



REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL
IGAPREV – IGARASSU PREVIDÊNCIA LC 23/2012
CNPJ: 06.234.755/0001-37

ATA DE REUNIÃO ORDINARIA DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

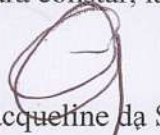
Dezembro/2022


Aos 16 dias do mês de janeiro de dois mil e vinte e três, as dez horas na sala de reunião do Igaprev estiveram presentes os membros do Comitê de Investimentos: Jacqueline da Silva Campelo (Assessor), Héli da Luzia de Arruda Lima (Presidente do Conselho Deliberativo), Ezi Francisca da Silva Paulino (assistente administrativo-financeiro), Francisco Barreto de Menezes Leite (Gerente de Previdência), Dario Uchikawa (representante do Poder Executivo) e Ewerson Hugo (representante do Poder Executivo). A reunião foi iniciada com a leitura da Carta Econômica da competência de dezembro/2022, documento expedido pela consultoria Mais Valia Ltda e análise dos relatórios de investimentos. Para consultoria, dezembro foi um mês difícil para gestores de ativos, pois, apesar do retorno positivo da renda fixa, nos fundos CDI, os retornos negativos dos índices de renda variável local e ativos atrelados a investimento no exterior trouxeram apresentaram um resultado negativo. Os retornos foram impactados, principalmente, pela aprovação da PEC da Transição, que fixou teto de R\$ 145 bi no déficit fiscal pelo prazo de um ano, além da promessa de apresentação, no primeiro semestre, de uma nova modelagem de âncora fiscal, representou uma diminuição das incertezas, mas a equipe econômica ainda precisará definir o papel das estatais e demais pontos da estratégia econômica para o Brasil em 2023. Além disso, houve a manutenção da taxa de juros 13,75%, na reunião do comitê de dezembro, com um reforço da análise do cenário de desaceleração e inflação alta. No cenário externo, os indicadores indicam uma desaceleração nos EUA e Zona do Euro, com perspectivas de elevação de juros e inflação elevada. Por outro lado, na China, apresentou dados em linha com o esperado. Em síntese, o documento explicita que o cenário continua extremamente desafiador e volátil e ratifica a recomendação de manutenção de uma carteira diversificada. Em relação a gestão dos recursos do RPPS, foi mantida a postura conservadora durante todo exercício de 2022, sem elevação de percentual investido, nas alternativas de maior risco, renda variável, como nos fundos de ações negociadas tanto na B3 como nas bolsas do exterior via fundos BDR, postura recomendada por este Comitê de Investimento. O desempenho mensurado apresentado nos Relatórios de Investimento de forma global foi 7,59% a.a. inferior, portanto, meta atuarial acumulada ao ano 11,01% (4,94%+ IPCA), o que representou o retorno acumulado nominal foi de R\$1.067.518,71 e risco 2,20%Var (Value at Risk). Resultado composto pela performance apresentadas nas carteiras do plano financeiro 13,77% a.a., plano previdenciário 5,96% a.a. e reserva da taxa administrativa 9,15% a.a. O saldo global R\$ 15.331.922,90 no plano financeiro R\$ 1.428.487,08, no plano previdenciário R\$ 11.871.193,11 e na reserva da taxa administrativa R\$ 2.032.242,71. Em dezembro, embora o desempenho global tenha sido positivo, 0,17% a.m, pouco impactou o



REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA MUNICIPAL
IGAPREV – IGARASSU PREVIDÊNCIA LC 23/2012
CNPJ: 06.234.755/0001-37

resultado anual, apenas refletindo o desempenho dos fundos de curto prazo na carteira. Em relação a movimentação de recursos, destacamos o resgate com objetivo de reversão de parte da reserva administrativa no valor de R\$ 600.000,00 , para pagamento de despesas com benefícios previdenciários, no fundo Santander Institucional Advanced, autorizado pelos órgãos de governança do instituto. Por fim, avaliamos que apesar de alguns objetivos ainda não terem sido alcançados no ano de 2022 (estratégias alvo), fica demonstrado o cumprimento da legislação em vigor e os parâmetros definidos pela Política de investimentos. E que uma combinação de fatores impactou o desempenho global da carteira intrinsecamente ligada ao fator econômico local que reforçaram a alta de juros e apesar da estratégia de diversificação não possibilitou o alcance da meta atuarial, especialmente no plano previdenciário. Ressaltamos que se mantiveram as recomendações realizadas pela consultoria MAIS VALIA LTDA em relação aos fundos de investimentos, no mês de dezembro, sendo autorizadas movimentações nos fundos SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA e SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA. Em anexo, relatórios da carteira, planilhas de resgate/aplicação, posição financeira, outros. Assim, para constar, lavra-se a presente ata que segue assinada.


Jacqueline da Silva Campelo


Ezi Francisca da Silva Paulino


Héli da Luzia de Arruda Lima


Francisco Barreto de Menezes Leite


Ewerson Hugo


Dario Uchikawa

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 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|---|--------------|------------|------------------|-------|----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 495.184,22 | 3,32% | 7.489.389.892,90 | 0,01% | 7º I b |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.175.988,49 | 7,88% | 5.613.586.065,55 | 0,02% | 7º I b |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.066.989,38 | 7,15% | 830.239.076,41 | 0,13% | 7º I b |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.934.417,03 | 12,96% | 6.078.064.149,48 | 0,03% | 7º I b |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 120.717,42 | 0,81% | 6.516.931.621,39 | 0,00% | 7º I b |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 415.428,08 | 2,78% | 183.585.511,92 | 0,23% | 7º I b |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 3.910.812,22 | 26,20% | 827.149.677,31 | 0,47% | 7º I b |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 946.121,00 | 6,34% | 564.735.869,38 | 0,17% | 7º I b |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.758.448,63 | 11,78% | 41.379.142,83 | 4,25% | 7º I b |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1.391.725,63 | 9,33% | 396.851.061,29 | 0,35% | 7º III a |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 274.638,56 | 1,84% | 844.496.837,07 | 0,03% | 8º I |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 745.513,85 | 5,00% | 308.702.229,09 | 0,24% | 8º I |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 688.034,90 | 4,61% | 416.194.949,01 | 0,17% | 9º III |

