

# 2022

## Relatório Mensal, 4º trimestre e ano de 2022

# Dezembro

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.710.685,38	3,82%	160.999.611,99	6,03%	7º I b
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.572.381,99	5,74%	6.757.838.619,84	0,22%	7º I b
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	27.040.296,61	10,64%	5.613.586.065,55	0,48%	7º I b
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.696.537,96	11,29%	830.239.076,41	3,46%	7º I b
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.728.146,88	2,25%	6.078.064.149,48	0,09%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.205.063,80	2,05%	3.745.902.538,43	0,14%	7º I b
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	153.839,33	0,06%	2.756.777.028,75	0,01%	7º I b
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.022.783,41	0,40%	3.280.425.458,25	0,03%	7º I b
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.450.436,61	0,57%	474.505.817,58	0,31%	7º I b
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.089.063,40	3,58%	5.292.657.963,96	0,17%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.773.900,87	7,39%	7.960.289.495,76	0,24%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.105.091,57	6,34%	1.062.055.943,18	1,52%	7º I b
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.654.267,46	4,59%	3.466.339.701,42	0,34%	7º I b
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.351.595,48	2,11%	158.129.265,66	3,38%	7º III a
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.421.090,45	3,31%	181.768.415,38	4,63%	7º III a
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	16.171.040,33	6,36%	3.275.697.229,55	0,49%	7º III a
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.536.057,65	0,60%	1.439.263.085,26	0,11%	8º I
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.652.501,68	3,01%	1.373.628.350,10	0,56%	8º I
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	5.116.390,68	2,01%	250.169.538,18	2,05%	8º I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.814.418,62	1,11%	844.496.837,07	0,33%	8º I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.593.017,49	1,41%	638.491.745,31	0,56%	8º I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.234.574,19	2,45%	479.558.546,97	1,30%	8º I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	240.311,22	0,09%	233.749.193,12	0,10%	8º I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.413.929,54	6,85%	898.333.019,26	1,94%	8º I
OCCAM FIC AÇÕES	904.248,79	0,36%	1.040.644.939,99	0,09%	8º I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	854.602,49	0,34%	343.144.362,04	0,25%	8º I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.462.580,00	0,97%	1.260.030.924,47	0,20%	8º I

**Investimentos**


\$ 254.077.722,72

**Disponibilidades Financeiras**

\$ 412.693,31

**Total Carteira**

\$ 254.490.416,03


**Governança (Pró Gestão)**
 Não possui

Ativo	Saldo Atual	% Carteira	PL R\$	% PL	Lei
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.446.837,02	2,14%	416.194.949,01	1,31%	9º III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.624.331,24	4,97%	1.938.590.167,99	0,65%	9º III
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.006.650,82	0,79%	206.688.562,79	0,97%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.045.500,21	0,81%	128.998.626,49	1,59%	10º I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	770.123,37	0,30%	161.319.375,60	0,48%	10º I
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.410.286,18	0,95%	37.821.176,20	6,37%	10º I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	805.140,00	0,32%	99.272.880,00	0,81%	11º


Investimentos

 254.077.722,72


Disponibilidades Financeiras

 412.693,31

Total Carteira

 254.490.416,03

Governança (Pró Gestão)

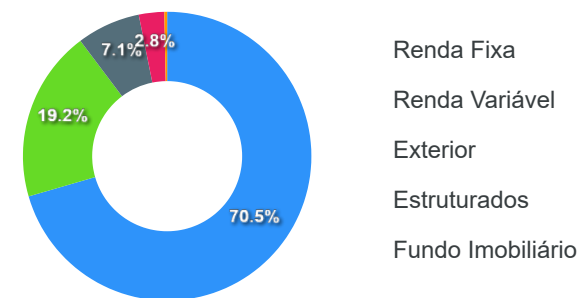
 Não possui

Artigos	Limite (%)	Utilizado	Livre
7º I b - FI 100% Títulos TN	100,00%	58,72%	149.202.495,27 41,28%
7º III a - FI Referenciados RF	60,00%	11,79%	29.943.726,26 48,21%
8º I - Fundos de Ações	30,00%	19,22%	48.822.632,35 10,78%
9º III - Ações - BDR Nível I	10,00%	7,11%	18.071.168,26 2,89%
10º I - Fundos Multimercados	10,00%	2,85%	7.232.560,58 7,15%
11º - Fundos Imobiliários	5,00%	0,31%	805.140,00 4,68%

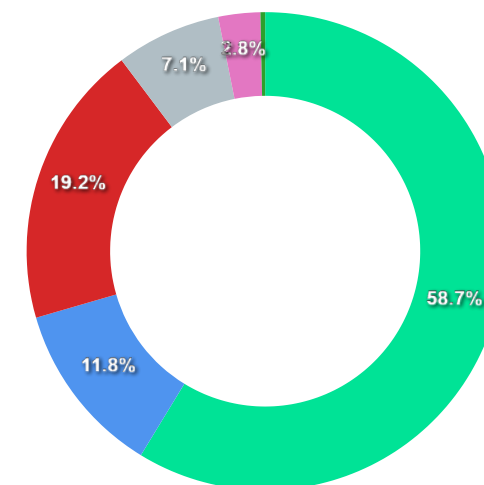
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos



Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
7° I a - Títulos TN SELIC	0,00%	0,00%	10,00%	100,00%	254.077.722,72
7° I b - FI 100% Títulos TN	58,72%	0,00%	40,00%	100,00%	104.875.227,45
7° III a - FI Referenciados RF	11,79%	0,00%	10,00%	60,00%	122.502.907,37

Artigos	Atual	Inferior	Alvo	Superior	GAP Superior
8° I - Fundos de Ações	19,22%	0,00%	26,00%	30,00%	27.400.684,47
9° III - Ações - BDR Nível I	7,11%	0,00%	10,00%	10,00%	7.336.604,01
10° I - Fundos Multimercados	2,85%	0,00%	3,00%	10,00%	18.175.211,69
11° - Fundos Imobiliários	0,32%	0,00%	1,00%	5,00%	11.898.746,14

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>NÃO DEFINIDO - BENCHMARK</b>								
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1,48		0,85				1,74	3,67
<b>CDI - BENCHMARK</b>								
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,11	12,94	3,24	6,84	12,94	19,15	0,03	0,06
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,10	12,11	3,14	6,49	12,11	16,71	0,00	0,00
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,91	11,53	2,73	5,98	11,53	12,52	0,33	0,68
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	-4,10						9,64	20,31
<b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>								
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-3,97	-13,07	9,26	3,01	-13,07	4,84	6,70	14,11
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-4,79	-28,54	3,52	-0,98	-28,54	-6,74	10,61	22,34
<b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>								
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-4,77	14,80	-4,99	19,02	14,80	33,76	12,48	26,29
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-2,28	4,93	-0,16	11,41	4,93	-7,78	9,50	20,01
OCCAM FIC AÇÕES	-2,66	4,52	-1,55	8,90	4,52	-8,80	7,17	15,10
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	-2,44	3,80	-0,34	10,97	3,80	-9,36	9,66	20,34
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-2,62	2,43	-1,12	9,89	2,43	-9,39	10,03	21,13
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-2,08	0,10	-1,60	10,01	0,10	-10,58	9,44	19,89
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-3,65	-1,79	-4,24	6,84	-1,79	-16,98	10,34	21,78
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,03	-4,57	-3,90	9,85	-4,57	-34,78	9,06	19,09
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	-0,54		-1,69	0,54			2,75	5,80
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-0,11		1,24	6,73			3,13	6,59
<b>IBX - BENCHMARK</b>								
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,80	-8,69	-3,58	3,72	-8,69	-17,52	8,16	17,19

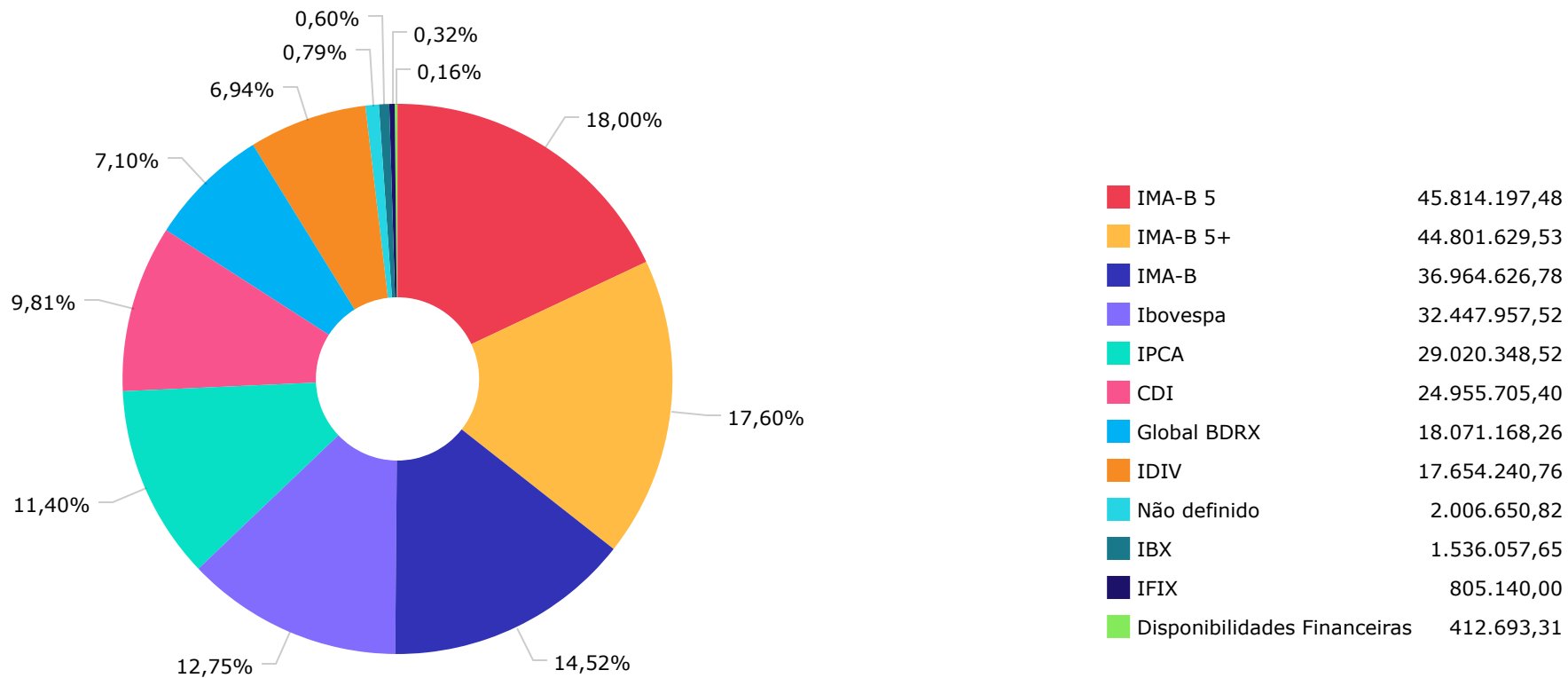
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
<b>IDIV - BENCHMARK</b>	<b>-1,61</b>	<b>12,65</b>	<b>3,15</b>	<b>7,71</b>	<b>12,65</b>	<b>5,43</b>		
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,57	11,43	2,90	7,09	11,43	1,01	8,13	17,13
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-2,42	8,49	0,12	7,07	8,49	-2,90	8,91	18,77
<b>IMA-B - BENCHMARK</b>	<b>-0,19</b>	<b>6,37</b>	<b>0,23</b>	<b>1,94</b>	<b>6,37</b>	<b>5,02</b>		
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	-0,25	6,25	0,15	1,96	6,25	0,03	2,40	5,06
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,24	6,19	0,10	1,86	6,19	4,57	2,52	5,30
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,22	6,09	0,17	1,80	6,09	4,49	2,47	5,20
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,13	5,66	0,24	2,00	5,66	-1,90	2,48	5,22
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32	3,10	2,70	-0,16	3,10	0,83	0,99	2,08
<b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>	<b>0,94</b>	<b>9,78</b>	<b>2,53</b>	<b>2,98</b>	<b>9,78</b>	<b>14,79</b>		
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	2,41
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91	9,51	2,44	2,86	9,51	14,19	1,14	2,41
<b>IMA-B 5+ - BENCHMARK</b>	<b>-1,19</b>	<b>3,30</b>	<b>-1,72</b>	<b>1,24</b>	<b>3,30</b>	<b>-3,47</b>		
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,23	3,06	-1,79	1,09	3,06	-4,16	3,81	8,03
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,19	2,95	-1,79	1,07	2,95	-4,03	3,82	8,04
<b>IPCA - BENCHMARK</b>	<b>0,62</b>	<b>5,78</b>	<b>1,63</b>	<b>0,28</b>	<b>5,78</b>	<b>16,43</b>		
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95	11,41	3,98	4,00	11,41	16,36	0,60	1,26
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,14	10,70	2,23	5,84	10,70	10,58	0,37	0,78
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77	9,30	1,67	4,80	9,30	9,89	1,26	2,65
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32		2,71	2,69			0,99	2,08
<b>IFIX - BENCHMARK</b>	<b>0,00</b>	<b>2,22</b>	<b>-4,14</b>	<b>2,56</b>	<b>2,22</b>	<b>-0,11</b>		

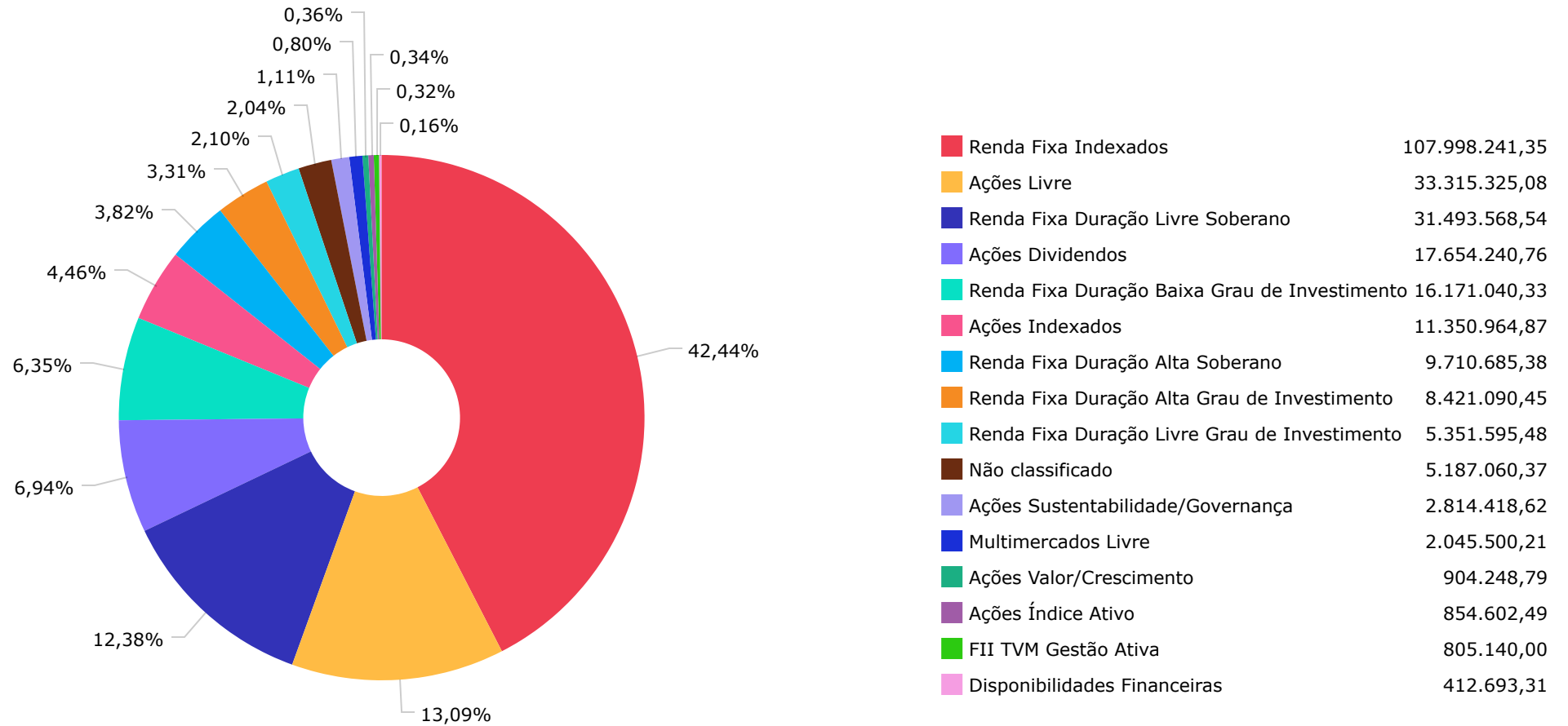
---

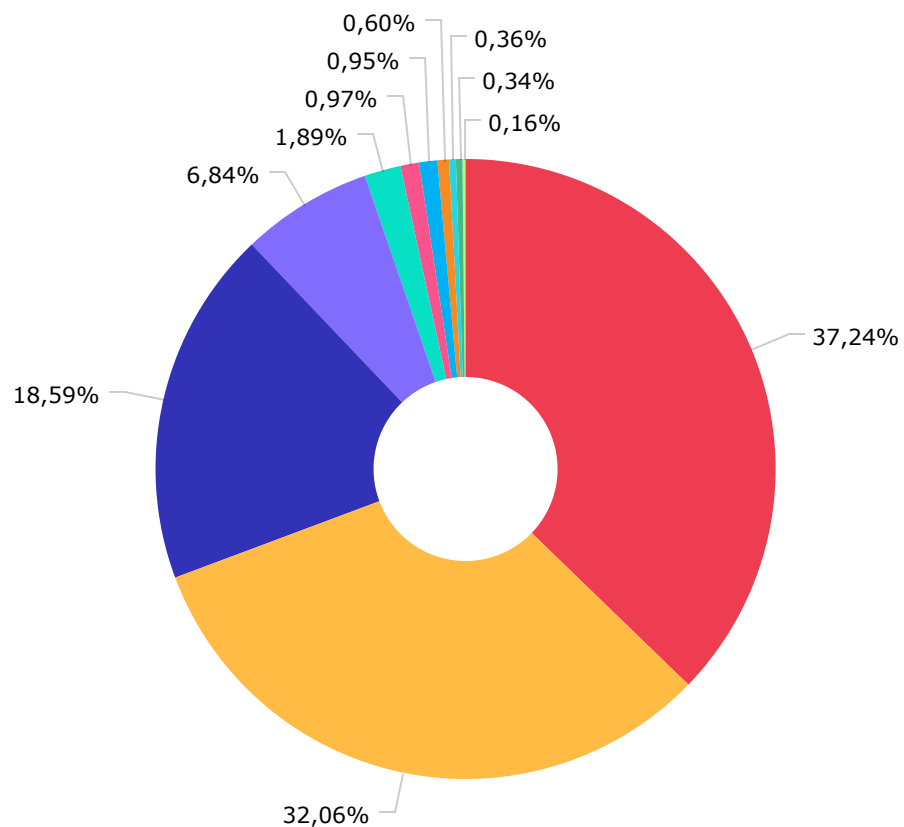
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-8,67	-7,68	-9,91	-0,44	-7,68	-53,96	14,39	30,30

