

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2022

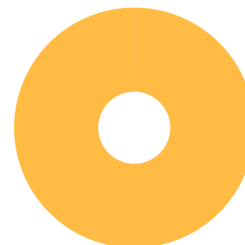
Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2022)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|--|---------|----------|-------------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | D+0 | Não há | 49.888,60 | 20,55% | 16.265 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | D+1002 | Não há | 80.716,33 | 33,24% | 12 | 3,39% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | D+1260 | 90 dias | 112.195,87 | 46,21% | 70 | 0,15% | Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 242.800,80 | | | | |

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 ' b ' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 11,01% | 55,04% | 68,80% | 167.046,95 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00% | 130.604,93 | 53,79% | 3,58% | 17,82% | 40,00% | -33.484,61 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' | 5,00% | 112.195,87 | 46,21% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | -100.055,83 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 242.800,80 | 100,00% | 14,59% | 77,86% | 113,80% | |



RENDA FIXA 242.800,80

⚠ ATENÇÃO! Limite cumulativo em desacordo com a Resolução!

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% | 0,00 | 0,00% | 3,69% | 18,45% | 20,00% | 48.560,16 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 3,07% | 3,07% | 10,00% | 24.280,08 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 6,76% | 21,52% | 30,00% | |

| Artigos - Exterior | Resolução | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2022 | | | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|-------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso II | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,31% | 5,00% | 12.140,04 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,31% | 5,00% | 12.140,04 |
| Total Exterior | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,62% | 10,00% | |



7º III a 7º V a

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2022)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| GRAPHEN INVESTIMENTOS | 112.195,87 | 46,21 | 0,02 |
| VERITAS CAPITAL MANAGEMENT | 80.716,33 | 33,24 | 0,00 |
| CAIXA DTVM | 49.888,60 | 20,55 | - |

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

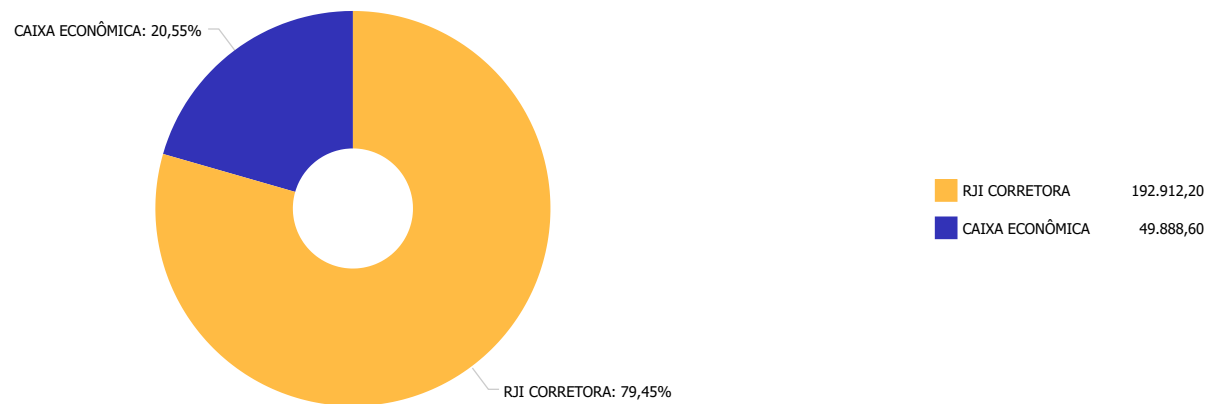
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2022 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira \$ | Carteira % | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 11,01 | 68,80 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 130.604,93 | 53,79 | 3,58 | 40,00 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a ' | 112.195,87 | 46,21 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 0,00 | 0,00 | 3,69 | 20,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 0,00 | 0,00 | 3,07 | 10,00 |

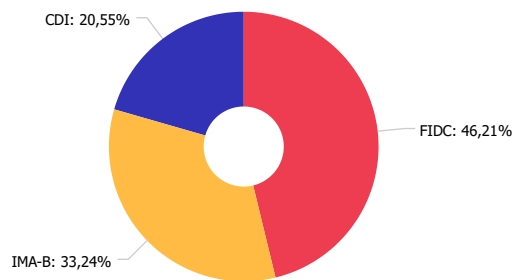
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2022 - RENDA FIXA

