

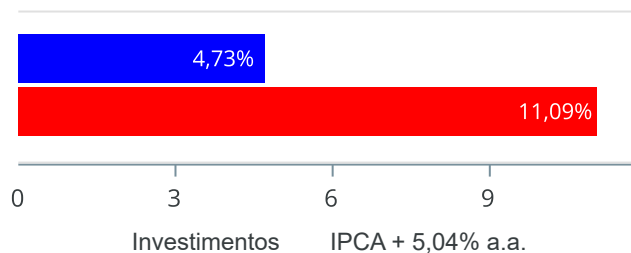


CRÉDITO
& MERCADO

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	131.306.293,14	9.933.284,78	5.744.613,04	135.480.633,23	-14.331,65	-14.331,65	-0,01%	-0,01%	0,95%	0,95%	-1,11%	3,01%
Fevereiro	135.480.633,23	4.121.284,78	7.066.503,93	132.647.892,79	112.478,71	98.147,06	0,08%	0,07%	1,39%	2,35%	3,08%	3,14%
Março	132.647.892,79	8.297.432,30	6.782.176,42	137.349.383,55	3.186.234,88	3.284.381,94	2,37%	2,45%	2,06%	4,46%	54,95%	3,84%
Abril	137.349.383,55	13.289.127,22	11.870.346,67	137.189.023,45	-1.579.140,65	1.705.241,29	-1,14%	1,28%	1,44%	5,96%	21,54%	3,17%
Mai	137.189.023,45	33.057.662,93	32.901.587,68	138.681.951,29	1.336.852,59	3.042.093,88	0,97%	2,27%	0,90%	6,91%	32,83%	5,31%
Junho	138.681.951,29	10.024.971,25	8.202.063,63	137.770.804,31	-2.734.054,60	308.039,28	-1,95%	0,28%	1,08%	8,07%	3,46%	3,58%
Julho	137.770.804,31	3.450.971,25	2.422.496,43	141.087.848,61	2.288.569,48	2.596.608,76	1,65%	1,93%	-0,27%	7,78%	24,85%	3,13%
Agosto	141.087.848,61	2.227.448,68	1.500.977,93	143.015.398,06	1.201.078,70	3.797.687,46	0,85%	2,80%	0,09%	7,87%	35,52%	3,42%
Setembro	143.015.398,06	626.619,62	4.269.906,17	138.913.411,36	-458.700,15	3.338.987,31	-0,32%	2,47%	0,12%	8,00%	30,83%	3,98%
Outubro	138.913.411,36	389.971,25	1.750.042,95	141.272.854,01	3.719.514,35	7.058.501,66	2,68%	5,21%	0,98%	9,06%	57,49%	4,63%
Novembro	141.272.854,01	21.244.637,73	19.154.374,08	142.894.908,82	-468.208,84	6.590.292,82	-0,33%	4,87%	0,80%	9,94%	48,97%	5,49%
Dezembro	142.894.908,82	5.031.662,22	5.002.711,70	142.737.883,89	-185.975,45	6.404.317,37	-0,13%	4,73%	1,05%	11,09%	42,63%	3,24%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