---

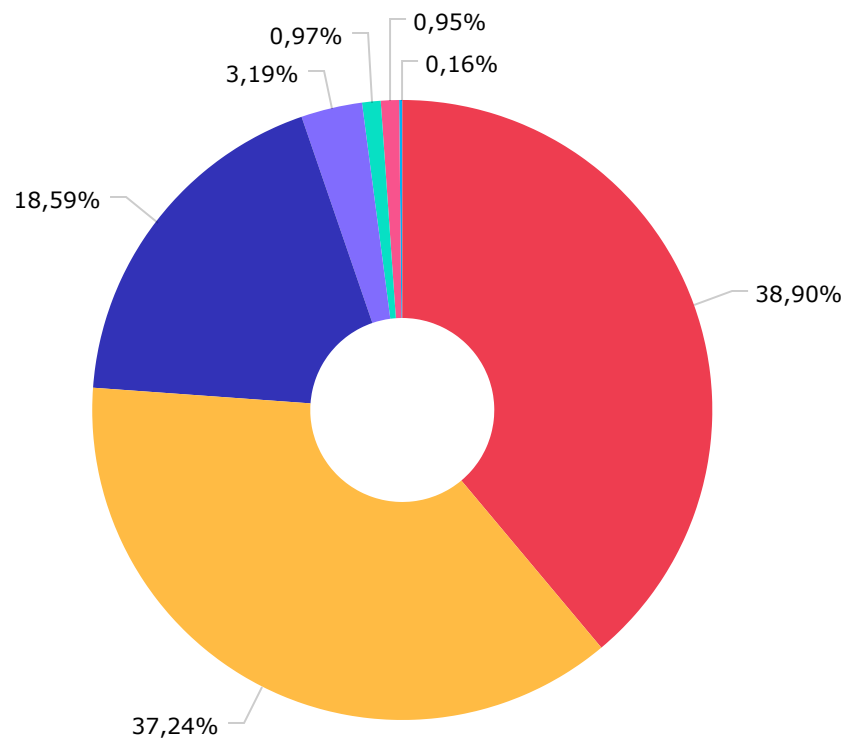








BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	94.773.912,89
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	81.592.917,46
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITU...	47.306.913,32
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECU...	17.413.929,54
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	4.822.274,40
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA	2.462.580,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	2.410.286,18
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.	1.536.057,65
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSO...	904.248,79
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.	854.602,49
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	412.693,31



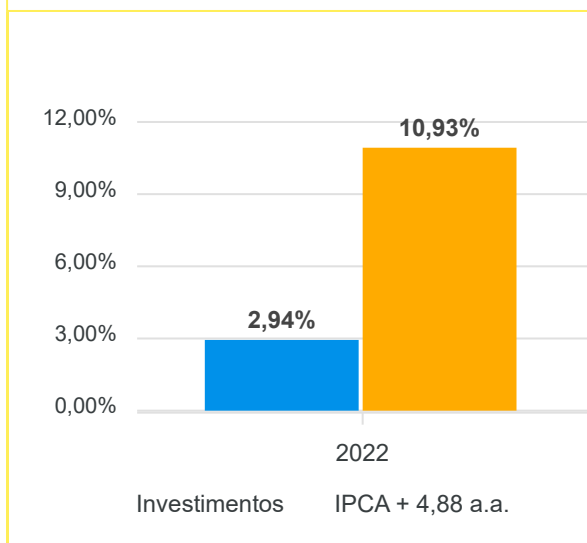
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	99.006.847,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...	94.773.912,89
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO...	47.306.913,32
BEM DTVM	8.117.183,33
BANCO DAYCOVAL S.A.	2.462.580,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.	2.410.286,18
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	412.693,31

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno Acumulado \$	Retorno %	Retorno Acumulado %	Meta %	Meta Acumulado %	Meta x Retorno Acumulado %	Risco - VaR
Janeiro	232.069.557,82	4.607.647,27	6.757.029,00	230.155.645,41	235.469,32	235.469,32	0,10% ▲	0,10%	0,94%	0,94%	10,64%	4,49%
Fevereiro	230.155.645,41	7.000.000,00	5.006.517,80	231.302.578,54	-846.549,07	-611.079,75	-0,36% ▼	-0,26%	1,37%	2,33%	-11,16%	3,96%
Março	231.302.578,54	7.233.576,52	5.412.495,27	240.168.733,78	7.045.073,99	6.433.994,24	3,02% ▲	2,75%	2,04%	4,42%	62,22%	5,09%
Abril	240.168.733,78	4.597.513,48	836.517,80	238.819.569,69	-5.110.159,77	1.323.834,47	-2,09% ▼	0,60%	1,42%	5,90%	10,17%	3,36%
Mai	238.819.569,69	3.160.000,00	1.747.953,86	242.416.371,77	2.184.755,94	3.508.590,41	0,91% ▲	1,51%	0,89%	6,85%	22,04%	4,40%
Junho	242.416.371,77	2.000.000,00	2.000.000,00	236.514.523,13	-5.901.848,64	-2.393.258,23	-2,43% ▼	-0,96%	1,07%	7,99%	-12,02%	4,26%
Julho	236.514.523,13	5.634.700,00	2.600.000,00	242.621.826,20	3.072.603,07	679.344,84	1,28% ▲	0,31%	-0,28%	7,68%	4,04%	3,98%
Agosto	242.621.826,20	2.048.106,28	1.214.471,12	247.312.434,17	3.856.972,81	4.536.317,65	1,58% ▲	1,90%	0,07%	7,76%	24,48%	4,55%
Setembro	247.312.434,17	3.045.000,00	2.000.000,30	248.884.544,12	527.110,25	5.063.427,90	0,21% ▲	2,12%	0,11%	7,88%	26,90%	4,29%
Outubro	248.884.544,12	4.295.468,00	5.568.495,17	253.850.773,68	6.239.256,73	11.302.684,63	2,51% ▲	4,68%	0,97%	8,92%	52,47%	4,88%
Novembro	253.850.773,68	4.629.947,83	1.121.446,06	255.029.331,34	-2.329.944,11	8.972.740,52	-0,91% ▼	3,73%	0,79%	9,79%	38,10%	6,53%
Dezembro	255.029.331,34	15.401.805,78	14.396.568,09	254.077.722,72	-1.956.846,31	7.015.894,21	-0,76% ▼	2,94%	1,04%	10,93%	26,90%	4,00%

Retorno Acumulado (Períodos)

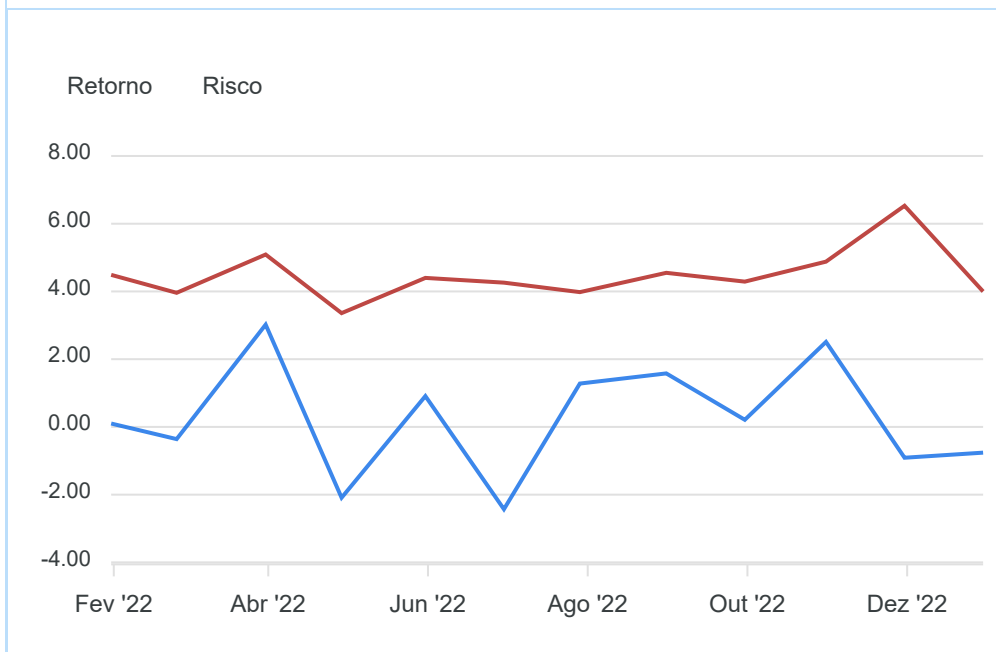
Período	Retorno \$	Retorno %	Meta %
1º Trim	6.433.994,24	2,75%	4,42%
2º Trim	-8.827.252,47	-3,61%	3,42%
1º Sem	-2.393.258,23	-0,96%	7,99%
3º Trim	7.456.686,13	3,11%	-0,10%
4º Trim	1.952.466,31	0,80%	2,83%
2º Sem	9.409.152,44	3,93%	2,72%

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

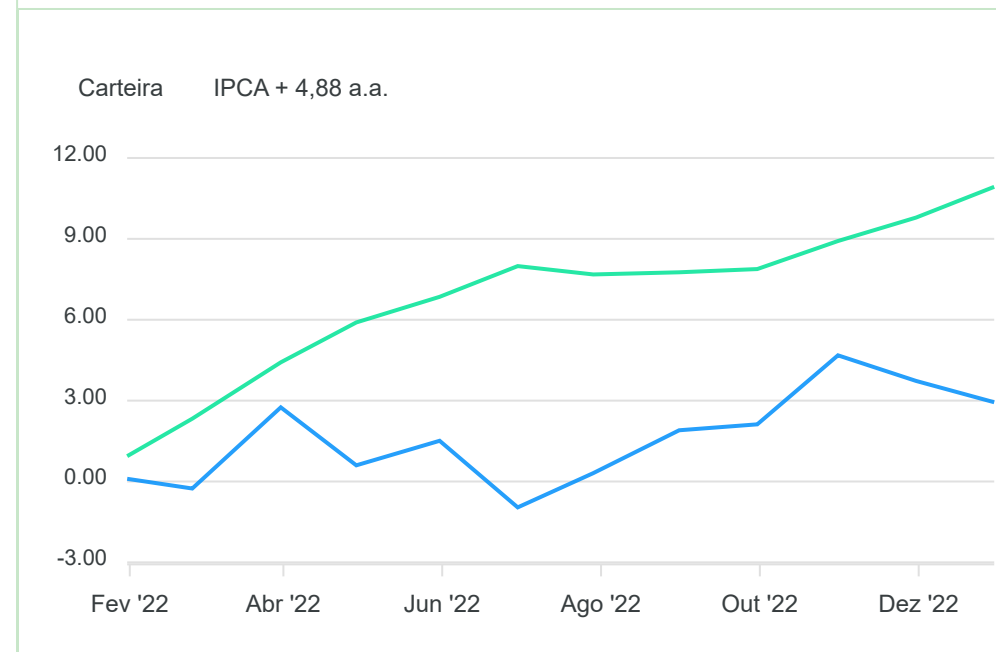


**Gráficos**

**Gráfico Risco x Retorno**



**Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade**



RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.303.577,48	0,00	0,00	5.351.595,48	48.018,00	0,91% ▲	0,33%
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.723.658,18	0,00	0,00	9.710.685,38	-12.972,80	-0,13% ▼	2,48%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.441.783,18	0,00	0,00	8.421.090,45	-20.692,73	-0,25% ▼	2,40%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.994.739,22	1.005.237,69	0,00	16.171.040,33	171.063,42	1,07% ▲	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.452.355,16	0,00	14.396.568,09	0,00	-55.787,07	-0,39% ▼	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	26.795.450,86	0,00	0,00	27.040.296,61	244.845,75	0,91% ▲	1,14%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.041.879,23	0,00	0,00	28.696.537,96	-345.341,27	-1,19% ▼	3,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.740.667,25	0,00	0,00	5.728.146,88	-12.520,37	-0,22% ▼	2,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.155.827,35	0,00	0,00	5.205.063,80	49.236,45	0,95% ▲	0,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	151.836,29	0,00	0,00	153.839,33	2.003,04	1,32% ▲	0,99%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.011.630,60	0,00	0,00	1.022.783,41	11.152,81	1,10% ▲	0,00%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.431.570,46	0,00	0,00	1.450.436,61	18.866,15	1,32% ▲	0,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.986.680,76	0,00	0,00	9.089.063,40	102.382,64	1,14% ▲	0,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.602.376,74	0,00	0,00	18.773.900,87	171.524,13	0,92% ▲	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.306.115,82	0,00	0,00	16.105.091,57	-201.024,25	-1,23% ▼	3,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.681.936,44	0,00	0,00	11.654.267,46	-27.668,98	-0,24% ▼	2,52%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	14.396.568,09	0,00	14.572.381,99	175.813,90	1,22% ▲	1,26%
	177.822.085,02	15.401.805,78	14.396.568,09	179.146.221,53	318.898,82	0,18%	1,90%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.564.266,44	0,00	0,00	1.536.057,65	-28.208,79	-1,80% ▼	8,16%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.891.610,25	0,00	0,00	7.652.501,68	-239.108,57	-3,03% ▼	9,06%
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	5.244.084,54	0,00	0,00	5.116.390,68	-127.693,86	-2,44% ▼	9,66%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.890.221,54	0,00	0,00	2.814.418,62	-75.802,92	-2,62% ▼	10,03%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.729.167,83	0,00	0,00	3.593.017,49	-136.150,34	-3,65% ▼	10,34%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.380.179,15	0,00	0,00	6.234.574,19	-145.604,96	-2,28% ▼	9,50%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	244.152,91	0,00	0,00	240.311,22	-3.841,69	-1,57% ▼	8,13%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.846.655,74	0,00	0,00	17.413.929,54	-432.726,20	-2,42% ▼	8,91%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	881.564,40	0,00	0,00	805.140,00	-76.424,40	-8,67% ▼	14,39%
OCCAM FIC AÇÕES	928.981,52	0,00	0,00	904.248,79	-24.732,73	-2,66% ▼	7,17%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.977.465,68	0,00	0,00	2.006.650,82	29.185,14	1,48% ▲	1,74%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.047.825,20	0,00	0,00	2.045.500,21	-2.324,99	-0,11% ▼	3,13%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	774.289,35	0,00	0,00	770.123,37	-4.165,98	-0,54% ▼	2,75%
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	2.416.502,18	0,00	0,00	2.410.286,18	-6.216,00	-0,26% ▼	9,64%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	872.731,02	0,00	0,00	854.602,49	-18.128,53	-2,08% ▼	9,44%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.585.815,65	0,00	0,00	2.462.580,00	-123.235,65	-4,77% ▼	12,48%
-	58.275.513,40	0,00	0,00	56.860.332,93	-1.415.180,47	-2,43%	8,88%



INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %	Risco - VaR
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	5.671.783,77	0,00	0,00	5.446.837,02	-224.946,75	-3,97% ▼	6,70%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	13.259.949,15	0,00	0,00	12.624.331,24	-635.617,91	-4,79% ▼	10,61%
	18.931.732,92	0,00	0,00	18.071.168,26	-860.564,66	-4,55%	2,02%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	5.209.596,45	0,00	0,00	5.351.595,48	141.999,03	2,73% ▲
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.687.149,04	0,00	0,00	9.710.685,38	23.536,34	0,24% ▲
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.408.633,07	0,00	0,00	8.421.090,45	12.457,38	0,15% ▲
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	10.855.601,50	7.279.207,46	2.400.000,00	16.171.040,33	436.231,37	2,41% ▲
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.319.374,91	0,00	14.396.568,09	0,00	77.193,18	0,54% ▲
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	14.396.568,09	0,00	14.572.381,99	175.813,90	1,22% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	26.395.476,35	0,00	0,00	27.040.296,61	644.820,26	2,44% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.219.898,31	0,00	0,00	28.696.537,96	-523.360,35	-1,79% ▼
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.718.685,64	0,00	0,00	5.728.146,88	9.461,24	0,17% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.153.348,47	0,00	151.446,06	5.205.063,80	203.161,39	3,94% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	151.446,06	0,00	153.839,33	2.393,27	1,58% ▲
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	991.657,54	0,00	0,00	1.022.783,41	31.125,87	3,14% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.412.259,13	0,00	0,00	1.450.436,61	38.177,48	2,70% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	8.891.193,24	0,00	0,00	9.089.063,40	197.870,16	2,23% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.323.831,22	0,00	0,00	18.773.900,87	450.069,65	2,46% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.398.271,99	0,00	0,00	16.105.091,57	-293.180,42	-1,79% ▼
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.642.384,09	0,00	0,00	11.654.267,46	11.883,37	0,10% ▲
	172.627.360,95	21.827.221,61	16.948.014,15	179.146.221,53	1.639.653,12	0,92%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.593.124,99	0,00	0,00	1.536.057,65	-57.067,34	-3,58% ▼
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.962.823,37	0,00	0,00	7.652.501,68	-310.321,69	-3,90% ▼
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	5.134.039,51	0,00	0,00	5.116.390,68	-17.648,83	-0,34% ▼
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.846.259,65	0,00	0,00	2.814.418,62	-31.841,03	-1,12% ▼
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.752.010,39	0,00	0,00	3.593.017,49	-158.992,90	-4,24% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	6.244.328,29	0,00	0,00	6.234.574,19	-9.754,10	-0,16% ▼
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	233.542,31	0,00	0,00	240.311,22	6.768,91	2,90% ▲
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	2.056.503,51	0,00	2.315.589,62	0,00	259.086,11	12,60% ▲
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	17.392.354,50	0,00	0,00	17.413.929,54	21.575,04	0,12% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.795.232,28	0,00	1.822.905,55	0,00	27.673,27	1,54% ▲
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	893.705,40	0,00	0,00	805.140,00	-88.565,40	-9,91% ▼
OCCAM FIC AÇÕES	918.531,65	0,00	0,00	904.248,79	-14.282,86	-1,55% ▼
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	1.989.682,10	0,00	0,00	2.006.650,82	16.968,72	0,85% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	2.020.509,36	0,00	0,00	2.045.500,21	24.990,85	1,24% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	783.338,22	0,00	0,00	770.123,37	-13.214,85	-1,69% ▼
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.410.286,18	-89.713,82	-3,59% ▼
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	868.493,29	0,00	0,00	854.602,49	-13.890,80	-1,60% ▼
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.592.023,64	0,00	0,00	2.462.580,00	-129.443,64	-4,99% ▼
	<b>59.076.502,46</b>	<b>2.500.000,00</b>	<b>4.138.495,17</b>	<b>56.860.332,93</b>	<b>-577.674,36</b>	<b>-0,98%</b>