Investimentos

\$ 14.924.019,41

Disponibilidades Financeiras

\$ 407.903,49

Total Carteira

\$ 15.331.922,90

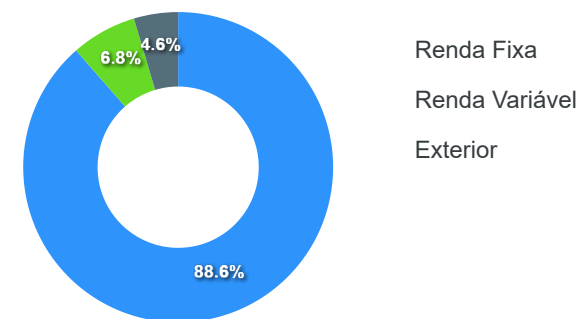
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Livre |
|--------------------------------|------------|-------------------------|------------------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 79,23% 11.824.106,47 | 20,77% 3.099.912,94 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 9,33% 1.391.725,63 | 50,67% 7.562.686,02 |
| 8º I - Fundos de Ações | 30,00% | 6,84% 1.020.152,41 | 23,16% 3.457.053,41 |
| 9º III - Ações - BDR Nível I | 10,00% | 4,61% 688.034,90 | 5,39% 804.367,04 |

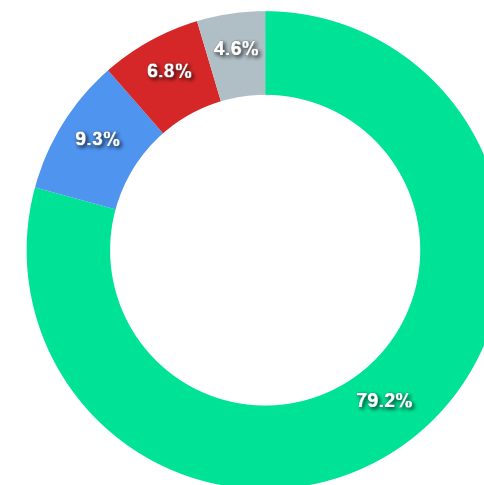
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

