,43%	27,17%	3,51%
Abril	32.760.338,53	1.264.206,52	909.622,97	32.745.683,37	-369.238,71	27.640,64	-1,12%	0,08%	1,43%	5,92%	1,28%	2,86%
Mai	32.745.683,37	2.110.800,89	1.757.945,50	33.307.827,60	209.288,84	236.929,48	0,63%	0,71%	0,89%	6,87%	10,31%	2,78%
Junho	33.307.827,60	2.804.120,03	1.765.016,23	33.926.309,66	-420.621,74	-183.692,26	-1,22%	-0,52%	1,08%	8,02%	-6,54%	2,32%
Julho	33.926.309,66	5.830.477,60	5.431.305,21	34.789.676,12	464.194,07	280.501,81	1,35%	0,82%	-0,28%	7,72%	10,63%	1,91%
Agosto	34.789.676,12	2.335.544,56	1.902.789,08	35.602.604,00	380.172,40	660.674,21	1,08%	1,91%	0,08%	7,80%	24,46%	2,03%
Setembro	35.602.604,00	7.676.654,67	7.267.959,34	36.143.107,68	131.808,35	792.482,56	0,37%	2,28%	0,11%	7,92%	28,80%	1,89%
Outubro	36.143.107,68	4.552.506,78	4.454.706,91	36.897.423,00	656.515,45	1.448.998,01	1,81%	4,13%	0,98%	8,98%	46,06%	2,33%
Novembro	36.897.423,00	1.453.202,21	716.919,68	37.697.317,37	63.611,84	1.512.609,85	0,17%	4,31%	0,79%	9,84%	43,80%	2,92%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

ANO

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.121.053,86	0,00	0,00	7.197.354,48	76.300,62	1,07%	1,07%	0,06%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	3.406.695,23	375.000,00	0,00	3.820.443,66	38.748,43	1,02%	1,03%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	5.127.976,76	0,00	0,00	5.180.393,56	52.416,80	1,02%	1,02%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.235.174,91	0,00	0,00	2.255.775,42	20.600,51	0,92%	0,92%	0,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.815.874,08	0,00	52.194,23	1.776.899,69	13.219,84	0,73%	0,74%	0,87%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.017.611,98	0,00	30.855,56	994.141,37	7.384,95	0,73%	-2,31%	5,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL OPTIMUS FIC RENDA FIXA LP	1.660.773,52	0,00	0,00	1.671.646,40	10.872,88	0,65%	0,65%	0,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.766.661,63	0,00	0,00	1.775.147,91	8.486,28	0,48%	0,48%	0,61%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	487.424,75	677.071,64	633.869,89	535.088,30	4.461,80	0,38%	0,93%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	1.140.226,57	0,00	0,00	1.139.528,06	-698,51	-0,06%	-0,06%	1,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.066.915,03	0,00	0,00	1.063.194,32	-3.720,71	-0,35%	-0,35%	1,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	577.636,26	0,00	0,00	573.861,43	-3.774,83	-0,65%	-0,65%	1,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	705.671,42	0,00	0,00	697.229,70	-8.441,72	-1,20%	-1,20%	6,73%
BB IRF-M 1+ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	180.745,94	0,00	0,00	178.039,09	-2.706,85	-1,50%	-1,50%	4,87%
Total Renda Fixa	28.310.441,94	1.052.071,64	716.919,68	28.858.743,39	213.149,49	0,74%		0,69%