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.985.386,01	0,00	0,00	5.446.837,02	461.451,01	9,26% ▲
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	12.195.294,70	0,00	0,00	12.624.331,24	429.036,54	3,52% ▲
	17.180.680,71	0,00	0,00	18.071.168,26	890.487,55	5,18%

RENDA FIXA	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	4.798.445,94	0,00	0,00	5.351.595,48	553.149,54	11,53% ▲
BANESTES IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.190.856,86	0,00	0,00	9.710.685,38	519.828,52	5,66% ▲
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	7.925.555,27	0,00	0,00	8.421.090,45	495.535,18	6,25% ▲
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.812.321,88	19.719.099,57	9.354.000,00	16.171.040,33	993.618,88	4,05% ▲
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.421.820,17	0,00	16.396.568,09	0,00	974.747,92	6,32% ▲
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	14.396.568,09	0,00	14.572.381,99	175.813,90	1,22% ▲
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	22.695.545,37	2.000.000,00	0,00	27.040.296,61	2.344.751,24	9,49% ▲
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.875.413,99	0,00	0,00	28.696.537,96	821.123,97	2,95% ▲
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.425.684,40	0,00	5.000.000,00	5.728.146,88	302.462,48	2,90% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	299.399,92	5.205.063,80	504.463,72	10,09% ▲
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	151.446,06	0,00	153.839,33	2.393,27	1,58% ▲
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	912.289,91	0,00	0,00	1.022.783,41	110.493,50	12,11% ▲
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.406.803,37	0,00	40.471,12	1.450.436,61	84.104,36	5,98% ▲
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	12.115.692,94	0,00	4.000.000,00	9.089.063,40	973.370,46	8,03% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.523.959,52	5.727.886,70	0,00	18.773.900,87	1.522.054,65	8,82% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.627.346,10	0,00	0,00	16.105.091,57	477.745,47	3,06% ▲
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.974.418,12	0,00	0,00	11.654.267,46	679.849,34	6,19% ▲
	155.706.153,84	46.995.000,42	35.090.439,13	179.146.221,53	11.535.506,40	6,88%

RENDA VARIÁVEL	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.682.321,38	0,00	0,00	1.536.057,65	-146.263,73	-8,69% ▼
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.019.376,87	0,00	0,00	7.652.501,68	-366.875,19	-4,57% ▼
BB BOLSA BRASILEIRA FIC AÇÕES	0,00	5.405.977,47	0,00	5.116.390,68	-289.586,79	-5,36% ▼
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4.860.177,42	0,00	2.000.000,00	2.814.418,62	-45.758,80	-0,94% ▼
BB INDEXADO IBRX I FIC AÇÕES	4.888.024,43	0,00	5.405.977,47	0,00	517.953,04	10,60% ▲
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.658.532,72	0,00	0,00	3.593.017,49	-65.515,23	-1,79% ▼
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	5.941.559,14	0,00	0,00	6.234.574,19	293.015,05	4,93% ▲
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	215.660,23	0,00	0,00	240.311,22	24.650,99	11,43% ▲
CAIXA ELETROBRAS FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	2.315.589,62	0,00	315.589,62	15,78% ▲
CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	16.050.766,69	0,00	0,00	17.413.929,54	1.363.162,85	8,49% ▲
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	4.524.124,12	0,00	3.822.905,85	0,00	-701.218,27	-15,50% ▼
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	872.107,20	0,00	26.582,40	805.140,00	-40.384,80	-4,63% ▼
OCCAM FIC AÇÕES	865.140,86	0,00	0,00	904.248,79	39.107,93	4,52% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.006.650,82	6.650,82	0,33% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	0,00	2.002.787,27	0,00	2.045.500,21	42.712,94	2,13% ▲
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,00	750.000,00	0,00	770.123,37	20.123,37	2,68% ▲
SAFRA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.410.286,18	-89.713,82	-3,59% ▼
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	853.717,99	0,00	0,00	854.602,49	884,50	0,10% ▲
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.462.580,00	462.580,00	23,13% ▲
	52.431.509,05	16.658.764,74	13.571.055,34	56.860.332,93	1.341.114,48	2,42%

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno \$	Retorno %
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	6.265.894,86	0,00	0,00	5.446.837,02	-819.057,84	-13,07% ▼
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	17.666.000,07	0,00	0,00	12.624.331,24	-5.041.668,83	-28,54% ▼
	23.931.894,93	0,00	0,00	18.071.168,26	-5.860.726,67	-24,49%

## Cenário Econômico

Com certeza 2022 foi um ano muito difícil e desafiador para as economias globais. A inflação tornou-se um fenômeno global, em boa parte causada pelo "despejo" de recursos realizados pelos principais bancos centrais do mundo, para combater os efeitos da pandemia de Covid 19 e por conta do desarranjo das cadeias de suprimentos ao redor mundo. Além disso o conflito entre a Rússia e Ucrânia, trouxe pressão nos preços dos combustíveis e alimentos no mundo, principalmente nos países europeus. Para combater a inflação foi preciso um remédio amargo, a adoção de política monetárias recessivas, principalmente com a elevação da taxa de juros das principais economias, e o reflexo das incertezas, viera no desempenho dos principais índices no mundo, que apresentaram rentabilidade negativa.

No Brasil, o crescimento da economia, saiu muito melhor do que era esperado. As previsões no início do ano apontavam para um crescimento pequeno ou próximo da estabilidade e os números do PIB brasileiro ao longo de 2022, surpreenderam positivamente e a economia deve fechar o ano, com crescimento superior aos 3%. Por outro lado, a inflação também pesou aqui, o BACEN teve que agir forte, subindo a taxa de juros para 13,75%, deixando o Brasil como o país que possui maior taxa real de juros no mundo e uma mudança nesse cenário vai depender de sinais mais claros dos rumos da política fiscal e da economia em 2023.

Outro assunto presente no Brasil ao longo de 2022, foi a questão fiscal, que gerou muitas incertezas no mercado no decorrer deste ano. Logo no início foi aprovada a PEC dos precatórios, conhecida como PEC do calote, que abria espaço para o adiamento dos pagamentos de dívidas da União reconhecidas pela justiça. Tivemos a aprovação PEC dos combustíveis que limitava a cobrança de ICMS dos estados em combustíveis, energia e telecomunicações e que a união deveria ressarcir os Estados por essa renúncia fiscal. Também foi aprovada PEC do estado de emergência, que previa expansão de auxílios a população e por fim tivemos a PEC da transição que retirou do teto de gastos as despesas com o bolsa família.

E por fim, o processo eleitoral brasileiro encerrou com a vitória do ex-presidente Lula, que comandará o país pela terceira vez, em uma disputa muito acirrada contra o até então presidente Jair Bolsonaro.

Com relação aos EUA, o combate à inflação dominou o debate econômico por lá, o FED, elevou a taxa de juros a níveis que a muito tempo não eram vistos por lá, o que causou um temor de recessão da principal economia mundial. Esse temor derrubou os mercados, que fecharam o ano em forte queda em comparação a 2021. Apesar da forte elevação de juros, a economia americana segue apresentando dados fortes com previsão de crescimento de 1,7% para 2022.

Na Europa, além do cenário inflacionário, existiu uma preocupação adicional, que foi conflito bélico entre Rússia e Ucrânia, que acabou por adicionar uma forte pressão inflacionária ao continente, principalmente nas questões relacionada a mercado de Energia. O Banco Central Europeu, que em um primeiro momento se mostrou reticente na elevação da taxa de juros, também agiu elevando a taxa básica da economia europeia.

Por fim a economia Chinesa, com a adoção ao longo do ano de 2022 da política de COVID zero, que por diversas vezes provocavam rígidos lockdowns, acabou afetando o desempenho da economia e a previsão para crescimento da economia em 2022 ficará próximo dos 3%, número bem abaixo dos registrados nos últimos anos na economia chinesa.



## **Análise da Carteira de Investimentos**

### **Carteira de Investimentos**

No final do período, a carteira apresentou números de fechamento que evidenciam que suas posições estão em conformidade com os limites definidos nos artigos da Resolução 4.963/2021.

### **Enquadramento na Resolução e Política de Investimentos**

A situação da carteira ao término do período evidencia que, apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor, bem como da própria Política de Investimentos definida para o ano de 2022. As diferenças verificadas entre os percentuais da carteira em relação à Política de Investimentos demonstram apenas que os objetivos pretendidos para o ano de 2022 ainda não foram integralmente atingidos.

### **Rentabilidade e Risco (por ativo)**

As séries históricas da rentabilidade e risco por ativo da carteira em relação aos respectivos benchmarks, demonstra a qualidade e consistência de seus resultados.

### **Distribuição por Benchmarks**

A carteira mantém a totalidade dos recursos aplicados em ativos financeiros indexados, e/ou que buscam replicar indexadores adequados, e em conformidade, com os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos.

### **Distribuição por Classificação ANBIMA**

Os fundos de investimentos presentes na carteira seguem as características de estratégias e fatores de riscos definidas pela ANBIMA. Esse agrupamento facilita a comparação de performance entre os diferentes fundos, assim como auxilia o processo de decisão de investimento.

### **Distribuição por Gestoras e Administradoras**

As gestoras e administradoras dos fundos de investimento presentes na carteira são instituições regulares junto aos órgãos de controle e fiscalização do Mercado de Capitais, assim como apresentam histórico de regularidade no ambiente de gestão e administração de investimentos.

### **Retorno da Carteira de Investimentos**

A rentabilidade consolidada da carteira no período acabou impactada por uma combinação de recuperação dos principais indicadores da Economia ao longo do ano, e pelo fator político local, principalmente em relação as expectativas quanto aos gastos do novo governo, que influenciaram desfavoravelmente as bolsas de valores, assim como reforçaram a tendência de alta no mercado de juros futuros.

### Retorno dos Fundos de Investimentos

Os fundos de investimento presentes na carteira são regulados, e estão em conformidade com a legislação normativa dos investimentos dos RPPS. Além de estarem adequados à execução da Política de Investimentos aprovada para o ano de 2022, assim como também atendem os objetivos de rentabilidade e liquidez pretendidos

Rio de Janeiro, 09 de janeiro de 2023.



Mais Valia Consultoria Ltda EPP

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO

Gestão  
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES  
MOBILIARIOS S.A.

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
31

Patrimônio Líquido Fundo  
160.999.611,99

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark  
IMA-B

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Alta Soberano

Política de Investimento  
Aplica seus recursos, exclusivamente, em títulos do Tesouro Nacional e/ou operações compromissadas lastreadas nestes títulos.

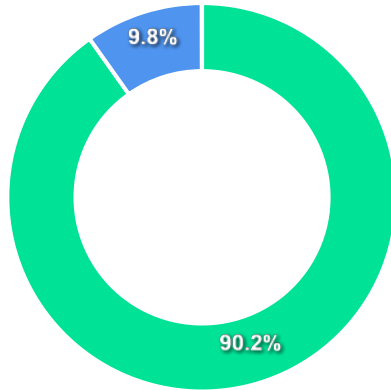
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,13%	5,66%	0,24%	2,00%	5,66%	-1,90%	2,48%	5,22%
Benchmark	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	147.952,58	90.20%
Operação compromissada	16.019,13	9.77%
Derivativos	55,66	0.03%
Valores a pagar/receber	-4,17	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	25.991,14	15,85	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	20.214,08	12,32	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	16.671,93	10,16	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2026	16.019,13	9,77	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	13.877,35	8,46	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	12.277,38	7,49	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	10.801,88	6,59	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	9.995,78	6,09	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	9.010,98	5,49	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	8.039,66	4,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	7.300,56	4,45	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	5.712,53	3,48	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2027	3.990,83	2,43	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2060	2.037,42	1,24	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2032	2.031,05	1,24	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ30	45,37	0,03	Derivativos
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	10,30	0,01	Derivativos
Outros Valores a receber	2,66	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-6,83	0,00	Valores a pagar/receber

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,30%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+3
Quantidade de Cotistas	706
Patrimônio Líquido Fundo	6.757.838.619,84

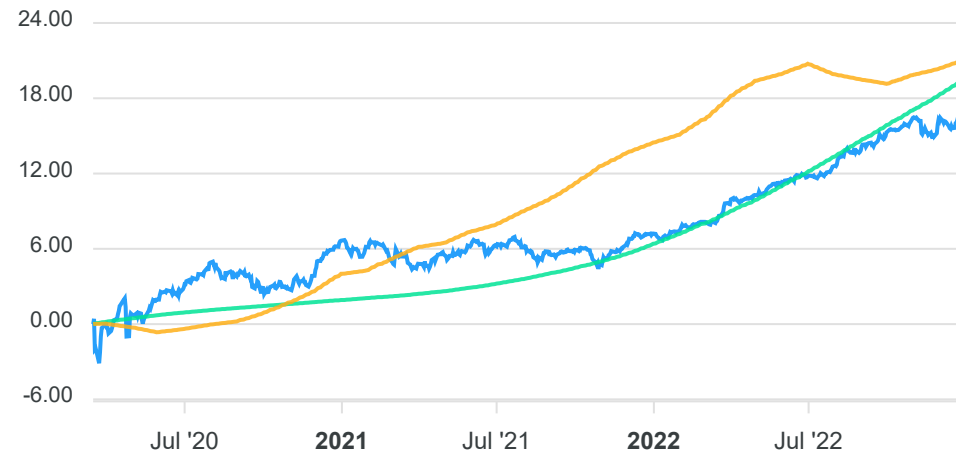
**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IPCA
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento	Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe de Renda Fixa.

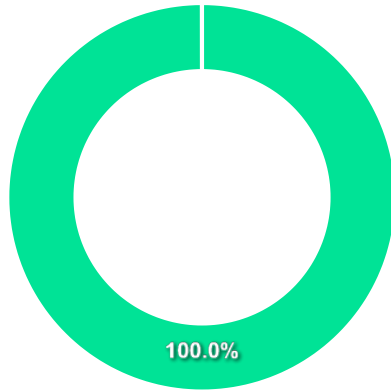
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,77%	9,30%	1,67%	4,80%	9,30%	9,89%	1,26%	2,65%
Benchmark	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI...	1.190.386,03	37,76	Fundos de Investimento
Cotas de BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	991.252,52	31,44	Fundos de Investimento
Cotas de BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	970.636,19	30,79	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	718,26	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,83	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	1,62	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-20,79	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-24,96	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-36,16	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	3.152.274,73	99.98%
Valores a pagar/receber	644,81	0.02%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	780
Patrimônio Líquido Fundo	5.613.586.065,55

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B 5
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento classificados como Renda Fixa Longo Prazo, os quais investem, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e/ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

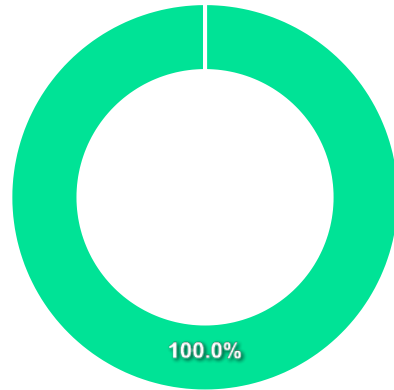
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,91%	9,51%	2,44%	2,86%	9,51%	14,19%	1,14%	2,41%
Benchmark	0,94%	9,78%	2,53%	2,98%	9,78%	14,79%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP IMA-B 5 FI RENDA FIXA LP	5.994.232,08	100,00	Fundos de Investimento
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,81	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,36	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa	0,16	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,05	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-47,57	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.994.232,08	100.00%
Valores a pagar/receber	-17,19	-0.00%



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+2
Quantidade de Cotistas	213
Patrimônio Líquido Fundo	830.239.076,41

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B 5+
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Investe, no mínimo, 80% de sua carteira em ativos cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços.

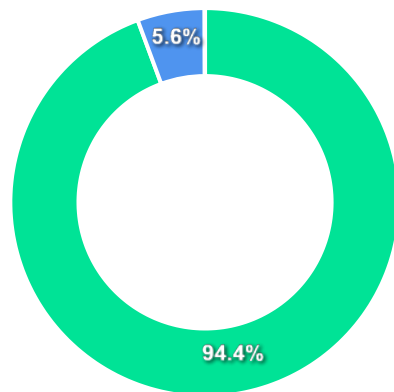
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,19%	2,95%	-1,79%	1,07%	2,95%	-4,03%	3,82%	8,04%
Benchmark	-1,19%	3,30%	-1,72%	1,24%	3,30%	-3,47%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	800.085,08	94.38%
Operação compromissada	47.289,36	5.58%
Outros	202,50	0.02%
Valores a pagar/receber	184,89	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	172.570,92	20,36	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	126.828,07	14,96	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	116.317,90	13,72	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	109.231,01	12,88	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	106.878,56	12,61	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	71.747,90	8,46	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027	47.289,36	5,58	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	47.096,95	5,56	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2032	30.465,74	3,59	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2060	18.948,04	2,24	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	202,50	0,02	Outros
Outras Disponibilidades	200,63	0,02	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	7,14	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	2,24	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,10	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,03	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	0,02	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	-4,64	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-6,43	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-6,65	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-7,54	0,00	Valores a pagar/receber

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+1
Quantidade de Cotistas	553
Patrimônio Líquido Fundo	6.078.064.149,48

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IMA-B
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Indexados
Política de Investimento	Aplica a totalidade de seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais e ou operações compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais.