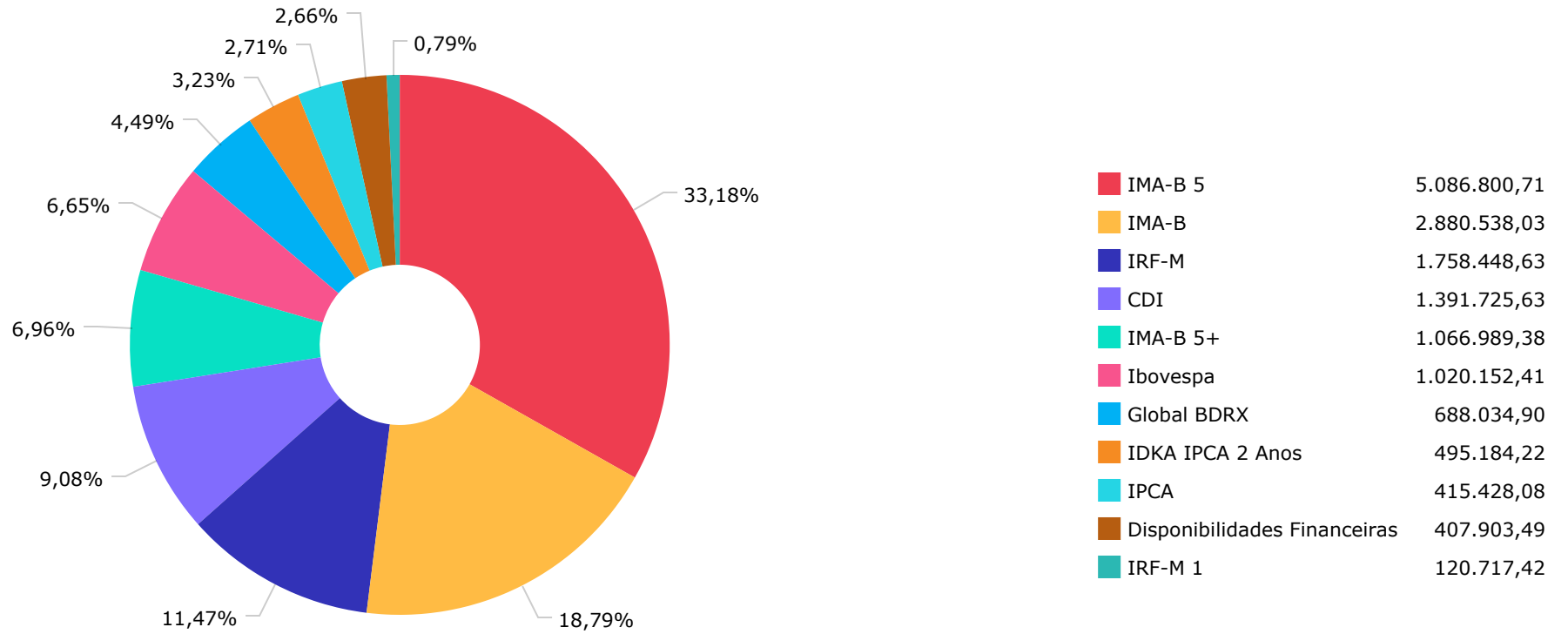


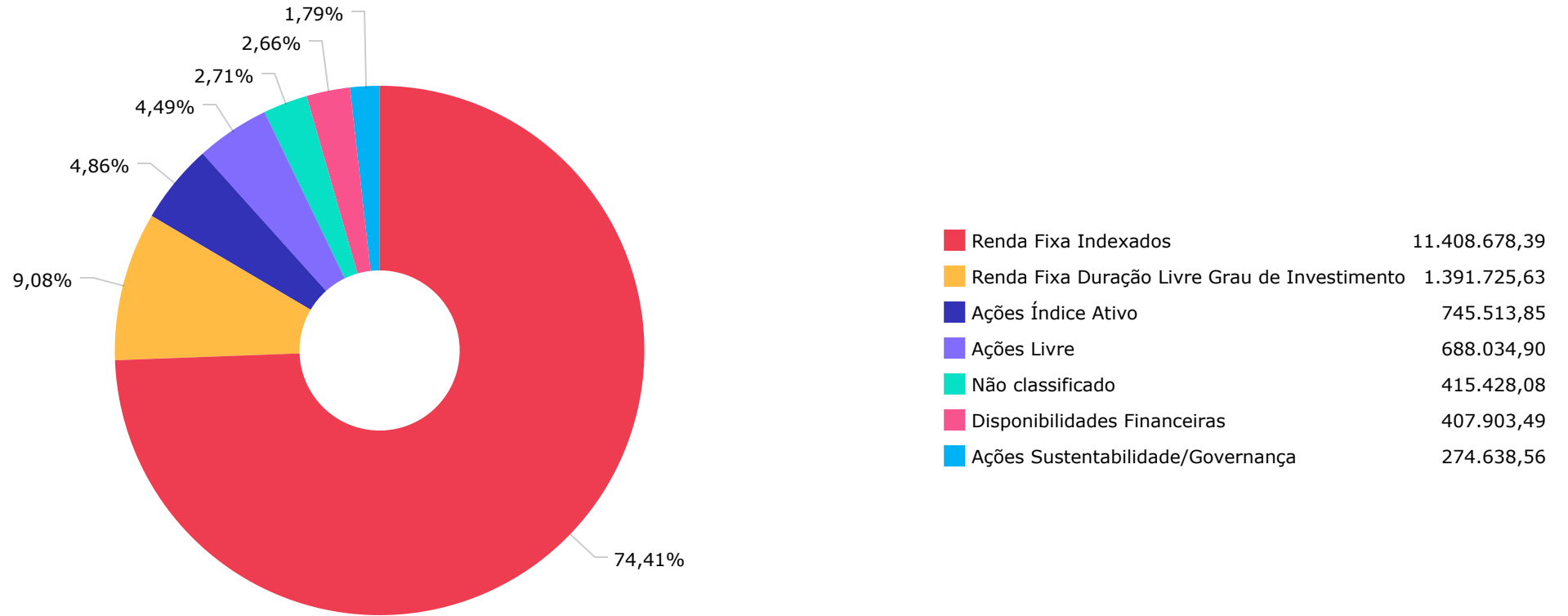
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 9,00% | 100,00% | 14.924.019,41 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 79,23% | 0,00% | 40,00% | 100,00% | 3.099.912,94 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 9,33% | 0,00% | 15,00% | 60,00% | 7.562.686,02 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 20,00% | 2.984.803,88 |

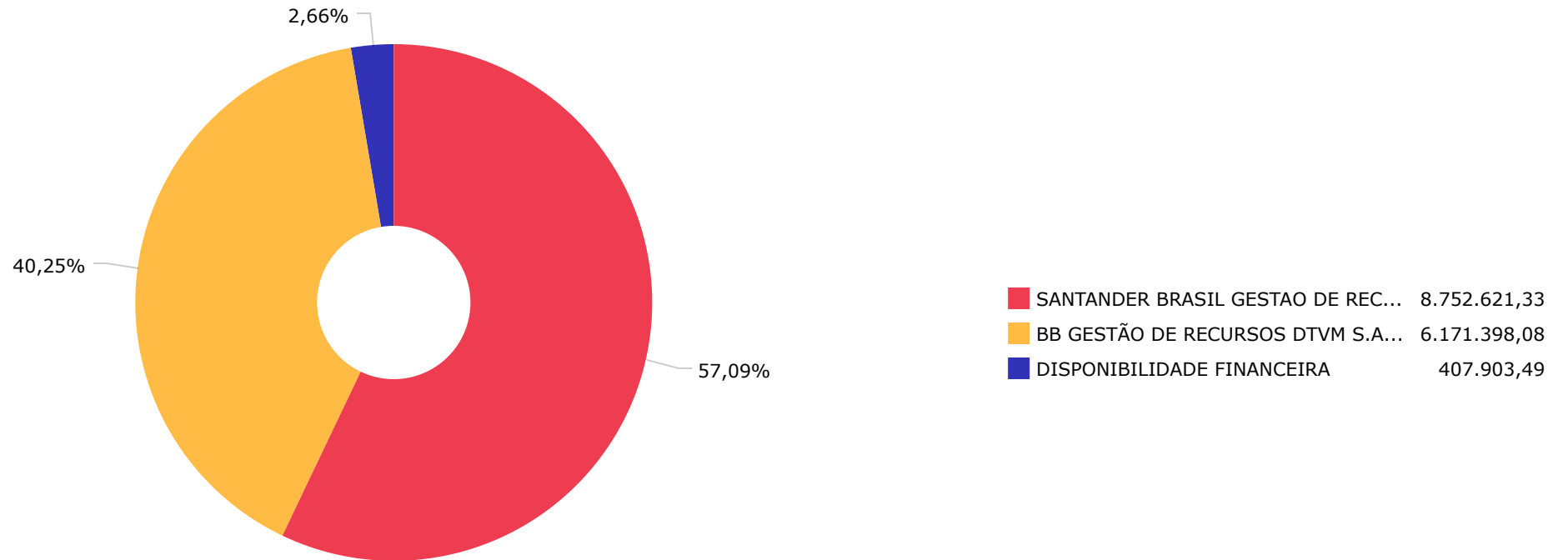
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|------------------------------|-------|----------|--------|----------|--------------|
| 8° I - Fundos de Ações | 6,84% | 0,00% | 24,00% | 30,00% | 3.457.053,41 |
| 9° III - Ações - BDR Nível I | 4,61% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 804.367,04 |
| 10° I - Fundos Multimercados | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 1.492.401,94 |