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

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.561.272,74	0,00	0,00	4.627.132,57	65.859,83	1,44%	1,44%	1,73%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.731.536,73	0,00	0,00	4.793.891,93	62.355,20	1,32%	1,32%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	11.802.543,71	0,00	0,00	11.948.180,37	145.636,66	1,23%	1,23%	1,30%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	3.230.012,55	0,00	0,00	3.269.418,89	39.406,34	1,22%	1,22%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.046.801,08	0,00	0,00	10.162.798,89	115.997,81	1,15%	1,15%	0,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	14.198.928,04	0,00	0,00	14.360.692,29	161.764,25	1,14%	1,14%	0,37%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	5.422.993,76	0,00	0,00	5.484.259,83	61.266,07	1,13%	1,13%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.379.205,35	83.108,22	0,00	1.476.910,13	14.596,56	1,00%	1,03%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	6.635.649,87	0,00	0,00	6.699.018,14	63.368,27	0,95%	0,95%	0,60%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.132.729,18	0,00	0,00	6.191.073,76	58.344,58	0,95%	0,95%	0,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	2.299.923,72	0,00	0,00	2.321.189,71	21.265,99	0,92%	0,92%	1,14%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	4.438.967,94	0,00	0,00	4.477.935,90	38.967,96	0,88%	0,88%	0,81%
TÍTULOS PÚBLICOS	14.142.463,79	0,00	0,00	14.262.577,64	120.113,85	0,85%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	461.572,11	444.000,00	342.400,00	567.821,30	4.649,19	0,51%	1,15%	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.895.415,99	0,00	0,00	2.905.103,32	9.687,33	0,33%	0,33%	1,17%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.654.410,72	0,00	0,00	1.659.856,88	5.446,16	0,33%	0,33%	0,74%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	449.375,22	0,00	0,00	449.972,16	596,94	0,13%	0,13%	0,45%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS PREMIUM FIC RENDA FIXA ...	3.117.171,58	4.504.554,00	4.454.741,53	3.173.710,21	6.726,16	0,09%	1,09%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.248.174,86	0,00	0,00	1.243.559,29	-4.615,57	-0,37%	-0,37%	1,53%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	3.353.600,36	0,00	0,00	3.340.386,51	-13.213,85	-0,39%	-	-



CRÉDITO
& MERCADO

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
Total Renda Fixa	102.202.749,30	5.031.662,22	4.797.141,53	103.415.489,72	978.219,73	0,95%		0,64%

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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.705.664,98	0,00	0,00	1.736.347,63	30.682,65	1,80%	1,80%	10,24%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	3.063.255,47	0,00	0,00	3.098.921,05	35.665,58	1,16%	1,16%	0,22%
SINGULARE FII - REIT11	485.610,11	0,00	205.570,17	283.306,93	3.266,99	0,67%	-40,14%	53,68%
LSH FIP MULTISTRATÉGIA	1.001.164,00	0,00	0,00	1.000.459,37	-704,63	-0,07%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.297.845,12	0,00	0,00	4.220.341,05	-77.504,07	-1,80%	-1,80%	8,16%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.657.927,20	0,00	0,00	2.602.470,90	-55.456,30	-2,09%	-2,09%	9,05%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.217.071,92	0,00	0,00	2.162.782,89	-54.289,03	-2,45%	-2,45%	8,84%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2.076.412,05	0,00	0,00	2.024.934,90	-51.477,15	-2,48%	-2,48%	10,05%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.548.358,29	0,00	0,00	4.404.276,59	-144.081,70	-3,17%	-3,17%	9,55%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.139.755,77	0,00	0,00	2.069.429,48	-70.326,29	-3,29%	-3,29%	12,59%
META VALOR FI AÇÕES	2.356.535,30	0,00	0,00	2.263.225,11	-93.310,19	-3,96%	-3,96%	12,39%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1.991.604,05	0,00	0,00	1.895.746,66	-95.857,39	-4,81%	-4,81%	8,32%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8.135.919,02	0,00	0,00	7.737.474,64	-398.444,38	-4,90%	-4,90%	8,34%
Total Renda Variável	36.677.123,28	0,00	205.570,17	35.499.717,20	-971.835,91	-2,65%		8,91%



CRÉDITO
& MERCADO

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
BB AÇÕES GLOBAIS INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL ...	1.762.698,25	0,00	0,00	1.678.305,18	-84.393,07	-4,79%	-4,79%	10,03%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.252.337,99	0,00	0,00	2.144.371,79	-107.966,20	-4,79%	-4,79%	10,61%
Total Exterior	4.015.036,24	0,00	0,00	3.822.676,97	-192.359,27	-4,79%		10,35%

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 CRÉDITO & MERCADO ENGENHARIA FINANCEIRA.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