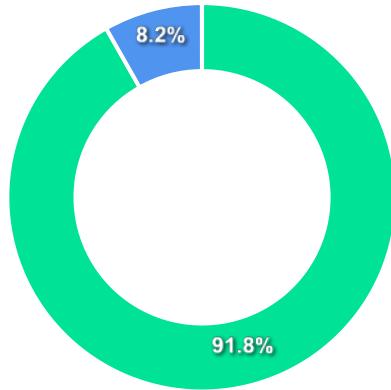
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,22%	6,09%	0,17%	1,80%	6,09%	4,49%	2,47%	5,20%
Benchmark	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	5.176.643,73	91.80%
Operação compromissada	461.462,35	8.18%
Outros	698,31	0.01%
Valores a pagar/receber	166,03	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	708.214,54	12,56	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	597.536,16	10,60	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	494.780,07	8,77	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027	461.462,35	8,18	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	458.465,23	8,13	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	452.450,48	8,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	430.950,14	7,64	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	396.798,75	7,04	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	387.574,63	6,87	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	381.646,15	6,77	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	313.296,19	5,56	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	269.067,94	4,77	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2032	117.394,66	2,08	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2027	114.477,07	2,03	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2060	53.991,73	0,96	Títulos Federais
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	291,66	0,01	Outros
Outras Disponibilidades	201,42	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	116,83	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/...	94,71	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	88,10	0,00	Outros
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	86,41	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Cetip	27,73	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/...	20,59	0,00	Outros
Valores a pagar / Taxa Selic	15,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	8,03	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	4,64	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,02	0,00	Valores a pagar/receber

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,15%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	356
Patrimônio Líquido Fundo	3.745.902.538,43

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IPCA
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento	Aplica seus recursos exclusivamente em títulos públicos federais ou operações compromissadas lastreadas em títulos públicos federais.

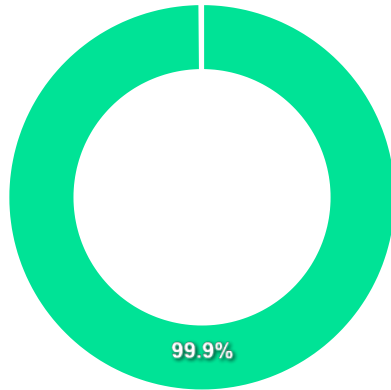
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,95%	11,41%	3,98%	4,00%	11,41%	16,36%	0,60%	1,26%
Benchmark	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	3.690.828,29	99,87	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027	4.991,95	0,14	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	30,13	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	14,55	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	9,66	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	7,14	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	3,43	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	2,21	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-21,98	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-29,48	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.690.828,29	99.86%
Operação compromissada	4.991,95	0.14%
Valores a pagar/receber	15,66	0.00%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	0,20%
Taxa de Performance	Não possui
Disponibilidade de Resgate	D+0
Quantidade de Cotistas	320
Patrimônio Líquido Fundo	2.756.777.028,75

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução	Artigo 7º, Inciso I, Alínea B
Benchmark	IPCA
Classificação ANBIMA	Renda Fixa Duração Livre Soberano
Política de Investimento	Aplica seus recursos, exclusivamente, em Títulos Públicos Federais registrados no SELIC e ou Operações Compromissadas lastreadas em Títulos Públicos Federais registrados no SELIC.

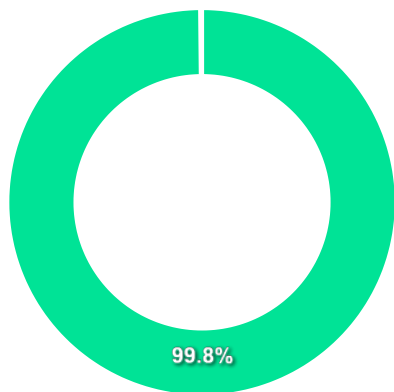
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,32%	-%	2,71%	2,69%	-%	-%	0,99%	2,08%
Benchmark	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.466.758,97	99,84	Títulos Federais
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027	3.913,90	0,16	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	30,55	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	7,14	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Selic	6,05	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	4,42	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	-19,33	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-19,54	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	2.466.758,97	99.84%
Operação compromissada	3.913,90	0.16%
Valores a pagar/receber	9,28	0.00%



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
217

Patrimônio Líquido Fundo  
3.280.425.458,25

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark  
CDI

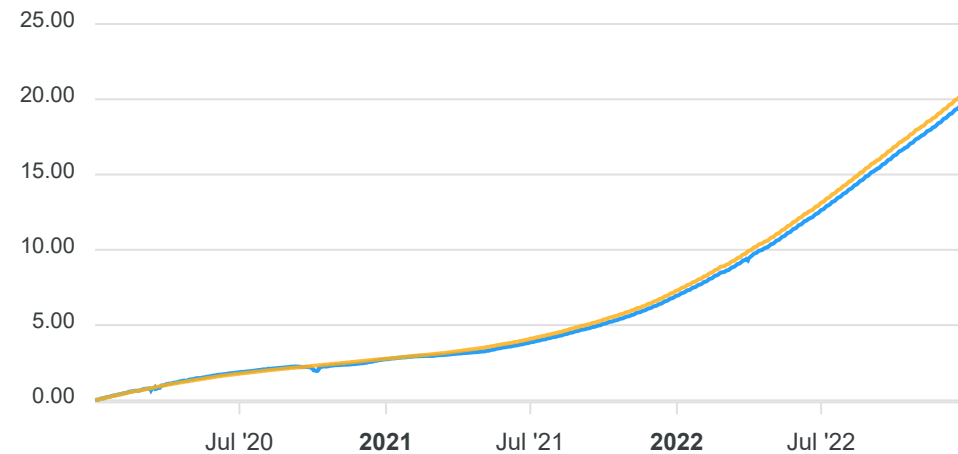
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento  
Investe em carteira composta por títulos de emissão do Tesouro Nacional e/ou do Banco Central do Brasil em operações finais e/ou compromissadas, lastreadas em títulos públicos federais.

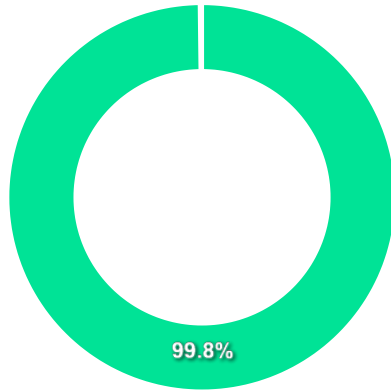
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,10%	12,11%	3,14%	6,49%	12,11%	16,71%	0,00%	0,00%
Benchmark	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2023	3.012.440,15	99,81	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	5.906,21	0,20	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	4,99	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-131,38	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Operação compromissada	3.012.440,15	99.81%
Valores a pagar/receber	5.779,82	0.19%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
105

Patrimônio Líquido Fundo  
474.505.817,58

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark  
IMA-B

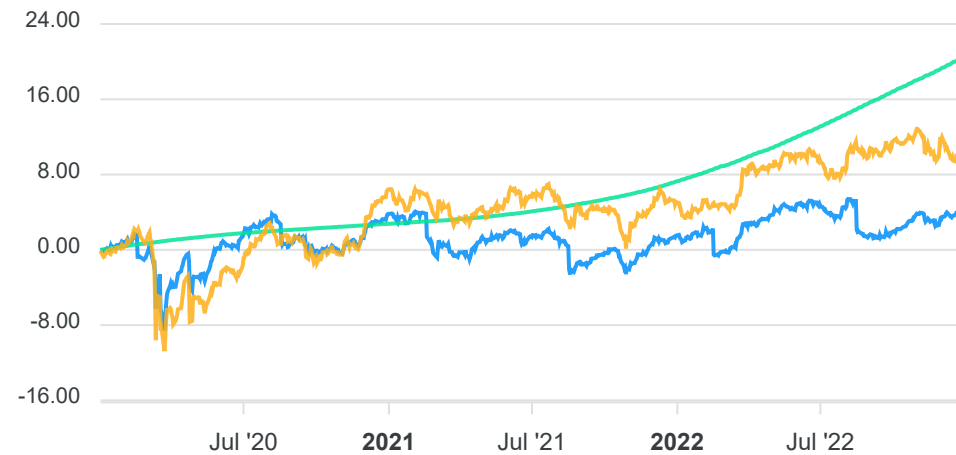
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós fixadas e/ou índices de preços.

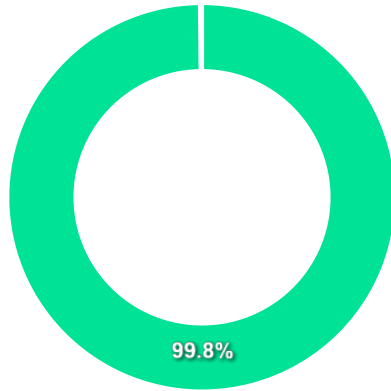
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,32%	3,10%	2,70%	-0,16%	3,10%	0,83%	0,99%	2,08%
Benchmark	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	467.508,60	99,82	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	834,97	0,18	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	10,45	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	3,55	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-23,77	-0,01	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	467.508,60	99.82%
Operação compromissada	834,97	0.18%
Valores a pagar/receber	-9,76	-0.00%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
810

Patrimônio Líquido Fundo  
5.292.657.963,96

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark  
IPCA

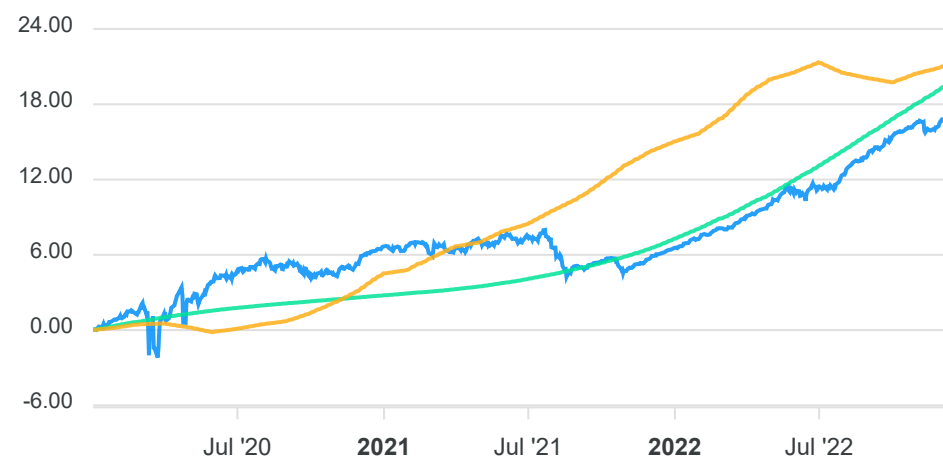
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Soberano

Política de Investimento  
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do CAIXA  
MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA, CNPJ:  
10.948.555/0001-13.

**COMPARATIVO**

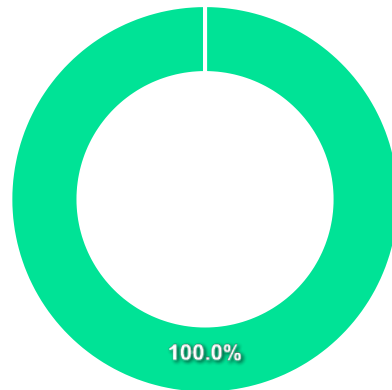
📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,14%	10,70%	2,23%	5,84%	10,70%	10,58%	0,37%	0,78%
Benchmark	0,62%	5,78%	1,63%	0,28%	5,78%	16,43%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA MASTER SOBERANO ATIVA FI RENDA FIXA LP	5.198.430,96	100,01	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	4,99	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-296,11	-0,01	Valores a pagar/receber



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	5.198.430,96	100.01%
Valores a pagar/receber	-291,12	-0.01%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
 CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
 0,20%

Taxa de Performance  
 Não possui

Disponibilidade de Resgate  
 D+0

Quantidade de Cotistas  
 939

Patrimônio Líquido Fundo  
 7.960.289.495,76

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
 Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark  
 IMA-B 5

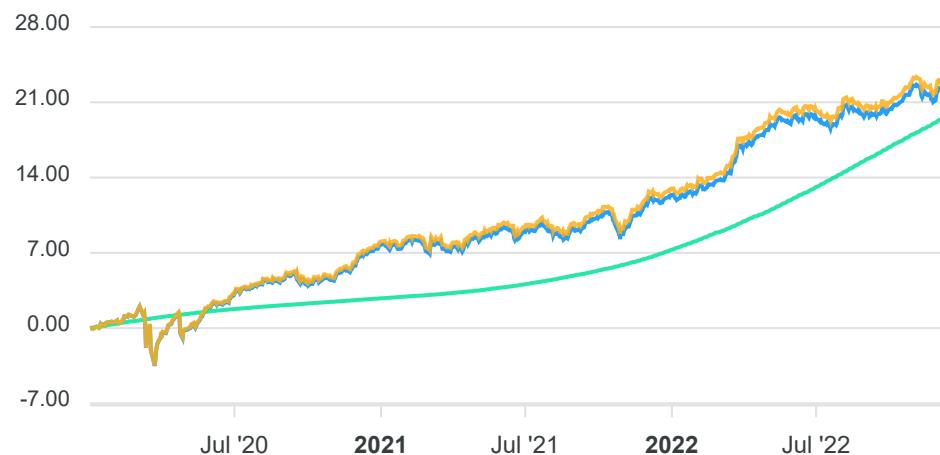
Classificação ANBIMA  
 Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
 Aplica 100% dos recursos em títulos públicos federais, em operações finais e/ou compromissadas, tendo como parâmetro de rentabilidade o IMA-B 5.

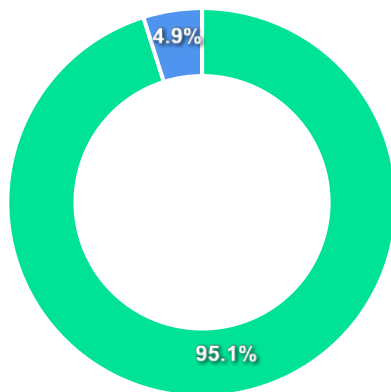
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,92%	9,67%	2,46%	2,96%	9,67%	14,40%	1,14%	2,41%
Benchmark	0,94%	9,78%	2,53%	2,98%	9,78%	14,79%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	2.338.118,83	28,27	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	1.651.038,50	19,96	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	1.558.077,15	18,84	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	1.455.631,17	17,60	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2027	839.208,48	10,15	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/07/2023	402.875,98	4,87	Operação compromissada
LFT - Venc.: 01/03/2023	12.481,88	0,15	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2026	12.435,80	0,15	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	1.233,50	0,01	Títulos Federais
Outros Valores a receber	150,06	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	145,07	0,00	Derivativos
Outras Disponibilidades	86,43	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-286,23	0,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	7.868.225,31	95.13%
Operação compromissada	402.875,98	4.87%
Derivativos	145,07	0.00%
Valores a pagar/receber	-49,75	-0.00%



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
248

Patrimônio Líquido Fundo  
1.062.055.943,18

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark  
IMA-B 5+

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Investe em carteira composta por títulos públicos federais, indexados a taxas prefixadas, pós-fixadas (SELIC/CDI) e/ou índices de preços.

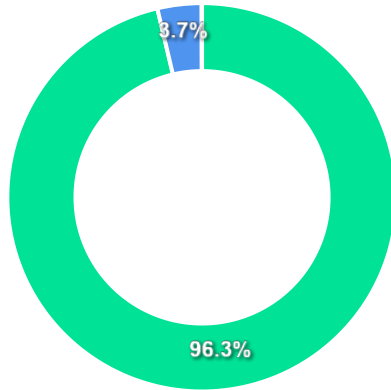
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,23%	3,06%	-1,79%	1,09%	3,06%	-4,16%	3,81%	8,03%
Benchmark	-1,19%	3,30%	-1,72%	1,24%	3,30%	-3,47%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	1.119.937,52	96.31%
Operação compromissada	42.445,51	3.65%
Derivativos	260,85	0.02%
Valores a pagar/receber	221,05	0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	235.388,72	20,25	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	174.578,84	15,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	160.100,15	13,77	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	151.831,50	13,06	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	147.364,63	12,68	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	102.037,09	8,78	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	49.183,83	4,23	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	46.299,80	3,98	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	42.445,51	3,65	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	26.987,72	2,32	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	26.165,25	2,25	Títulos Federais
Outros Valores a receber	265,84	0,02	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTQ28	260,85	0,02	Derivativos
Outras Disponibilidades	10,75	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-55,54	0,00	Valores a pagar/receber

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
739

Patrimônio Líquido Fundo  
3.466.339.701,42

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso I, Alínea B

Benchmark  
IMA-B

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Indexados

Política de Investimento  
Aplica 100% dos seus recursos em títulos do Tesouro Nacional em operações finais e/ou compromissadas tendo como parâmetro de rentabilidade o subíndice IMA-B.

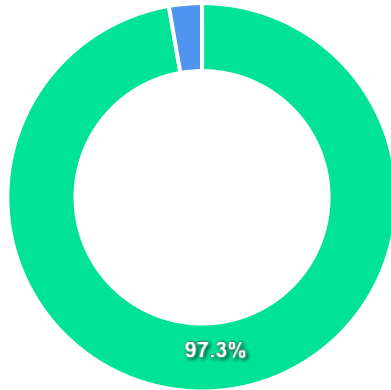
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,24%	6,19%	0,10%	1,86%	6,19%	4,57%	2,52%	5,30%
Benchmark	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	3.627.338,25	97.27%
Operação compromissada	101.983,37	2.73%
Derivativos	20,72	0.00%
Valores a pagar/receber	-76,59	-0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	477.073,34	12,79	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	406.669,67	10,90	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	332.602,50	8,92	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	317.084,22	8,50	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	310.737,71	8,33	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	301.631,79	8,09	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	276.601,48	7,42	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	262.319,00	7,03	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	254.648,29	6,83	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	203.182,72	5,45	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2027	179.152,52	4,80	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	177.192,78	4,75	Títulos Federais
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2024	101.983,37	2,73	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2032	80.380,81	2,16	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2060	46.840,38	1,26	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2025	1.221,04	0,03	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	40,58	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	25,71	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições compradas - DAPFUTK23	20,72	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-142,88	0,00	Valores a pagar/receber

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO

Gestão  
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES  
MOBILIARIOS S.A.