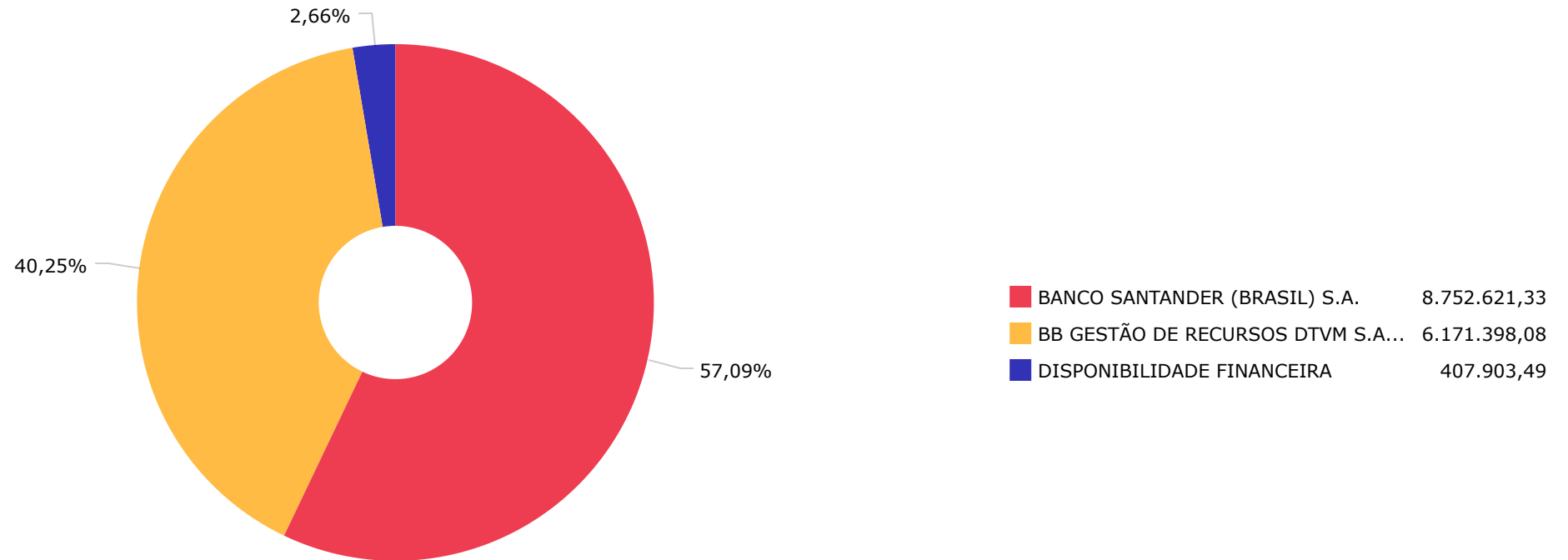
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| CDI - BENCHMARK | 1,12 | 12,37 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | | |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1,16 | 12,75 | 3,23 | 6,78 | 12,75 | 17,64 | 0,05 | 0,11 |
| GLOBAL BDRX - BENCHMARK | -4,22 | -28,05 | 3,94 | -0,61 | -28,05 | -3,84 | | |
| 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 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | -2,45 | 4,69 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | -2,61 | 3,29 | -1,06 | 10,77 | 3,29 | -10,61 | 9,69 | 20,40 |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | -2,62 | 2,43 | -1,12 | 9,89 | 2,43 | -9,39 | 10,03 | 21,13 |
| IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK | 1,24 | 9,34 | 2,25 | 2,34 | 9,34 | 14,78 | | |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,22 | 9,32 | 2,42 | 2,69 | 9,32 | 14,40 | 1,21 | 2,54 |
| IMA-B - BENCHMARK | -0,19 | 6,37 | 0,23 | 1,94 | 6,37 | 5,02 | | |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | -0,22 | 6,11 | 0,17 | 1,81 | 6,11 | 4,49 | 2,49 | 5,25 |
| 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 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 0,94 | 9,78 | 2,53 | 2,98 | 9,78 | 14,79 | | |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 0,92 | 9,57 | 2,48 | 2,88 | 9,57 | 14,33 | 1,15 | 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 |
| IMA-B 5+ - BENCHMARK | -1,19 | 3,30 | -1,72 | 1,24 | 3,30 | -3,47 | | |
| 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 |
| IPCA - BENCHMARK | 0,62 | 5,78 | 1,63 | 0,28 | 5,78 | 16,43 | | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,31 | 10,63 | 2,70 | 3,51 | 10,63 | 16,67 | 0,98 | 2,07 |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|-------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| IRF-M - BENCHMARK | 1,48 | 8,82 | 1,74 | 6,49 | 8,82 | 6,66 | | |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1,14 | 11,58 | 3,05 | 6,51 | 11,58 | 14,43 | 0,08 | 0,16 |
| IRF-M 1 - BENCHMARK | 1,18 | 12,02 | 3,16 | 6,70 | 12,02 | 15,30 | | |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,16 | 11,73 | 3,09 | 6,56 | 11,73 | 14,68 | 0,08 | 0,17 |









| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|---------------|-------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 12.993.963,74 | 2.583.996,20 | 2.981.265,11 | 12.635.597,66 | 38.902,83 | 38.902,83 | 0,30% ▲ | 0,30% | 0,95% | 0,95% | 31,58% | 2,37% |
| Fevereiro | 12.635.597,66 | 3.192.654,45 | 2.044.320,37 | 13.865.971,34 | 82.039,60 | 120.942,43 | 0,60% ▲ | 0,90% | 1,38% | 2,34% | 38,46% | 1,94% |
| Março | 13.865.971,34 | 1.005.315,38 | 419.325,00 | 14.800.543,57 | 348.581,85 | 469.524,28 | 2,41% ▲ | 3,33% | 2,05% | 4,44% | 75,00% | 2,49% |
| Abril | 14.800.543,57 | 3.698.664,66 | 3.976.351,59 | 14.488.968,94 | -33.887,70 | 435.636,58 | -0,23% ▼ | 3,09% | 1,43% | 5,93% | 52,11% | 1,14% |
| Mai | 14.488.968,94 | 1.532.089,12 | 1.346.000,00 | 14.836.284,33 | 161.226,27 | 596.862,85 | 1,10% ▲ | 4,23% | 0,90% | 6,88% | 61,48% | 2,37% |
| Junho | 14.836.284,33 | 79.545,86 | 495.423,50 | 14.268.612,24 | -151.794,45 | 445.068,40 | -1,02% ▼ | 3,16% | 1,08% | 8,03% | 39,35% | 2,28% |
| Julho | 14.268.612,24 | 1.705.715,56 | 2.000.000,00 | 14.061.543,00 | 87.215,20 | 532.283,60 | 0,61% ▲ | 3,79% | -0,28% | 7,73% | 49,03% | 2,22% |
| Agosto | 14.061.543,00 | 3.852.757,40 | 3.140.960,56 | 14.923.158,31 | 149.818,47 | 682.102,07 | 1,01% ▲ | 4,84% | 0,08% | 7,82% | 61,89% | 2,46% |
| Setembro | 14.923.158,31 | 2.155.535,61 | 2.500.000,00 | 14.667.853,24 | 89.159,32 | 771.261,39 | 0,60% ▲ | 5,47% | 0,11% | 7,94% | 68,89% | 2,47% |
| Outubro | 14.667.853,24 | 2.410.000,00 | 2.360.000,00 | 14.996.641,02 | 278.787,78 | 1.050.049,17 | 1,89% ▲ | 7,47% | 0,98% | 8,99% | 83,09% | 2,32% |
| Novembro | 14.996.641,02 | 3.084.367,50 | 2.592.799,69 | 15.479.010,52 | -9.198,31 | 1.040.850,86 | -0,06% ▼ | 7,40% | 0,80% | 9,86% | 75,05% | 3,49% |
| Dezembro | 15.479.010,52 | 2.202.611,28 | 2.784.270,24 | 14.924.019,41 | 26.667,85 | 1.067.518,71 | 0,17% ▲ | 7,59% | 1,05% | 11,01% | 68,94% | 2,20% |

Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$ | Retorno % | Meta % |
|---------|------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 469.524,28 | 3,33% | 4,44% |
| 2º Trim | -24.455,88 | -0,16% | 3,44% |
| 1º Sem | 445.068,40 | 3,16% | 8,03% |
| 3º Trim | 326.192,99 | 2,24% | -0,08% |
| 4º Trim | 296.257,32 | 2,01% | 2,85% |
| 2º Sem | 622.450,31 | 4,29% | 2,76% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

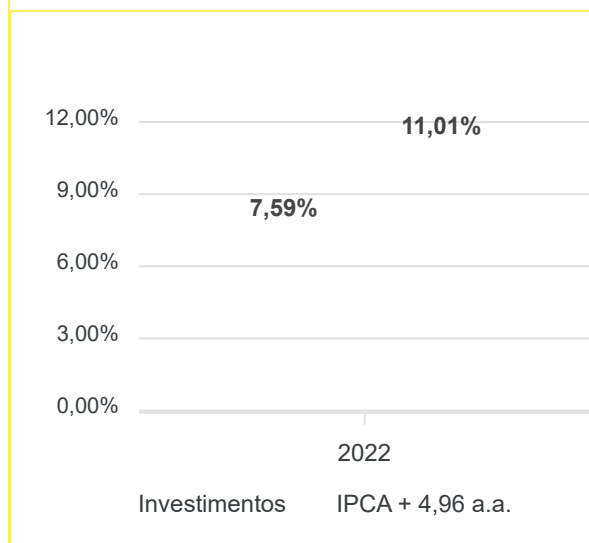
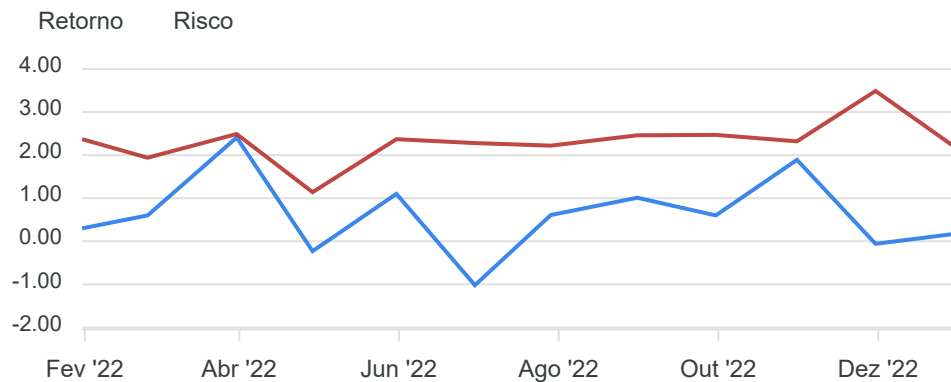
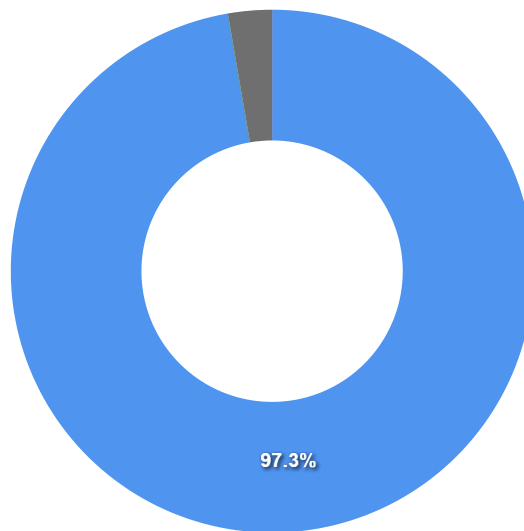