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|---------|--------|--------|---------|---------|---------|------------------|
| IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark) | 1,22% | 13,16% | 3,33% | 3,76% | 13,16% | 33,23% | - | - |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 0,19% | 3,39% | 0,43% | 0,68% | 3,39% | 2,55% | 0,24% | 0,01% |
| IMA-B (Benchmark) | -0,19% | 6,37% | 0,23% | 1,94% | 6,37% | 5,02% | - | - |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | -0,99% | -21,66% | -3,41% | -3,48% | -21,66% | -73,96% | 0,21% | 0,09% |
| CDI (Benchmark) | 1,12% | 12,37% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 17,31% | - | - |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,89% | 9,62% | 2,54% | 5,25% | 9,62% | 12,23% | 0,00% | 0,00% |

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



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

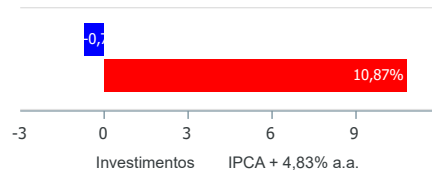


■ FIDC 112.195,87 ■ IMA-B 80.716,33 ■ CDI 49.888,60

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 | 518.343,62 | 50.611,65 | 193.776,04 | 376.968,28 | 1.789,05 | 1.789,05 | 0,35% | 0,35% | 0,94% | 0,94% | 36,88% | 0,68% |
| Fevereiro | 376.968,28 | 449.749,59 | 350.218,92 | 477.586,07 | 1.087,12 | 2.876,17 | 0,23% | 0,57% | 1,37% | 2,32% | 24,76% | 1,80% |
| Março | 477.586,07 | 102.599,28 | 274.539,69 | 306.918,76 | 1.273,10 | 4.149,27 | 0,27% | 0,84% | 2,04% | 4,41% | 19,12% | 2,64% |
| Abril | 306.918,76 | 129.614,88 | 146.361,52 | 291.360,47 | 1.188,35 | 5.337,62 | 0,39% | 1,23% | 1,42% | 5,89% | 20,93% | 3,35% |
| Mai | 291.360,47 | 131.175,02 | 191.664,15 | 230.811,75 | -59,59 | 5.278,03 | -0,02% | 1,21% | 0,88% | 6,82% | 17,76% | 0,30% |
| Junho | 230.811,75 | 119.804,90 | 146.647,84 | 199.155,61 | -4.813,20 | 464,83 | -2,09% | -0,90% | 1,07% | 7,96% | -11,28% | 3,84% |
| Julho | 199.155,61 | 121.579,51 | 114.224,80 | 206.191,99 | -318,33 | 146,50 | -0,15% | -1,05% | -0,29% | 7,65% | -13,74% | 0,22% |
| Agosto | 206.191,99 | 162.901,57 | 159.848,25 | 209.496,19 | 250,88 | 397,38 | 0,12% | -0,93% | 0,07% | 7,73% | -12,07% | 0,81% |
| Setembro | 209.496,19 | 204.651,81 | 221.061,80 | 193.246,92 | 160,72 | 558,10 | 0,04% | -0,89% | 0,10% | 7,84% | -11,41% | 1,89% |
| Outubro | 193.246,92 | 378.562,18 | 343.110,74 | 230.372,31 | 1.673,95 | 2.232,05 | 0,29% | -0,60% | 0,97% | 8,88% | -6,80% | 0,41% |
| Novembro | 230.372,31 | 143.175,55 | 161.384,42 | 212.022,04 | -141,40 | 2.090,65 | -0,06% | -0,67% | 0,79% | 9,74% | -6,83% | 0,15% |
| Dezembro | 212.022,04 | 327.498,35 | 296.553,42 | 242.800,80 | -166,17 | 1.924,48 | -0,03% | -0,70% | 1,04% | 10,87% | -6,40% | 0,18% |