Taxa de Administração  
0,50%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+2

Quantidade de Cotistas  
144

Patrimônio Líquido Fundo  
158.129.265,66

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark  
CDI

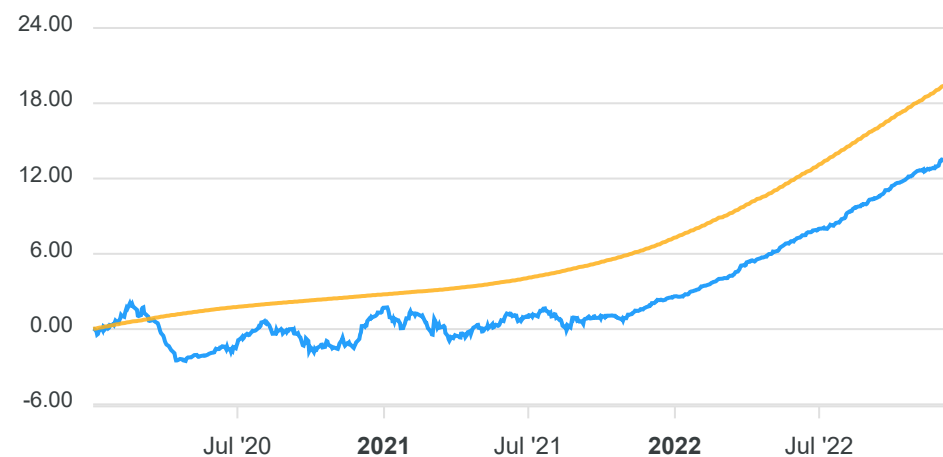
Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento

Política de Investimento  
Aplica em cotas de fundos de investimento os quais investem, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros relacionados diretamente, ou sintetizados via derivativos.

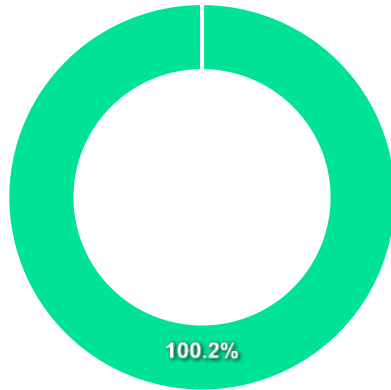
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	0,91%	11,53%	2,73%	5,98%	11,53%	12,52%	0,33%	0,68%
Benchmark	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	122.664,66	77,66	Fundos de Investimento
Cotas de BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	21.182,31	13,41	Fundos de Investimento
Cotas de BANESTES IRF-M 1 TÍTULOS TÚBlicos FI RENDA FIXA	14.406,69	9,12	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	1,77	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-307,78	-0,19	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	158.253,66	100.19%
Valores a pagar/receber	-306,00	-0.19%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO

Gestão  
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES  
MOBILIARIOS S.A.

Taxa de Administração  
0,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+0

Quantidade de Cotistas  
77

Patrimônio Líquido Fundo  
181.768.415,38

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark  
IMA-B

Classificação ANBIMA  
Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em títulos de emissão do Tesouro Nacional e do Banco Central do Brasil e por Títulos e Valores Mobiliários de Renda Fixa cujo emissor esteja classificado na categoria de baixo risco de crédito.

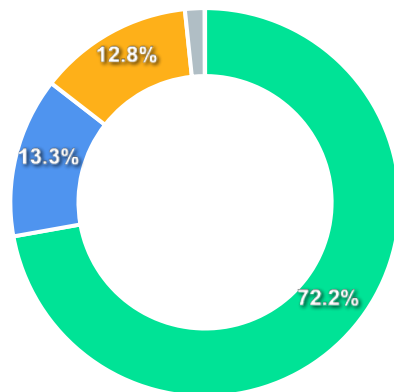
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,25%	6,25%	0,15%	1,96%	6,25%	0,03%	2,40%	5,06%
Benchmark	-0,19%	6,37%	0,23%	1,94%	6,37%	5,02%		
CDI	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	131.842,11	72.20%
Operação compromissada	24.331,90	13.32%
Debêntures	23.431,25	12.83%
Fundos de Investimento	2.948,53	1.61%
Derivativos	79,69	0.04%
Valores a pagar/receber	-28,57	-0.02%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Operações Compromissadas - LFT - Venc: 01/03/2026	24.331,90	13,32	Operação compromissada
NTN-B - Venc.: 15/08/2050	23.288,61	12,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2023	15.951,72	8,74	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2045	14.639,80	8,02	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2026	14.149,86	7,75	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2055	12.994,52	7,12	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2035	12.047,12	6,60	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2024	9.996,59	5,47	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/05/2025	7.929,92	4,34	Títulos Federais
NTN-B - Venc.: 15/08/2040	7.024,47	3,85	Títulos Federais
Debêntures - MRVEC1 - MRV ENGENHARIA PARTICIPAÇÕES S.A. (0...	4.675,45	2,56	Debêntures
NTN-B - Venc.: 15/08/2030	4.076,18	2,23	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/08/2032	4.062,10	2,22	Títulos Federais
Debêntures - PETRÓLEO BRASILEIRO S.A. PETROBRAS (33.000.16...	3.512,10	1,92	Debêntures
Debêntures - TIET26 - AES TIETÊ ENERGIA S.A. (04.128.563/0...	2.646,52	1,45	Debêntures
Debêntures - OMEGA GERAÇÃO S.A. (09.149.503/0001-06) - Ven...	2.406,65	1,32	Debêntures
Debêntures - AES TIETE ENERGIA S.A. (04.128.563/0001-10) -...	2.268,65	1,24	Debêntures
Cotas de LIGHT FIDC SÊNIOR 2	2.049,84	1,12	Fundos de Investimento
Debêntures - MOVIDA PARTICIPAÇÕES S.A. (21.314.559/0001-66...	2.046,03	1,12	Debêntures
NTN-B - Venc: 15/08/2060	2.037,42	1,12	Títulos Federais
NTN-B - Venc: 15/05/2027	1.995,42	1,09	Títulos Federais
Debêntures - UNIDAB2 - UNIDAS S.A. (04.437.534/0001-30) - V...	1.921,25	1,05	Debêntures
Debêntures - RGE SUL DISTRIBUIDORA ENERGIA S.A. (02.016.44...	1.899,43	1,04	Debêntures
NTN-B - Venc.: 15/08/2028	1.648,39	0,90	Títulos Federais
Debêntures - LIGHT SERVIÇOS ELETRICIDADE S.A. (60.444.437/...	1.191,78	0,65	Debêntures
Debêntures - B2W COMPANHIA DIGITAL S.A. (00.776.574/0006-6...	863,39	0,47	Debêntures
Cotas de VERDECARD FIDC SÊNIOR 3	755,08	0,41	Fundos de Investimento



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
 BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO

Gestão  
 BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES  
 MOBILIARIOS S.A.

Taxa de Administração  
 0,20%

Taxa de Performance  
 Não possui

Disponibilidade de Resgate  
 D+0

Quantidade de Cotistas  
 284

Patrimônio Líquido Fundo  
 3.275.697.229,55

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
 Artigo 7º, Inciso III, Alínea A

Benchmark  
 CDI

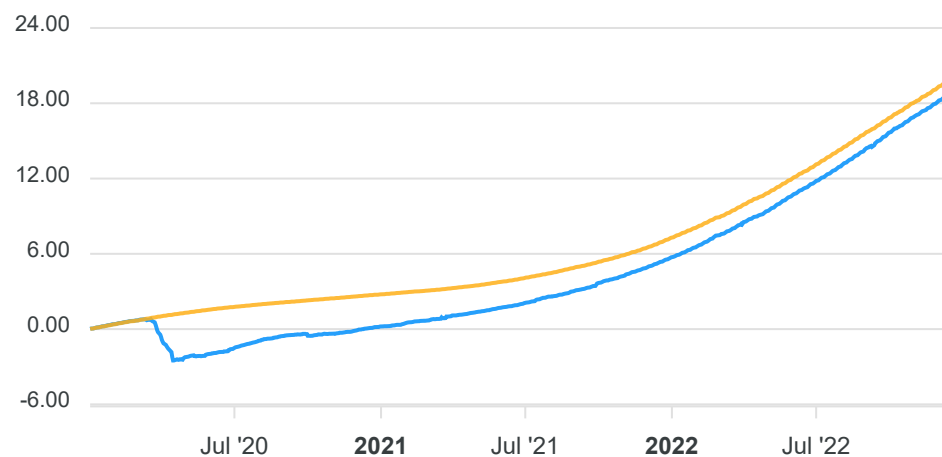
Classificação ANBIMA  
 Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento

Política de Investimento  
 Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em ativos ou modalidades operacionais vinculados à variação do CDI. Possui, no mínimo, 80% do seu patrimônio alocado em ativos de renda fixa de baixo risco de crédito. Opera com derivativos apenas para hedge.

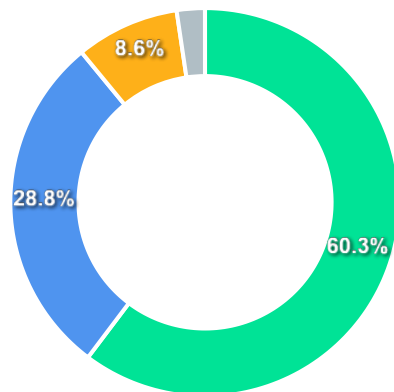
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,11%	12,94%	3,24%	6,84%	12,94%	19,15%	0,03%	0,06%
Benchmark	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		



## CARTEIRA DO FUNDO



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	883.613,82	60.27%
Debêntures	422.005,01	28.79%
Títulos Privados	126.084,26	8.60%
Fundos de Investimento	34.208,77	2.33%
Derivativos	121,42	0.01%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LFT - Venc: 01/03/2027	460.871,78	13,66	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2026	186.627,80	5,53	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/09/2027	133.969,09	3,97	Títulos Federais
LTN - Venc: 01/01/2024	69.502,43	2,06	Títulos Federais
Debêntures - TRISUL S.A. (08.811.643/0001-27) - Venc.: 20/...	29.079,99	0,86	Debêntures
LFT - Venc: 01/03/2028	24.640,70	0,73	Títulos Federais
Debêntures - LIGHT SERVIÇOS ELETRICIDADE S.A. (60.444.437/...	21.229,90	0,63	Debêntures
Debêntures - VIX LOGÍSTICA S.A. (32.681.371/0001-72) - Ven...	20.391,05	0,60	Debêntures
Debêntures - PETROBRAS DISTRIBUIDORA S.A. (34.274.233/0001...	20.225,12	0,60	Debêntures
Debêntures - BURGER KING BRASIL S.A. (13.574.594/0001-96) ...	20.202,59	0,60	Debêntures
Debêntures - TIGRE S.A. PARTICIPAÇÕES (84.684.455/0001-63)...	20.171,26	0,60	Debêntures
Debêntures - CCR S.A. (02.846.056/0001-97) - Venc.: 15/01/...	18.684,78	0,55	Debêntures
Letra Financeira - BANCO BRADESCO S.A. (60.746.948/0001-12...	17.821,24	0,53	Títulos Privados
Letra Financeira - BANCO DAYCOVAL S.A. (62.232.889/0001-90...	17.455,49	0,52	Títulos Privados
Debêntures - EQUATORIAL ENERGIA S.A. (03.220.438/0001-73) ...	16.193,73	0,48	Debêntures
Debêntures - ALGAR TELECOM S.A. (71.208.516/0001-74) - Ven...	15.914,45	0,47	Debêntures
Debêntures - ALGAR TELECOM S.A. (71.208.516/0001-74) - Ven...	15.853,08	0,47	Debêntures
Debêntures - JSL S.A. (52.548.435/0001-79) - Venc.: 20/05/...	15.134,11	0,45	Debêntures
Debêntures - IOCHPE MAXION S.A. (61.156.113/0001-75) - Ven...	14.117,10	0,42	Debêntures
Letra Financeira - BANCO SAFRA S.A. (58.160.789/0001-28) -...	12.115,61	0,36	Títulos Privados
Debêntures - UNIDAS S.A. (04.437.534/0001-30) - Venc.: 10/...	12.072,64	0,36	Debêntures
Letra Financeira - BANCO PAN S.A. (59.285.411/0001-13) - V...	11.771,06	0,35	Títulos Privados
Cotas de LIGHT FIDC SÊNIOR 1	11.077,26	0,33	Fundos de Investimento
Letra Financeira - BANCO ABC BRASIL S.A. (28.195.667/0001-...	10.782,77	0,32	Títulos Privados
Debêntures - USINAS SIDERÚRGICAS MINAS GERAIS S.A. USIMINA...	10.754,75	0,32	Debêntures
Debêntures - SABESP - COMPANHIA SANEAMENTO BÁSICO ESTADO S...	10.626,50	0,31	Debêntures
Debêntures - MOVIDA PARTICIPAÇÕES S.A. (21.314.559/0001-66...	10.511,68	0,31	Debêntures

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BEM DTVM

Gestão  
AZ QUEST INVESTIMENTOS LTDA.

Taxa de Administração  
2,00%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+30

Quantidade de Cotistas  
3.851

Patrimônio Líquido Fundo  
999.511.078,28

Patrimônio Líquido Master  
1.439.263.085,26

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
IBX

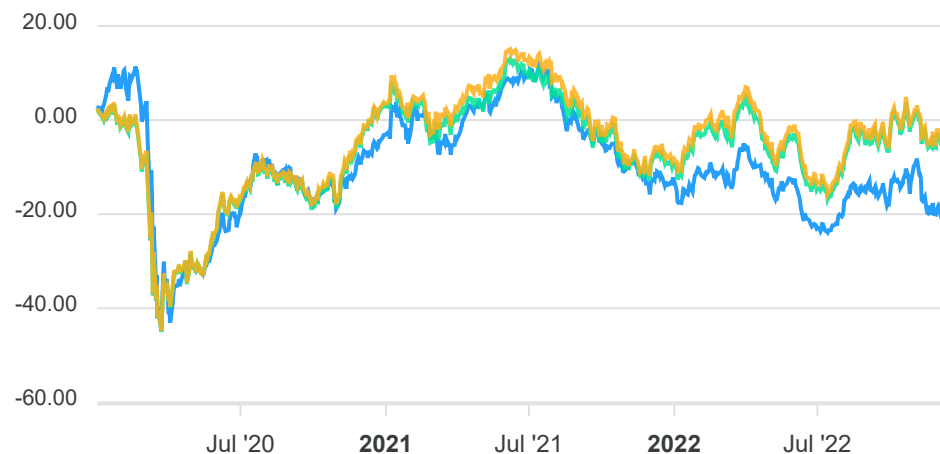
Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do AZ  
QUEST SMALL MID CAPS MASTER FI AÇÕES, CNPJ:  
11.403.884/0001-41.

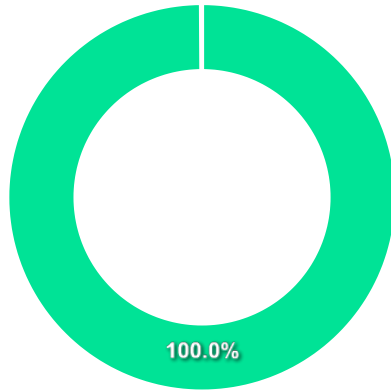
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,80%	-8,69%	-3,58%	3,72%	-8,69%	-17,52%	8,16%	17,19%
Benchmark	-2,63%	4,02%	-0,39%	10,33%	4,02%	-7,61%		
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS MASTER FIAÇÕES	1.023.087,91	100,03	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2025	968,69	0,09	Operação compromissada
Outros Valores a receber	509,07	0,05	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,10	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.823,33	-0,18	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.023.087,91	100.03%
Operação compromissada	968,69	0.09%
Valores a pagar/receber	-1.314,16	-0.13%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANESTES SA BANCO DO ESTADO DO ESPIRITO SANTO

Gestão  
BANESTES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES  
MOBILIARIOS S.A.

Taxa de Administração  
3,00%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+34

Quantidade de Cotistas  
186

Patrimônio Líquido Fundo  
142.932.888,12

Patrimônio Líquido Master  
1.373.628.350,10

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

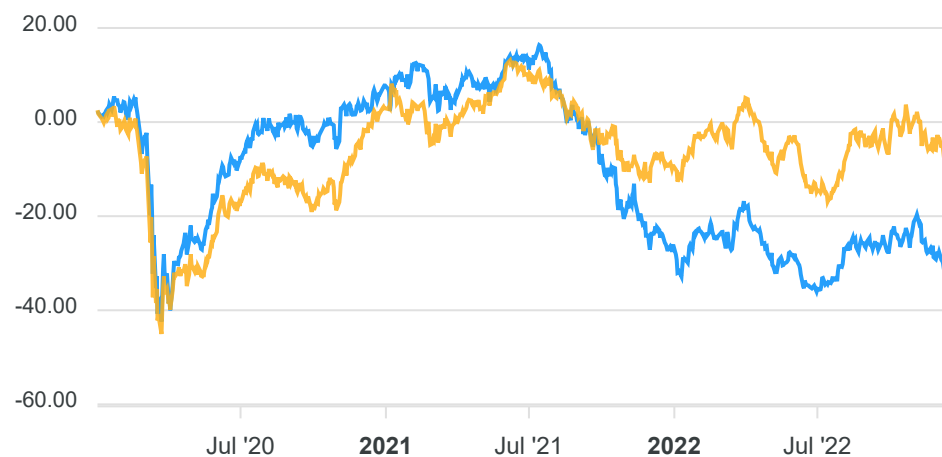
Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do BTG  
PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES, CNPJ:  
11.977.794/0001-64.