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/12/2022

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|---------------|-------|
| Até D+30 | 14.916.494,82 | 99,95 |
| Até D+180 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+360 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+720 | 415.428,08 | 2,78 |
| Até D+1800 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Acima D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Indeterminado | 0,00 | 0,00 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 489.222,47 | 0,00 | 0,00 | 495.184,22 | 5.961,75 | 1,22% ▲ | 1,21% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.165.340,09 | 0,00 | 0,00 | 1.175.988,49 | 10.648,40 | 0,91% ▲ | 1,14% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.079.829,80 | 0,00 | 0,00 | 1.066.989,38 | -12.840,42 | -1,19% ▼ | 3,82% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.938.645,20 | 0,00 | 0,00 | 1.934.417,03 | -4.228,17 | -0,22% ▼ | 2,47% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 119.336,60 | 0,00 | 0,00 | 120.717,42 | 1.380,82 | 1,16% ▲ | 0,08% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 410.043,67 | 0,00 | 0,00 | 415.428,08 | 5.384,41 | 1,31% ▲ | 0,98% |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 2.228.711,27 | 1.925.414,28 | 2.784.270,24 | 1.391.725,63 | 21.870,32 | 0,53% ▲ | 0,05% |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 3.597.023,05 | 277.197,00 | 0,00 | 3.910.812,22 | 36.592,17 | 0,94% ▲ | 1,15% |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 948.241,85 | 0,00 | 0,00 | 946.121,00 | -2.120,85 | -0,22% ▼ | 2,49% |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.738.604,00 | 0,00 | 0,00 | 1.758.448,63 | 19.844,63 | 1,14% ▲ | 0,08% |
| | 13.714.998,00 | 2.202.611,28 | 2.784.270,24 | 13.215.832,10 | 82.493,06 | 0,60% | 1,38% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 282.035,62 | 0,00 | 0,00 | 274.638,56 | -7.397,06 | -2,62% ▼ | 10,03% |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 765.527,12 | 0,00 | 0,00 | 745.513,85 | -20.013,27 | -2,61% ▼ | 9,69% |
| - | 1.047.562,74 | 0,00 | 0,00 | 1.020.152,41 | -27.410,33 | -2,62% | 9,78% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 716.449,78 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -28.414,88 | -3,97% ▼ | 6,70% |
| | 716.449,78 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -28.414,88 | -3,97% | 0,00% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|--------------|--------------|---------------|------------|-----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 483.475,78 | 0,00 | 0,00 | 495.184,22 | 11.708,44 | 2,42% ▲ |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.147.945,11 | 0,00 | 0,00 | 1.175.988,49 | 28.043,38 | 2,44% ▲ |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.086.448,87 | 0,00 | 0,00 | 1.066.989,38 | -19.459,49 | -1,79% ▼ |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.931.221,93 | 0,00 | 0,00 | 1.934.417,03 | 3.195,10 | 0,17% ▲ |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 117.103,47 | 0,00 | 0,00 | 120.717,42 | 3.613,95 | 3,09% ▲ |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 404.513,67 | 0,00 | 0,00 | 415.428,08 | 10.914,41 | 2,70% ▲ |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1.952.592,91 | 7.106.223,68 | 7.737.069,93 | 1.391.725,63 | 69.978,97 | 0,77% ▲ |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 3.232.692,68 | 590.755,10 | 0,00 | 3.910.812,22 | 87.364,44 | 2,28% ▲ |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 944.542,30 | 0,00 | 0,00 | 946.121,00 | 1.578,70 | 0,17% ▲ |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.706.347,47 | 0,00 | 0,00 | 1.758.448,63 | 52.101,16 | 3,05% ▲ |
| | 13.006.884,19 | 7.696.978,78 | 7.737.069,93 | 13.215.832,10 | 249.039,06 | 1,91% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 277.745,70 | 0,00 | 0,00 | 274.638,56 | -3.107,14 | -1,12% ▼ |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 753.478,13 | 0,00 | 0,00 | 745.513,85 | -7.964,28 | -1,06% ▼ |
| | 1.031.223,83 | 0,00 | 0,00 | 1.020.152,41 | -11.071,42 | -1,07% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 629.745,22 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | 58.289,68 | 9,26% ▲ |
| | 629.745,22 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | 58.289,68 | 9,26% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|---------------|---------------|---------------|--------------|-----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 452.962,11 | 0,00 | 0,00 | 495.184,22 | 42.222,11 | 9,32% ▲ |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 925.724,34 | 148.280,15 | 0,00 | 1.175.988,49 | 101.984,00 | 9,50% ▲ |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.036.458,50 | 0,00 | 0,00 | 1.066.989,38 | 30.530,88 | 2,95% ▲ |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.823.317,23 | 0,00 | 0,00 | 1.934.417,03 | 111.099,80 | 6,09% ▲ |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 108.043,50 | 0,00 | 0,00 | 120.717,42 | 12.673,92 | 11,73% ▲ |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.331.566,94 | 0,00 | 1.030.437,19 | 415.428,08 | 114.298,33 | 8,58% ▲ |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 2.153.085,40 | 24.555.931,00 | 25.610.278,87 | 1.391.725,63 | 292.988,10 | 1,10% ▲ |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 1.080.061,06 | 2.632.307,37 | 0,00 | 3.910.812,22 | 198.443,79 | 5,35% ▲ |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 891.628,81 | 0,00 | 0,00 | 946.121,00 | 54.492,19 | 6,11% ▲ |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.409.735,78 | 166.734,50 | 0,00 | 1.758.448,63 | 181.978,35 | 11,54% ▲ |
| | 11.212.583,67 | 27.503.253,02 | 26.640.716,06 | 13.215.832,10 | 1.140.711,47 | 9,45% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 268.134,53 | 0,00 | 0,00 | 274.638,56 | 6.504,03 | 2,43% ▲ |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 721.748,68 | 0,00 | 0,00 | 745.513,85 | 23.765,17 | 3,29% ▲ |
| | 989.883,21 | 0,00 | 0,00 | 1.020.152,41 | 30.269,20 | 3,06% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|-------------|-------------|-----------|
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 791.496,86 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -103.461,96 | -13,07% ▼ |
| | 791.496,86 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -103.461,96 | -13,07% |

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 | 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 | 987 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 7.489.389.892,90 |