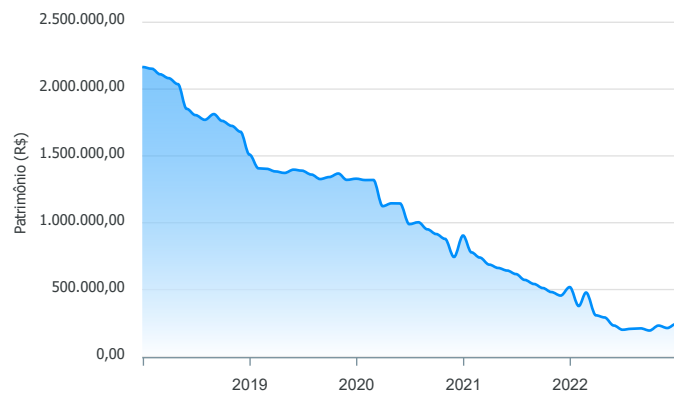
Investimentos x Meta de Rentabilidade



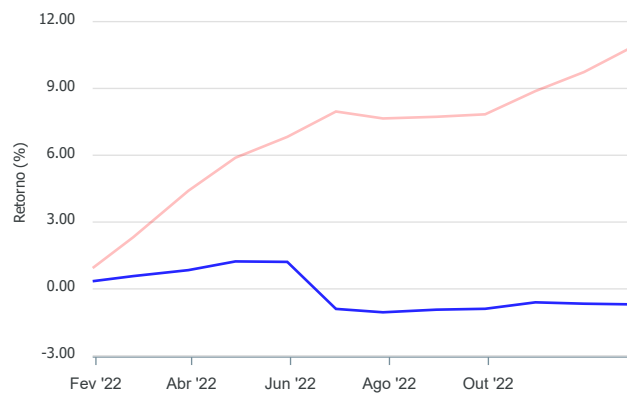
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- 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 |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|----------------|---------------|------------|--------------|
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 111.986,50 | 0,00 | 0,00 | 112.195,87 | 209,37 | 0,19% | 0,19% | 0,24% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 18.514,46 | 327.498,35 | 296.553,42 | 49.888,60 | 429,21 | 0,12% | 0,89% | 0,00% |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | 81.521,08 | 0,00 | 0,00 | 80.716,33 | -804,75 | -0,99% | -0,99% | 0,21% |
| Total Renda Fixa | 212.022,04 | 327.498,35 | 296.553,42 | 242.800,80 | -166,17 | -0,07% | | 0,18% |

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

| Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|--|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| Total Renda Variável | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00% | | 0,00% |

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 |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-----------------|--------------|------------|
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 16,73 | 653.348,93 | 604.677,28 | 49.888,60 | 1.200,22 | 0,18% | 2,54% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 111.685,25 | 0,00 | 0,00 | 112.195,87 | 510,62 | 0,46% | 0,43% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 0,00 | 195.887,15 | 196.371,30 | 0,00 | 484,15 | 0,25% | 3,09% |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | 81.544,94 | 0,00 | 0,00 | 80.716,33 | -828,61 | -1,02% | -3,41% |
| Total Renda Fixa | 193.246,92 | 849.236,08 | 801.048,58 | 242.800,80 | 1.366,38 | 0,57% | |

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 |
|---|-------------------|---------------------|---------------------|-------------------|-----------------|--------------|------------|
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 114.758,74 | 2.038.978,46 | 2.111.130,48 | 49.888,60 | 7.281,88 | 0,34% | 9,61% |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 | 108.557,51 | 0,00 | 0,00 | 112.195,87 | 3.638,36 | 3,35% | 3,39% |
| CAIXA BRASILATIVA FIC RENDA FIXA LP | 101.583,70 | 0,00 | 103.849,42 | 0,00 | 2.265,72 | 2,23% | 10,77% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 0,00 | 200.945,83 | 201.508,54 | 0,00 | 562,71 | 0,28% | 11,74% |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA | 30.584,77 | 82.000,00 | 112.844,12 | 0,00 | 259,35 | 0,23% | 10,70% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 59.820,76 | 0,00 | 59.903,25 | 0,00 | 82,49 | 0,14% | 9,04% |
| IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP | 103.038,14 | 0,00 | 10.155,78 | 80.716,33 | -12.166,03 | -11,81% | -21,66% |
| Total Renda Fixa | 518.343,62 | 2.321.924,29 | 2.599.391,59 | 242.800,80 | 1.924,48 | 0,07% | |

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 |
|-----------------------|----------------|------------|----------|-------------|---------------|-------------|------------|
| Total Renda Variável | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 0,00% | |

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

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

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