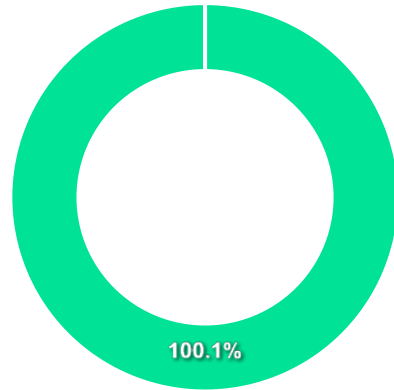
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-3,03%	-4,57%	-3,90%	9,85%	-4,57%	-34,78%	9,06%	19,09%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	146.283,34	99,19	Fundos de Investimento
Cotas de BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.348,33	0,91	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	1,49	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-149,89	-0,10	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	147.631,67	100.10%
Valores a pagar/receber	-148,40	-0.10%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
1,00%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+3

Quantidade de Cotistas  
7.747

Patrimônio Líquido Fundo  
250.169.538,18

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

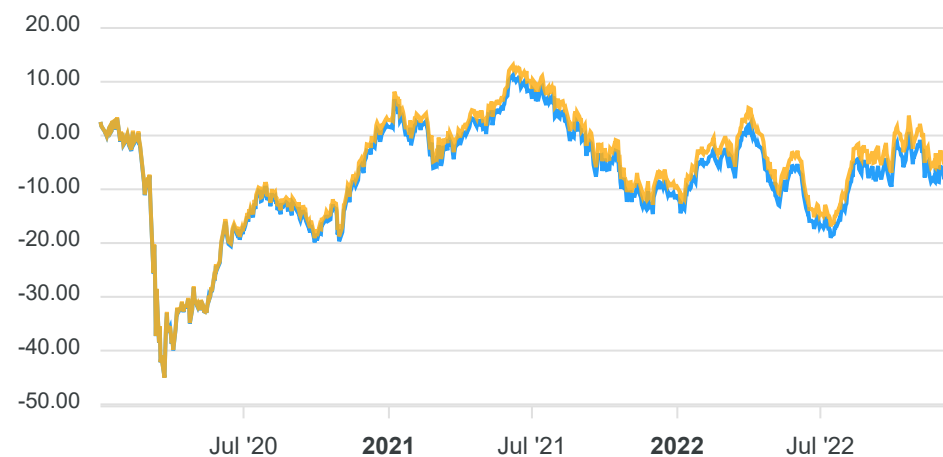
Classificação ANBIMA  
Ações Indexados

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimentos da classe ações, apresentando uma carteira de ativos financeiros que reflita o comportamento da carteira teórica do Ibovespa.

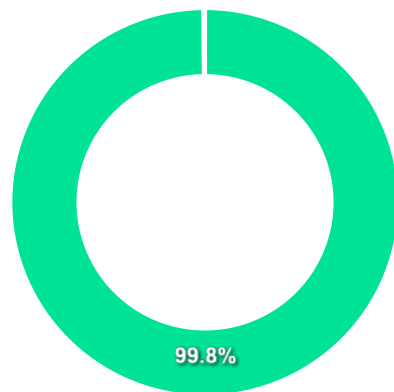
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,44%	3,80%	-0,34%	10,97%	3,80%	-9,36%	9,66%	20,34%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP INDEXADO IBOVESPA FI AÇÕES	259.043,57	99,85	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	435,98	0,17	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	421,64	0,16	Valores a pagar/receber
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,91	0,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	0,82	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	0,61	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Anbid	0,41	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,21	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,04	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-2,08	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-2,26	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	-3,80	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-3,81	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-29,83	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-417,26	-0,16	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	259.045,48	99.85%
Valores a pagar/receber	400,67	0.15%



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Gestão  
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.

Taxa de Administração  
1,00%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
1.545

Patrimônio Líquido Fundo  
844.496.837,07

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

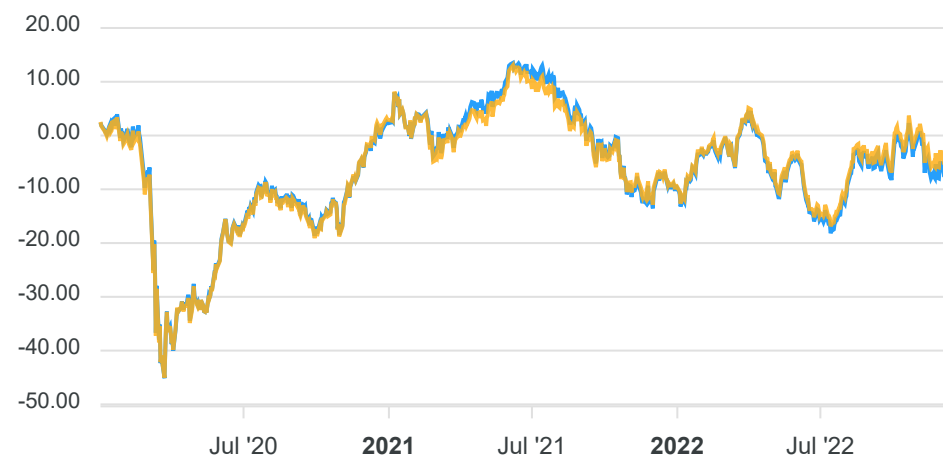
Classificação ANBIMA  
Ações Sustentabilidade/Governança

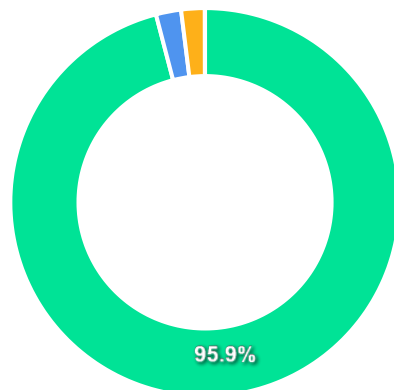
Política de Investimento  
Aplica, preponderantemente, em ações de emissão de companhias que, em função de adesão aos padrões de governança corporativa definidos por bolsa de valores.

**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,62%	2,43%	-1,12%	9,89%	2,43%	-9,39%	10,03%	21,13%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	834.818,10	95.94%
Valores a pagar/receber	18.159,00	2.09%
Operação compromissada	16.918,83	1.94%
Outros	232,56	0.03%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	100.275,39	11,52	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3	47.339,52	5,44	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	47.338,75	5,44	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	45.180,70	5,19	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	31.186,60	3,58	Ações
B3 ON NM - B3SA3	28.218,43	3,24	Ações
ELETOBRAS ON N1 - ELET3	28.116,91	3,23	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	25.806,34	2,97	Ações
WEG ON NM - WEGE3	21.640,32	2,49	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	19.756,37	2,27	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	18.528,46	2,13	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	17.299,29	1,99	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2035	16.918,83	1,94	Operação compromissada
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3	15.639,54	1,80	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	14.714,52	1,69	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	13.263,50	1,52	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	12.534,66	1,44	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	11.319,70	1,30	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	10.351,11	1,19	Ações
LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	8.981,71	1,03	Ações
JBS ON NM - JBSS3	8.931,57	1,03	Ações
Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ELET3	8.714,59	1,00	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	8.543,77	0,98	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	8.501,82	0,98	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	7.873,56	0,90	Ações
VIBRA ON NM - VBRR3	7.787,28	0,89	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	7.768,28	0,89	Ações

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
1,50%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+25

Quantidade de Cotistas  
1.302

Patrimônio Líquido Fundo  
638.491.745,31

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

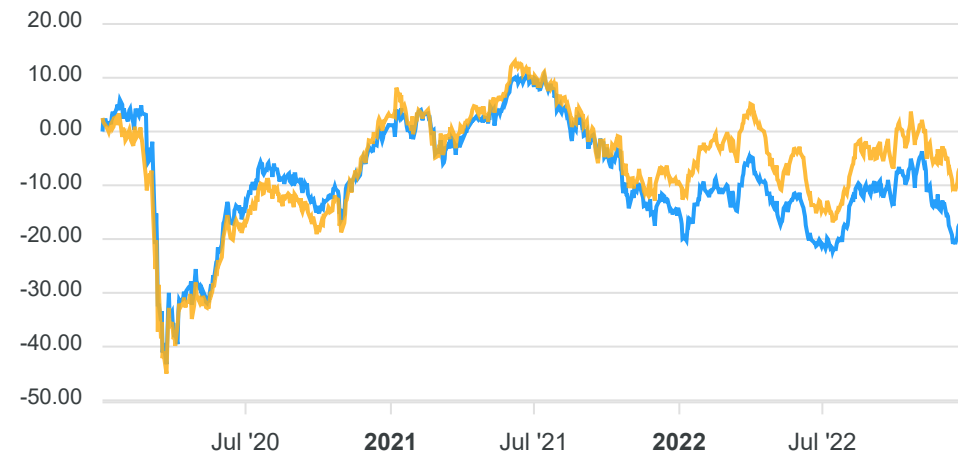
Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento de ações geridos por gestores distintos.

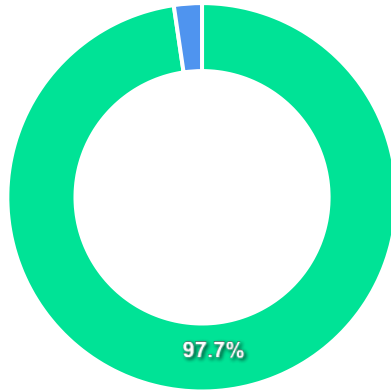
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-3,65%	-1,79%	-4,24%	6,84%	-1,79%	-16,98%	10,34%	21,78%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	667.724,65	97.68%
Valores a pagar/receber	15.886,51	2.32%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de NAVI INSTITUCIONAL II FIC AÇÕES	70.070,33	10,51	Fundos de Investimento
Cotas de MILES CAIXA VIRTUS FIC AÇÕES	58.221,64	8,73	Fundos de Investimento
Cotas de SHARP EQUITY VALUE INSTITUCIONAL FI AÇÕES	58.090,35	8,71	Fundos de Investimento
Cotas de CLARITAS VALOR FEEDER FIC AÇÕES	57.413,93	8,61	Fundos de Investimento
Cotas de CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	52.764,94	7,92	Fundos de Investimento
Cotas de VINCI MOSAICO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	52.212,57	7,83	Fundos de Investimento
Cotas de OCEANA SELECTION 30 E FIC AÇÕES	49.793,28	7,47	Fundos de Investimento
Cotas de TRUXT C VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	43.084,04	6,46	Fundos de Investimento
Cotas de APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	35.267,56	5,29	Fundos de Investimento
Cotas de AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	34.747,09	5,21	Fundos de Investimento
Cotas de TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	32.983,96	4,95	Fundos de Investimento
Cotas de MOAT CAIXA AÇÕES FIC AÇÕES	31.294,62	4,69	Fundos de Investimento
Cotas de LEBLON AÇÕES II INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	30.407,32	4,56	Fundos de Investimento
Cotas de BRASIL CAPITAL 30 FIC AÇÕES	27.379,68	4,11	Fundos de Investimento
Cotas de EQUITAS SELECTION INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	24.814,92	3,72	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	17.289,43	2,59	Valores a pagar/receber
Cotas de CAIXA MASTER TPF FI RENDA FIXA LP	9.178,40	1,38	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-1.402,93	-0,21	Valores a pagar/receber

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,50%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
97

Patrimônio Líquido Fundo  
479.558.546,97

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

Classificação ANBIMA  
Ações Indexados

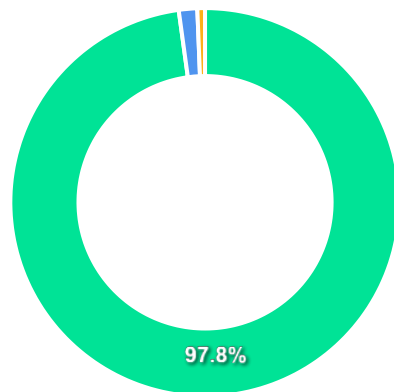
Política de Investimento  
Aplica seus recursos em ativos financeiros de renda variável.

**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,28%	4,93%	-0,16%	11,41%	4,93%	-7,78%	9,50%	20,01%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**


Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	504.071,41	97.84%
Valores a pagar/receber	7.883,31	1.53%
Fundos de Investimento	3.269,07	0.63%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	96.050,14	18,66	Ações
ITAUNIBANCO PN N1 - ITUB4	29.738,44	5,78	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	29.685,78	5,77	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	19.883,42	3,86	Ações
BRDESCO PN N1 - BBDC4	18.995,03	3,69	Ações
B3 ON NM - B3SA3	18.072,64	3,51	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	16.691,40	3,24	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	16.636,59	3,23	Ações
WEG ON NM - WEGE3	13.765,28	2,67	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	12.682,24	2,46	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	12.061,60	2,34	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	11.044,56	2,15	Ações
SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3	9.331,28	1,81	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	8.637,77	1,68	Ações
Outros Valores a receber	8.304,86	1,61	Valores a pagar/receber
PETRORIO ON NM - PRIO3	7.462,35	1,45	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	7.412,57	1,44	Ações
EQUATORIAL ON NM - EQTL3	7.207,91	1,40	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	6.889,11	1,34	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	6.694,18	1,30	Ações
JBS ON NM - JBSS3	6.127,21	1,19	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	5.694,31	1,11	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	5.477,32	1,06	Ações
LOJAS RENNER ON NM - LREN3	5.353,60	1,04	Ações
COSAN ON NM - CSAN3	5.054,46	0,98	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	5.049,79	0,98	Ações
SABESP ON NM - SBSP3	4.944,56	0,96	Ações

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
1,50%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
2.698

Patrimônio Líquido Fundo  
233.749.193,12

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
IDIV

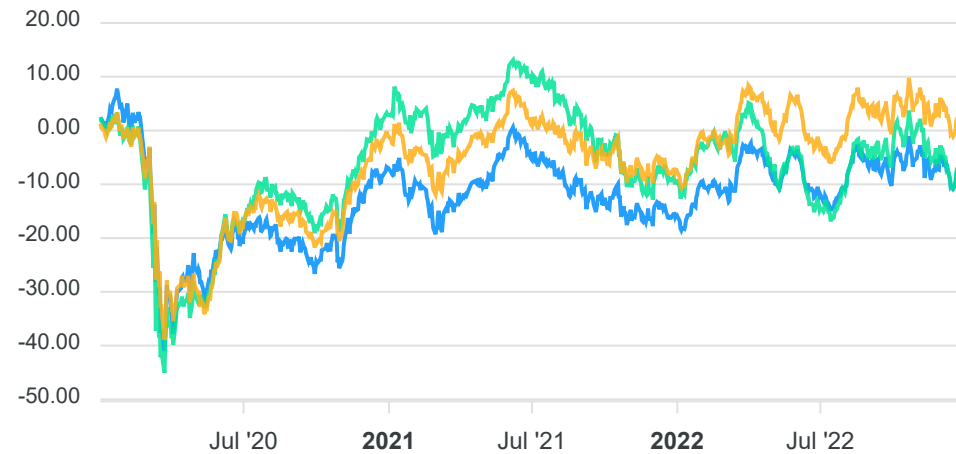
Classificação ANBIMA  
Ações Dividendos

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em ações de empresas que possuam a política e/ou potencial de distribuição de dividendos e/ou juros sobre o capital.

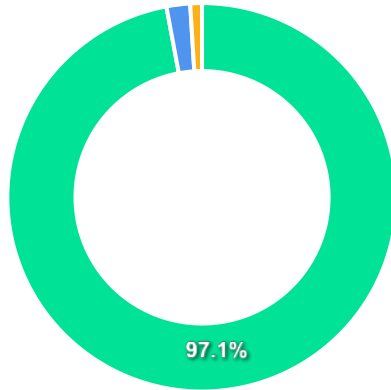
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-1,57%	11,43%	2,90%	7,09%	11,43%	1,01%	8,13%	17,13%
Benchmark	-1,61%	12,65%	3,15%	7,71%	12,65%	5,43%		
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	233.965,11	97.07%
Valores a pagar/receber	4.728,38	1.96%
Fundos de Investimento	2.344,44	0.97%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	23.801,67	9,87	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	12.260,81	5,09	Ações
GERDAU PN N1 - GGBR4	10.929,53	4,53	Ações
B3 ON NM - B3SA3	10.394,05	4,31	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	9.639,08	4,00	Ações
TELEF BRASIL ON - VIVT3	9.520,11	3,95	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	9.466,49	3,93	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	9.405,65	3,90	Ações
ITAUSA PN N1 - ITSA4	8.267,61	3,43	Ações
ELETRONBRAS PNB N1 - ELET6	8.004,95	3,32	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	7.983,86	3,31	Ações
ELETRONBRAS ON N1 - ELET3	7.604,75	3,16	Ações
COPEL PNB N1 - CPLE6	7.351,99	3,05	Ações
JBS ON NM - JBSS3	7.278,71	3,02	Ações
BRADERSCO ON N1 - BBDC3	6.435,55	2,67	Ações
Outros Valores a receber	6.249,44	2,59	Valores a pagar/receber
ENGIE BRASIL ON NM - EGIE3	5.874,60	2,44	Ações
BRADERSCO PN N1 - BBDC4	5.825,52	2,42	Ações
SANTANDER BR UNT N2 - SANB11	5.733,92	2,38	Ações
GERDAU MET PN N1 - GOAU4	5.469,16	2,27	Ações
TRAN PAULIST PN N1 - TRPL4	5.319,94	2,21	Ações
SID NACIONAL ON - CSNA3	4.986,17	2,07	Ações
TAESA UNT N2 - TAEE11	4.400,40	1,83	Ações
BRADERSPAR PN N1 - BRAP4	4.139,33	1,72	Ações
CPFL ENERGIA ON NM - CPFE3	3.818,06	1,58	Ações
CEMIG ON N1 - CMIG3	3.798,66	1,58	Ações
ENERGIAS BR ON NM - ENBR3	3.040,83	1,26	Ações



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
VINCI EQUITIES GESTORA DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração  
1,72%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+33

Quantidade de Cotistas  
165

Patrimônio Líquido Fundo  
902.168.515,36

Patrimônio Líquido Master  
898.333.019,26

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
IDIV

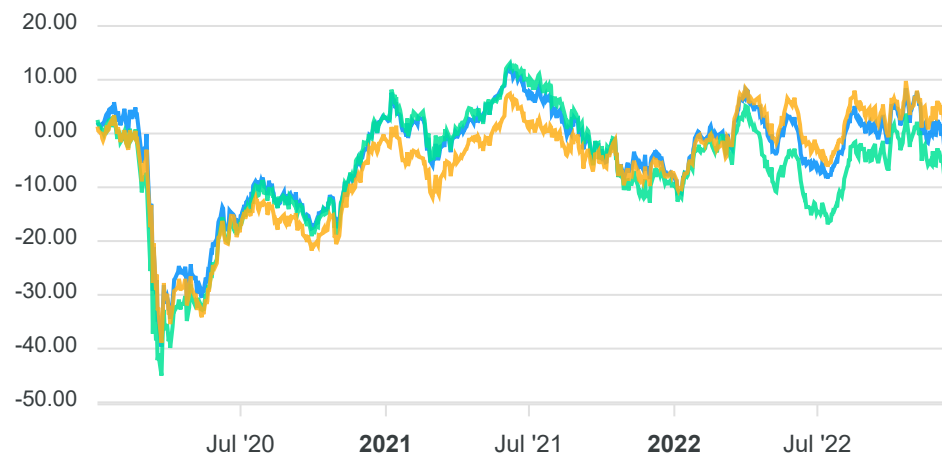
Classificação ANBIMA  
Ações Dividendos

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FI AÇÕES, CNPJ: 15.154.458/0001-72.