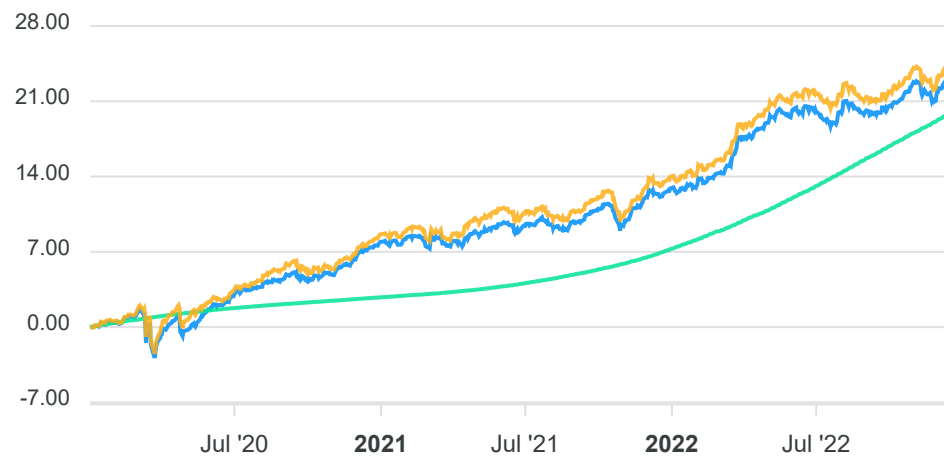
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IDKA IPCA 2 Anos |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

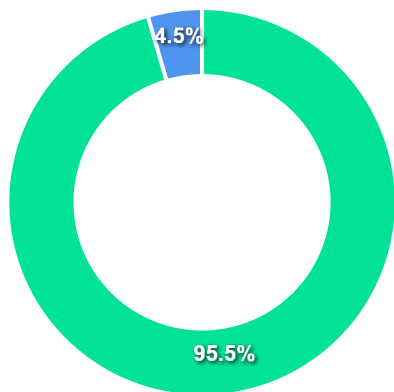
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,22% | 9,32% | 2,42% | 2,69% | 9,32% | 14,40% | 1,21% | 2,54% |
| Benchmark | 1,24% | 9,34% | 2,25% | 2,34% | 9,34% | 14,78% | | |
| CDI | 1,12% | 12,37% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 17,31% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 6.607.138,50 | 95.50% |
| Operação compromissada | 310.939,81 | 4.49% |
| Valores a pagar/receber | 175,00 | 0.00% |
| Outros | 80,32 | 0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 3.455.182,28 | 49,94 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 2.852.861,96 | 41,24 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 310.939,81 | 4,49 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 299.094,27 | 4,32 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 223,77 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 181,42 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 21,50 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,34 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,17 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,05 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -13,58 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -14,40 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -49,62 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -54,79 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -81,99 | 0,00 | Outros |

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 |

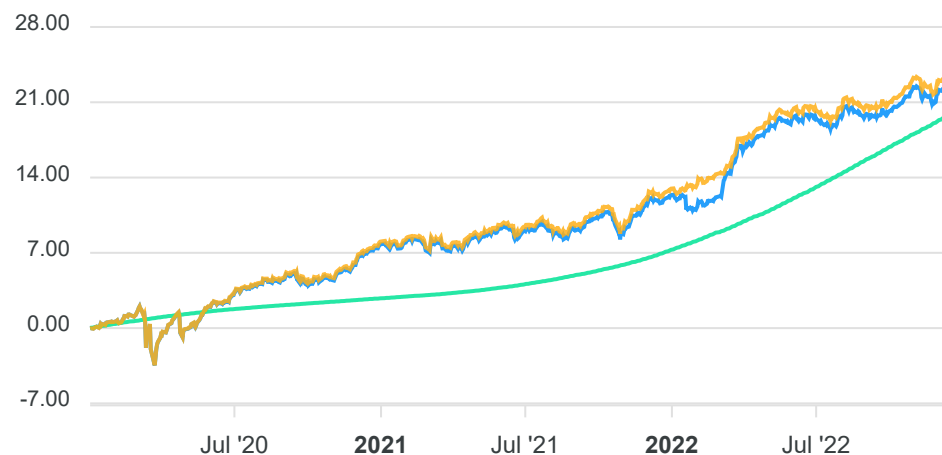
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| 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. |

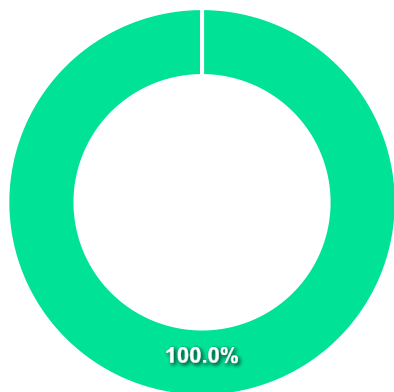
COMPARATIVO

📅 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 | 5.558.960,42 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 3,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -44,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 5.558.960,42 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -60,83 | -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. |

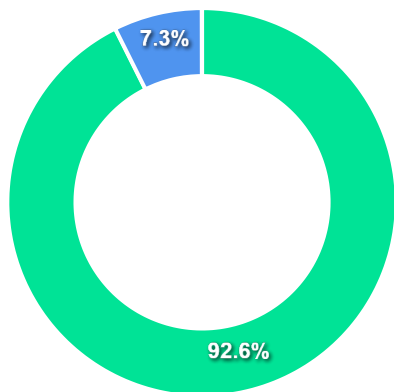
COMPARATIVO

📅 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 | 682.242,81 | 92.65% |
| Operação compromissada | 54.089,75 | 7.35% |
| Valores a pagar/receber | 184,00 | 0.02% |
| Outros | -111,14 | -0.02% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 139.690,76 | 18,97 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 111.165,66 | 15,10 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 99.050,75 | 13,45 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 92.948,14 | 12,62 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 90.152,94 | 12,24 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 61.380,00 | 8,34 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 54.089,75 | 7,35 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 40.267,68 | 5,47 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 30.636,87 | 4,16 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 16.950,02 | 2,30 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 204,72 | 0,03 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 2,57 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,60 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,03 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,01 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | -5,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -5,66 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -5,88 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -7,28 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -7,89 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -103,26 | -0,01 | Outros |