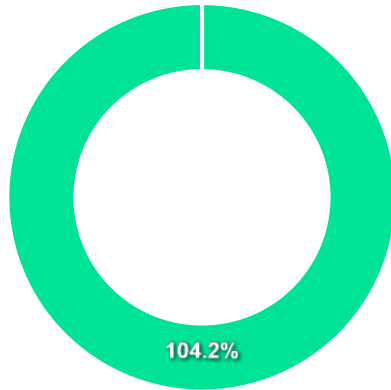
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,42%	8,49%	0,12%	7,07%	8,49%	-2,90%	8,91%	18,77%
Benchmark	-1,61%	12,65%	3,15%	7,71%	12,65%	5,43%		
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de CAIXA VINCI VALOR DIVIDENDOS FIC AÇÕES	959.100,23	99,61	Fundos de Investimento
Cotas de CAIXA MASTER TPF FIC RENDA FIXA LP	4.410,41	0,46	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	4,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-38.511,03	-4,00	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	963.510,64	104.16%
Valores a pagar/receber	-38.506,96	-4.16%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BEM DTVM

Gestão  
OCCAM BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA.

Taxa de Administração  
2,00%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4 ou D+18

Quantidade de Cotistas  
1.795

Patrimônio Líquido Fundo  
991.881.622,41

Patrimônio Líquido Master  
1.040.644.939,99

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

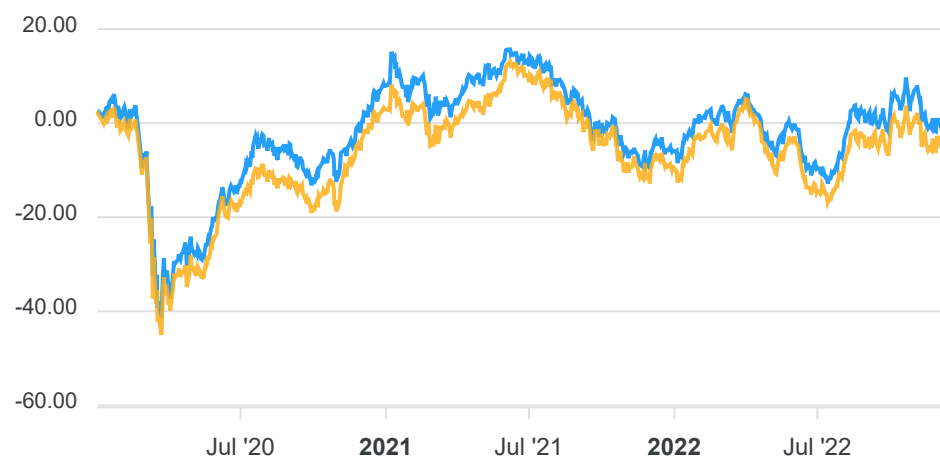
Classificação ANBIMA  
Ações Valor/Crescimento

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% dos seus recursos em cotas do OCCAM FIAÇÕES, CNPJ: 11.616.482/0001-25.

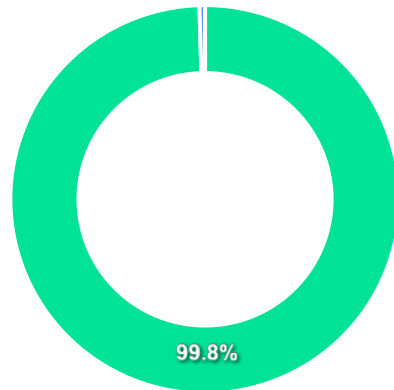
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,66%	4,52%	-1,55%	8,90%	4,52%	-8,80%	7,17%	15,10%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de OCCAM FIAÇÕES	1.002.189,51	99,82	Fundos de Investimento
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2025	4.630,84	0,46	Operação compromissada
Outros Valores a receber	509,20	0,05	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-3.331,12	-0,33	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	1.002.189,51	99.82%
Operação compromissada	4.630,84	0.46%
Valores a pagar/receber	-2.820,92	-0.28%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BEM DTVM

Gestão  
SOMMA INVESTIMENTOS S.A.

Taxa de Administração  
2,00%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
2.534

Patrimônio Líquido Fundo  
343.144.362,04

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

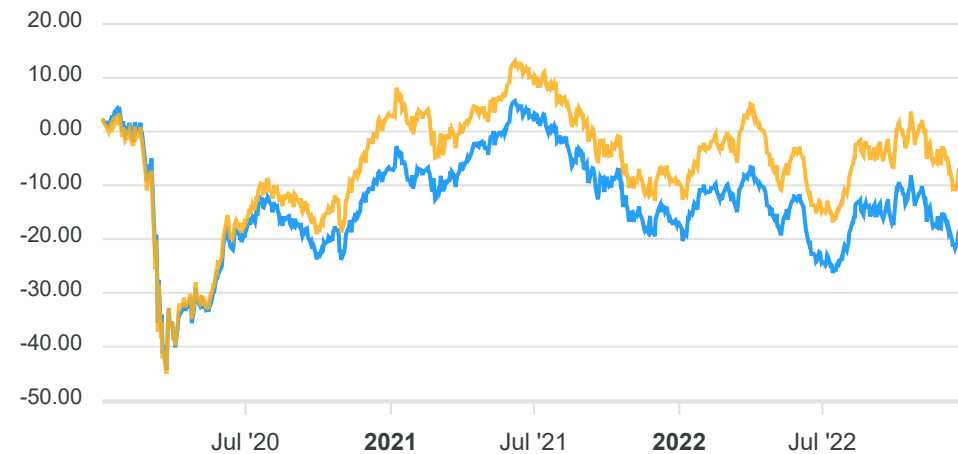
Classificação ANBIMA  
Ações Índice Ativo

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 67% em ações admitidas à negociação em mercado organizado, bônus ou recibos de subscrição e certificados de depósito de ações, cotas de fundos de índices de ações e BDRs classificados como nível II e III.

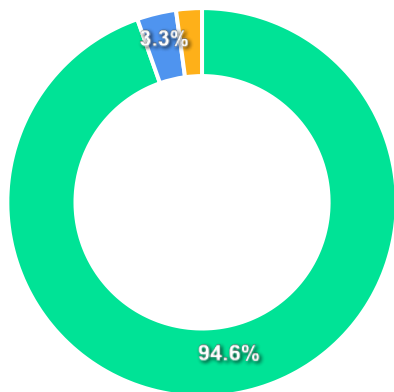
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-2,08%	0,10%	-1,60%	10,01%	0,10%	-10,58%	9,44%	19,89%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Ações	325.033,90	94.61%
Valores a pagar/receber	11.166,34	3.25%
Operação compromissada	7.352,87	2.14%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
VALE ON N1 - VALE3	25.800,00	7,51	Ações
PETROBRAS PN - PETR4	25.254,80	7,35	Ações
ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4	21.938,50	6,39	Ações
BRADESCO PN N1 - BBDC4	17.064,00	4,97	Ações
PETROBRAS ON - PETR3	15.983,10	4,65	Ações
BRASIL ON NM - BBAS3	13.340,80	3,88	Ações
AMBEV S/A ON - ABEV3	12.979,50	3,78	Ações
Outros Valores a receber	12.202,84	3,55	Valores a pagar/receber
B3 ON NM - B3SA3	10.072,50	2,93	Ações
ELETRORAS ON N1 - ELET3	8.760,90	2,55	Ações
BTGP BANCO UNT - BPAC11	8.653,00	2,52	Ações
JBS ON NM - JBSS3	8.285,20	2,41	Ações
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2025	7.352,87	2,14	Operação compromissada
ITAUSA PN N1 - ITSA4	7.320,00	2,13	Ações
PETRORIO ON NM - PRIO3	7.100,60	2,07	Ações
LOCALIZA ON NM - RENT3	6.690,20	1,95	Ações
LOJAS RENNEN ON NM - LREN3	6.088,10	1,77	Ações
TOTVS ON NM - TOTS3	5.139,00	1,50	Ações
WEG ON NM - WEGE3	5.092,20	1,48	Ações
RUMO S.A. ON NM - RAIL3	5.052,50	1,47	Ações
CEMIG PN N1 - CMIG4	4.840,00	1,41	Ações
REDE D OR ON NM - RDOR3	4.666,20	1,36	Ações
BRADESCO ON N1 - BBDC3	4.435,20	1,29	Ações
RAIADROGASIL ON NM - RADL3	4.352,00	1,27	Ações
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	4.242,00	1,23	Ações
GRUPO SOMA ON NM - SOMA3	4.059,00	1,18	Ações
HAPVIDA ON NM - HAPV3	4.004,00	1,17	Ações

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BANCO DAYCOVAL S.A.

Gestão  
TPE GESTORA DE RECURSOS LTDA

Taxa de Administração  
2,00%

Taxa de Performance  
20,00%

Disponibilidade de Resgate  
D+32

Quantidade de Cotistas  
50

Patrimônio Líquido Fundo  
590.953.322,47

Patrimônio Líquido Master  
1.260.030.924,47

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 8º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

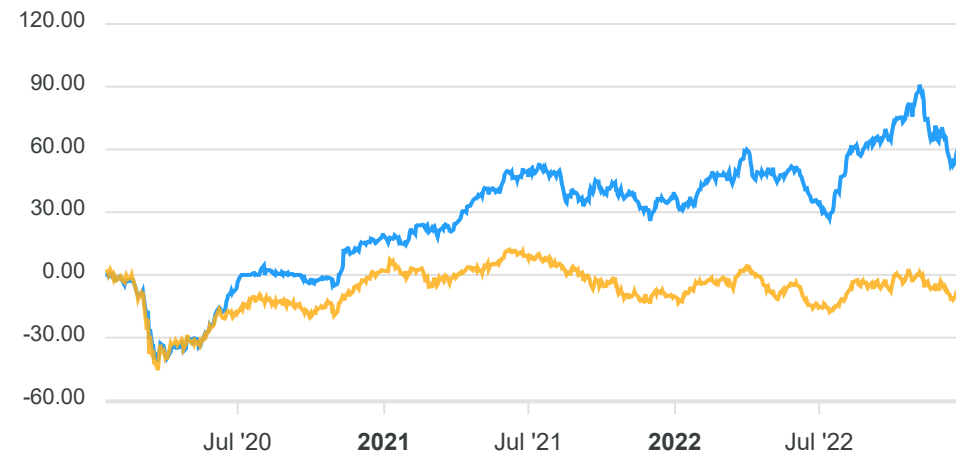
Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica, no mínimo, 95% de seus recursos em cotas do TARPON  
GT MASTER FI AÇÕES, CNPJ: 27.389.566/0001-03.

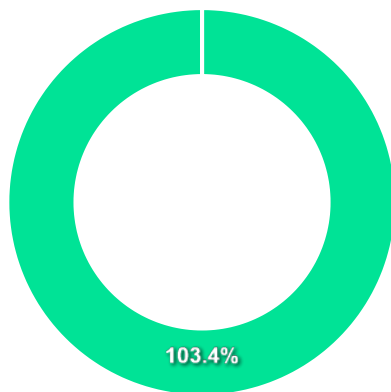
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-4,77%	14,80%	-4,99%	19,02%	14,80%	33,76%	12,48%	26,29%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	551.760,54	103.37%
Outros	0,01	0.00%
Valores a pagar/receber	-17.994,46	-3.37%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de TARPON GT MASTER FI AÇÕES	551.741,91	103,37	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.060,00	0,39	Valores a pagar/receber
Cotas de DAYCOVAL TÍTULOS PÚBLICOS II FI RENDA FIXA	18,63	0,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a receber	16,49	0,00	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	1,00	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	0,75	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia	0,75	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,47	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Custódia e Controladoria	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / txRebate REBATE / CNPJ do emissor: 62.23...	0,01	0,00	Outros
Outros Valores a pagar	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-8,20	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Outras despesas provisão	-11,49	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Gestão	-940,09	-0,18	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-2.061,88	-0,39	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Performance	-17.052,26	-3,19	Valores a pagar/receber



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Gestão	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A.
Taxa de Administração	1,00%
Taxa de Performance	10,00%
Disponibilidade de Resgate	D+2 du
Quantidade de Cotistas	26.586
Patrimônio Líquido Fundo	416.194.949,01

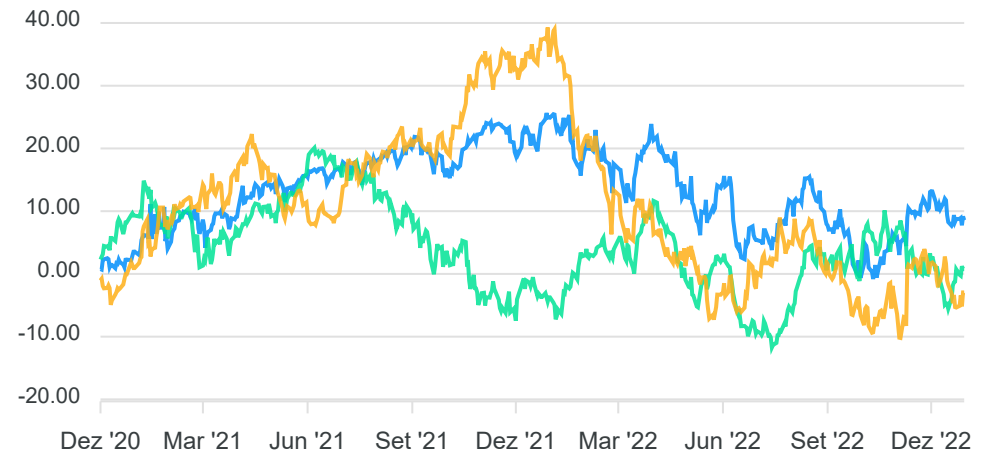
**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução	Artigo 9º, Inciso III
Benchmark	Global BDRX
Classificação ANBIMA	Ações Livre
Política de Investimento	Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FI AÇÕES BDR NÍVEL I, CNPJ: 39.272.928/0001-60.

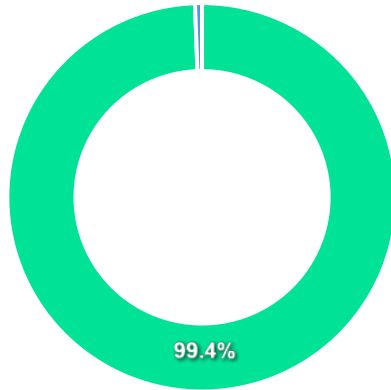
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-3,97%	-13,07%	9,26%	3,01%	-13,07%	4,84%	6,70%	14,11%
Benchmark	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%		
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Fundos de Investimento	443.808,42	99.42%
Valores a pagar/receber	2.580,66	0.58%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIAÇÕES BD...	431.287,38	96,62	Fundos de Investimento
Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.521,04	2,80	Fundos de Investimento
Outras Disponibilidades	2.661,31	0,60	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	1.113,48	0,25	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	6,08	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Auditoria	0,61	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / IR a recolher	0,32	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a receber / Rebate Taxa de Administração	0,06	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,01	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Controladoria	-3,45	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa Cetip	-3,81	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Auditoria	-3,91	0,00	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-51,68	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Cotas a resgatar	-1.138,42	-0,26	Valores a pagar/receber

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
0,70%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+4

Quantidade de Cotistas  
510

Patrimônio Líquido Fundo  
1.938.590.167,99

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 9º, Inciso III

Benchmark  
Global BDRX

Classificação ANBIMA  
Ações Livre

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em recibos de ações de empresas estrangeiras negociados no Brasil, baseando-se na análise de cenários econômico-financeiros nacionais e internacionais.

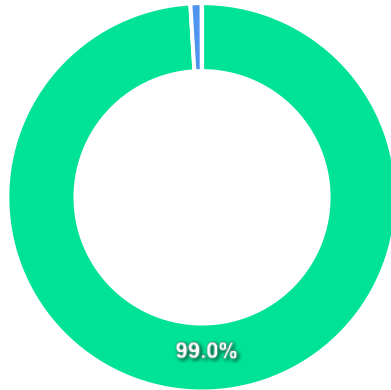
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-4,79%	-28,54%	3,52%	-0,98%	-28,54%	-6,74%	10,61%	22,34%
Benchmark	-4,22%	-28,05%	3,94%	-0,61%	-28,05%	-3,84%		
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Brazilian Depository Receipts	2.045.300,45	99.04%
Fundos de Investimento	18.999,77	0.92%
Valores a pagar/receber	810,20	0.04%
Outros	0,00	0.00%

Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
APPLE DRN - AAPL34	235.411,03	11,40	Brazilian Depository Rece...
MICROSOFT DRN - MSFT34	188.460,64	9,13	Brazilian Depository Rece...
AMAZON DRN - AMZO34	96.939,26	4,69	Brazilian Depository Rece...
ALPHABET DRN C - GOGL35	61.542,90	2,98	Brazilian Depository Rece...
ALPHABET DRN A - GOGL34	59.666,54	2,89	Brazilian Depository Rece...
UNITEDHEALTH DRN - UNHH34	50.128,42	2,43	Brazilian Depository Rece...
EXXON MOBIL DRN - EXXO34	47.847,72	2,32	Brazilian Depository Rece...
TAIWANSMFAC DRN - TSMC34	43.006,41	2,08	Brazilian Depository Rece...
NVIDIA CORP DRN - NVDC34	41.883,53	2,03	Brazilian Depository Rece...
WAL MART DRN - WALM34	41.231,23	2,00	Brazilian Depository Rece...
JPMORGAN DRN - JPMC34	40.021,93	1,94	Brazilian Depository Rece...
CHEVRON DRN - CHVX34	35.363,12	1,71	Brazilian Depository Rece...
PG DRN - PGCO34	35.119,23	1,70	Brazilian Depository Rece...
MASTERCARD DRN - MSCD34	33.699,98	1,63	Brazilian Depository Rece...
HOME DEPOT DRN - HOME34	33.320,40	1,61	Brazilian Depository Rece...
BANKAMERICA DRN - BOAC34	29.997,51	1,45	Brazilian Depository Rece...
ABBVIE DRN - ABBV34	29.411,89	1,42	Brazilian Depository Rece...
PFIZER DRN - PFIZ34	27.757,88	1,34	Brazilian Depository Rece...
MERCK DRN - MRCK34	27.338,45	1,32	Brazilian Depository Rece...
COCA COLA DRN - COCA34	27.164,53	1,32	Brazilian Depository Rece...
META PLATFORMS, INC - M1TA34	26.799,75	1,30	Brazilian Depository Rece...
COSTCO DRN - COWC34	23.666,90	1,15	Brazilian Depository Rece...
TOYOTAMO DRN - TMO34	23.631,29	1,14	Brazilian Depository Rece...
ALIBABAGR DRN - BABA34	23.025,47	1,12	Brazilian Depository Rece...
ORACLE DRN - ORCL34	22.311,68	1,08	Brazilian Depository Rece...
THERMFISCHER DRN - TMOS34	22.158,88	1,07	Brazilian Depository Rece...
NOVO NORDISKDRN - N1VO34	22.089,00	1,07	Brazilian Depository Rece...

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BEM DTVM

Gestão  
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração  
1,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+3 du

Quantidade de Cotistas  
21

Patrimônio Líquido Fundo  
206.688.562,79

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark  
Não definido

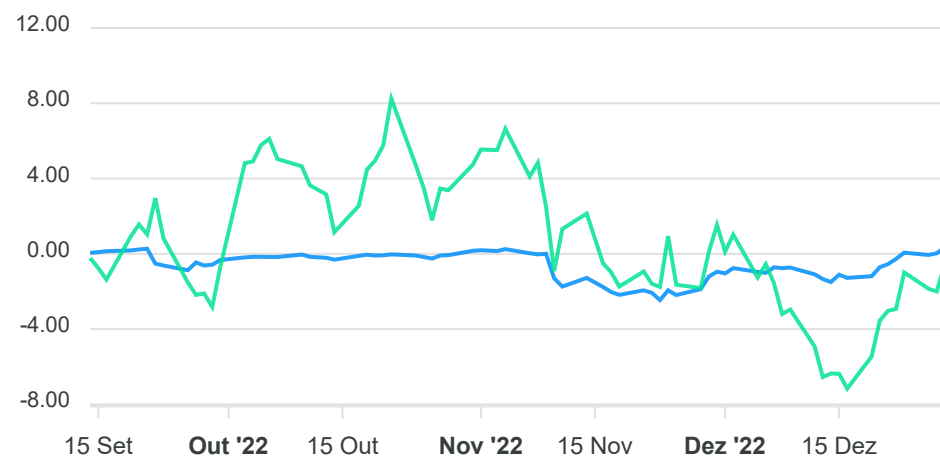
Classificação ANBIMA  
Não classificado

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial e derivativos, negociados nos mercados interno, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica.

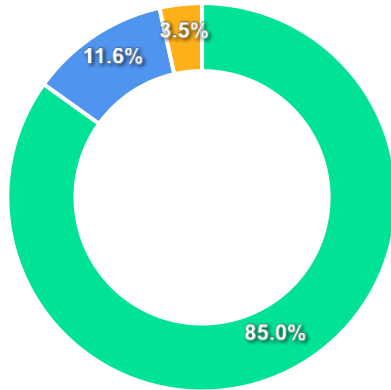
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	1,48%	-%	0,85%	-%	-%	-%	1,74%	3,67%
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LTN - Venc: 01/10/2024	173.095,31	84,98	Títulos Federais
Opções - Posições titulares / 73871	15.297,12	7,51	Outros
Opções - Posições titulares / 73872	8.336,45	4,09	Outros
Operações Compromissadas - LTN - Venc: 01/01/2025	7.158,05	3,51	Operação compromissada
Outras Disponibilidades	2,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-206,50	-0,10	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	173.095,31	84.98%
Outros	23.633,58	11.60%
Operação compromissada	7.158,05	3.51%
Valores a pagar/receber	-204,50	-0.10%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BEM DTVM

Gestão  
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração  
1,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+3 du

Quantidade de Cotistas  
22

Patrimônio Líquido Fundo  
128.998.626,49

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

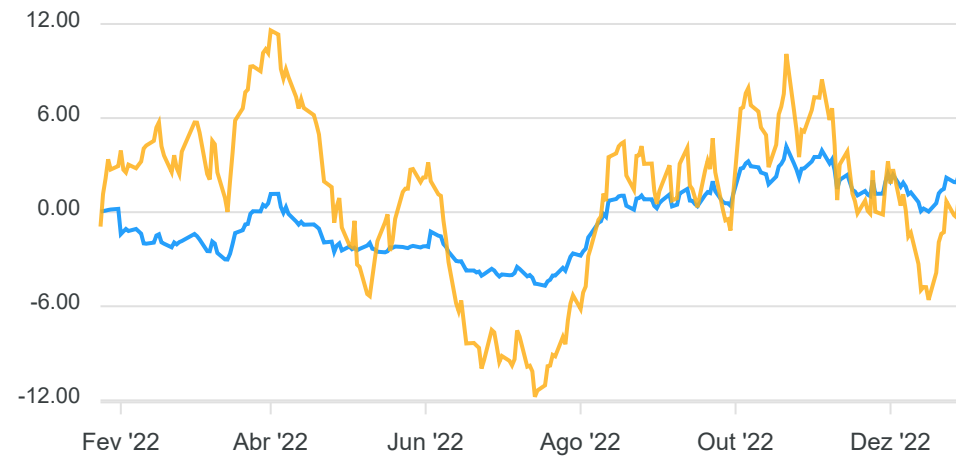
Classificação ANBIMA  
Multimercados Livre

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial e derivativos, negociados nos mercados interno, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica.

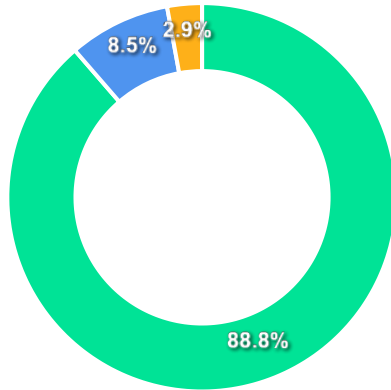
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,11%	-%	1,24%	6,73%	-%	-%	3,13%	6,59%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LTN - Venc: 01/01/2024	78.234,65	61,92	Títulos Federais
LTN - Venc: 01/04/2024	33.973,37	26,89	Títulos Federais
Opções - Posições titulares / 61359	10.692,58	8,46	Outros
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2025	3.650,27	2,89	Operação compromissada
Outros Valores a receber	10,31	0,01	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	2,00	0,00	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTJ24	-62,63	-0,05	Derivativos
Outros Valores a pagar	-145,02	-0,11	Valores a pagar/receber

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	112.208,02	88.80%
Outros	10.692,58	8.46%
Operação compromissada	3.650,27	2.89%
Derivativos	-62,63	-0.05%
Valores a pagar/receber	-132,71	-0.11%



**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
BEM DTVM

Gestão  
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA

Taxa de Administração  
1,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
D+3 du

Quantidade de Cotistas  
20

Patrimônio Líquido Fundo  
161.319.375,60

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 10º, Inciso I

Benchmark  
Ibovespa

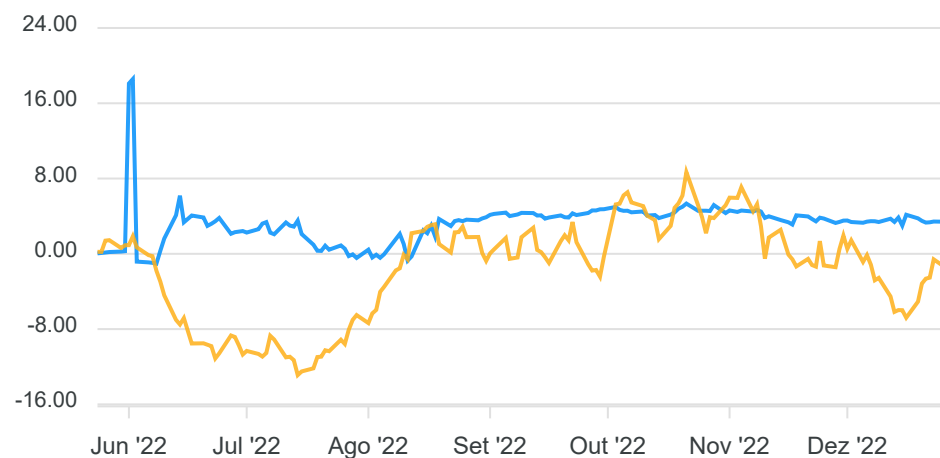
Classificação ANBIMA  
Não classificado

Política de Investimento  
Aplica seus recursos em diversas classes de ativos financeiros disponíveis nos mercados de renda fixa, renda variável, cambial e derivativos, negociados nos mercados internos, sem o compromisso de concentração em nenhuma classe específica.

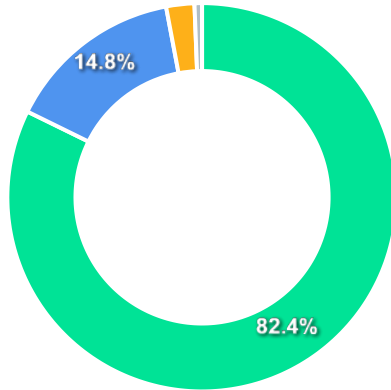
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-0,54%	-%	-1,69%	0,54%	-%	-%	2,75%	5,80%
Benchmark	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LTN - Venc.: 01/07/2024	107.322,38	65,94	Títulos Federais
LTN - Venc: 01/04/2024	26.771,85	16,45	Títulos Federais
Opções - Posições titulares / 72015	24.055,56	14,78	Outros
Outras Disponibilidades	4.002,00	2,46	Valores a pagar/receber
Operações Compromissadas - NTN-B - Venc: 15/05/2025	1.015,15	0,62	Operação compromissada
Outros Valores a receber	0,32	0,00	Valores a pagar/receber
Outros Valores a pagar	-187,59	-0,12	Valores a pagar/receber
Mercado Futuro - Posições vendidas - DI1FUTN24	-221,09	-0,14	Derivativos

Ativo	Vir Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	134.094,22	82.39%
Outros	24.055,56	14.78%
Valores a pagar/receber	3.814,73	2.34%
Operação compromissada	1.015,15	0.62%
Derivativos	-221,09	-0.14%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
 SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Gestão  
 SAFRA ASSET MANAGEMENT LTDA.

Taxa de Administração  
 0,00%

Taxa de Performance  
 Não possui

Disponibilidade de Resgate  
 D+1 du

Quantidade de Cotistas  
 12

Patrimônio Líquido Fundo  
 37.821.176,20

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
 Artigo 10º, Inciso I

Benchmark  
 CDI

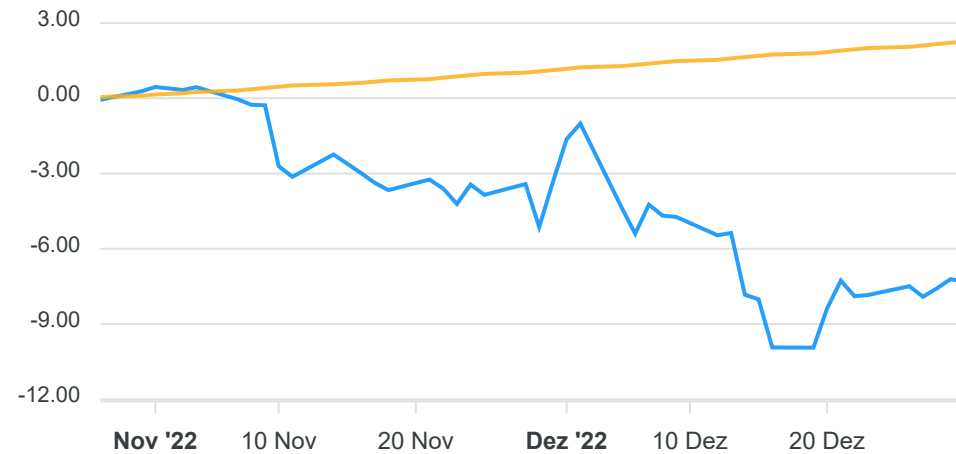
Classificação ANBIMA  
 Não classificado

Política de Investimento  
 Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do SAFRA CAMB  
 ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO, CNPJ: 32.999.558/0001-19.

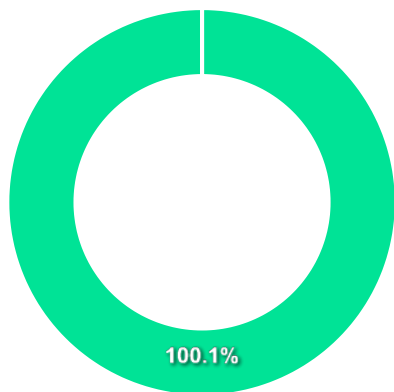
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-4,10%	-%	-%	-%	-%	-%	9,64%	20,31%
Benchmark	1,12%	12,37%	3,20%	6,61%	12,37%	17,31%		
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
LTN - Venc: 01/01/2026	32.564,74	82,57	Títulos Federais
LFT - Venc: 01/03/2024	149,76	0,38	Títulos Federais
Outras Disponibilidades	2,45	0,01	Valores a pagar/receber
Outros Valores a receber	0,00	0,00	Valores a pagar/receber
Operações de Swap	0,00	0,00	Derivativos
Outros Valores a pagar	-34,16	-0,09	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Títulos Federais	32.714,50	100.10%
Derivativos	0,00	0.00%
Valores a pagar/receber	-31,71	-0.10%

**PERFIL E CARACTERÍSTICAS**

Administrador  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Gestão  
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL

Taxa de Administração  
1,20%

Taxa de Performance  
Não possui

Disponibilidade de Resgate  
Não se aplica

Quantidade de Cotistas  
2.504

Patrimônio Líquido Fundo  
99.272.880,00

**PERFIL DO FUNDO**

Enquadramento Resolução  
Artigo 11º

Benchmark  
IFIX

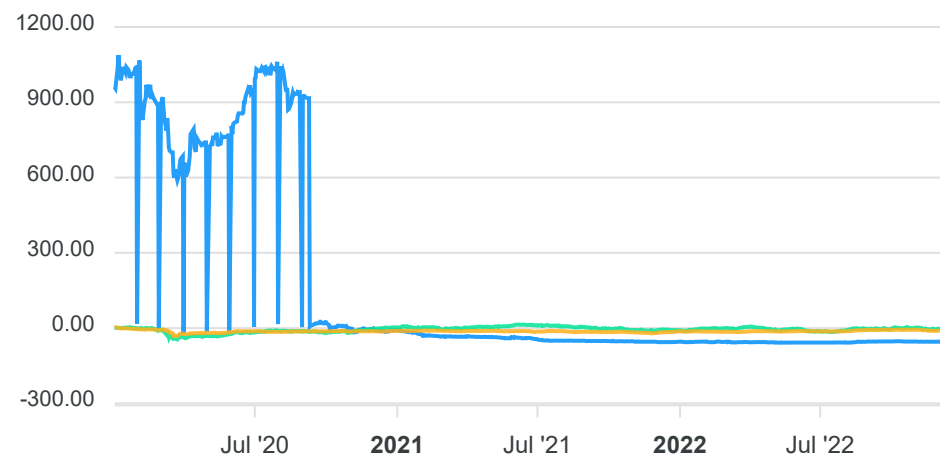
Classificação ANBIMA  
FII TVM Gestão Ativa

Política de Investimento  
Investir predominantemente em cotas de FII, buscando deter pelo menos 5% dos fundos em que investir, de modo a poder convocar e ter maior representatividade nas assembleias gerais de cotistas. Pode aplicar ainda em outros ativos permitidos a FII.

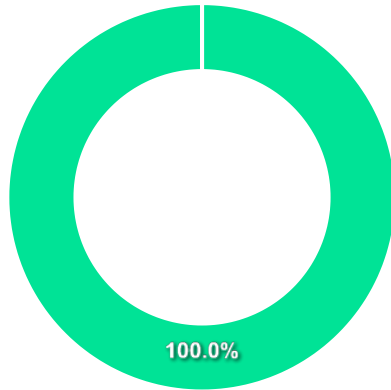
**COMPARATIVO**

📅 30/12/2022

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR - Mês	Volatilidade - Mês
Fundo	-8,67%	-7,68%	-9,91%	-0,44%	-7,68%	-53,96%	14,39%	30,30%
Benchmark	0,00%	2,22%	-4,14%	2,56%	2,22%	-0,11%		
IBOVESPA	-2,45%	4,69%	-0,27%	11,36%	4,69%	-7,80%		



**CARTEIRA DO FUNDO**



Nome do Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)	Tipo Ativo
Disponibilidades - Títulos Públicos	3.097,88	2,19	Valores a pagar/receber
Outras Disponibilidades	11,10	0,01	Valores a pagar/receber
Cotas FI RENDA FIXA	0,00	0,00	Fundos de Investimento
Outros Valores a pagar	-15,19	-0,01	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Taxa de Administração	-139,80	-0,10	Valores a pagar/receber
Valores a pagar / Rendimentos a distribuir	-866,67	-0,61	Valores a pagar/receber

Ativo	Vlr Ativo (mil)	Particip. (%)
Valores a pagar/receber	2.087,32	100.00%
Fundos de Investimento	0,00	0.00%