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. |

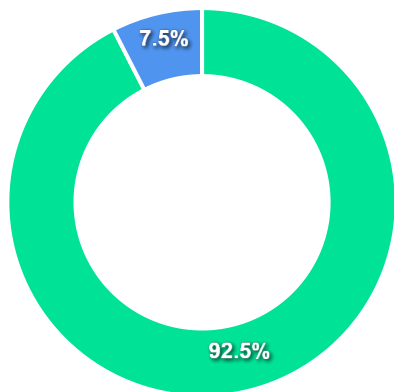
COMPARATIVO

📅 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 | 5.274.809,08 | 92.48% |
| Operação compromissada | 429.019,67 | 7.52% |
| Valores a pagar/receber | 166,36 | 0.00% |
| Outros | -99,29 | -0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 734.255,39 | 12,87 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 567.613,28 | 9,95 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 489.421,44 | 8,58 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 487.087,73 | 8,54 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 460.409,93 | 8,07 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 450.437,99 | 7,90 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 429.019,67 | 7,52 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 401.892,12 | 7,05 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 394.214,93 | 6,91 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 365.032,50 | 6,40 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 304.564,56 | 5,34 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 247.902,71 | 4,35 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 197.339,20 | 3,46 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 120.359,12 | 2,11 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 54.278,16 | 0,95 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 202,54 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 99,80 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 17,15 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,08 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -2,04 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -3,12 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -21,51 | 0,00 | Outros |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|--|
| Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+0 |
| Quantidade de Cotistas 1.114 |
| Patrimônio Líquido Fundo 6.516.931.621,39 |

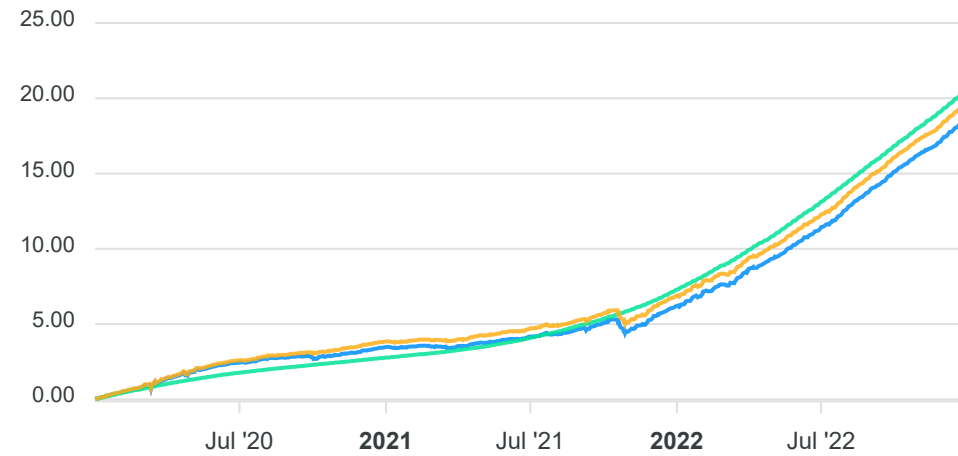
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M 1 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais. |

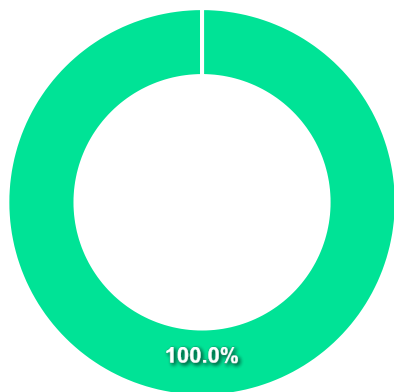
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 11,73% | 3,09% | 6,56% | 11,73% | 14,68% | 0,08% | 0,17% |
| Benchmark | 1,18% | 12,02% | 3,16% | 6,70% | 12,02% | 15,30% | | |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 6.481.908,92 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 25,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 6,49 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 6.481.908,92 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | 71,26 | 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 | 140 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 183.585.511,92 |

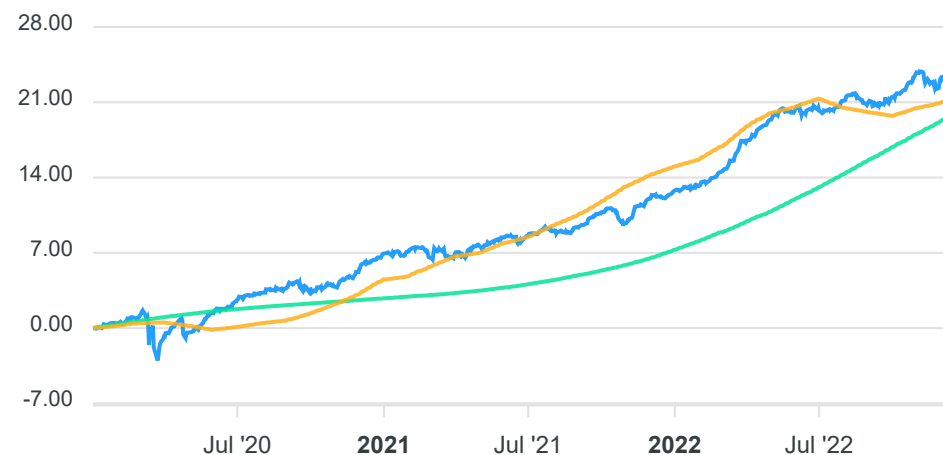
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IPCA |
| Classificação ANBIMA | Não classificado |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

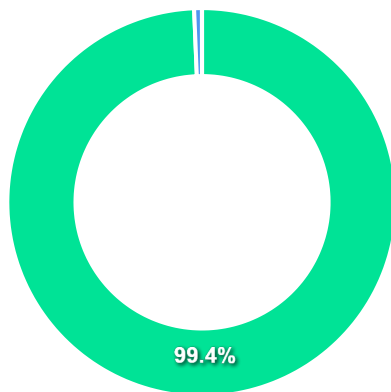
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,31% | 10,63% | 2,70% | 3,51% | 10,63% | 16,67% | 0,98% | 2,07% |
| 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 | 182.049,80 | 99,35 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 1.169,23 | 0,64 | Operação compromissada |
| Outras Disponibilidades | 35,94 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 6,96 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 0,47 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | -1,20 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -1,32 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -2,14 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | -4,52 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -4,73 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -8,42 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 182.049,80 | 99.35% |
| Operação compromissada | 1.169,23 | 0.64% |
| Valores a pagar/receber | 25,77 | 0.01% |
| Outros | -4,73 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 128 |
| Patrimônio Líquido Fundo 827.149.677,31 |

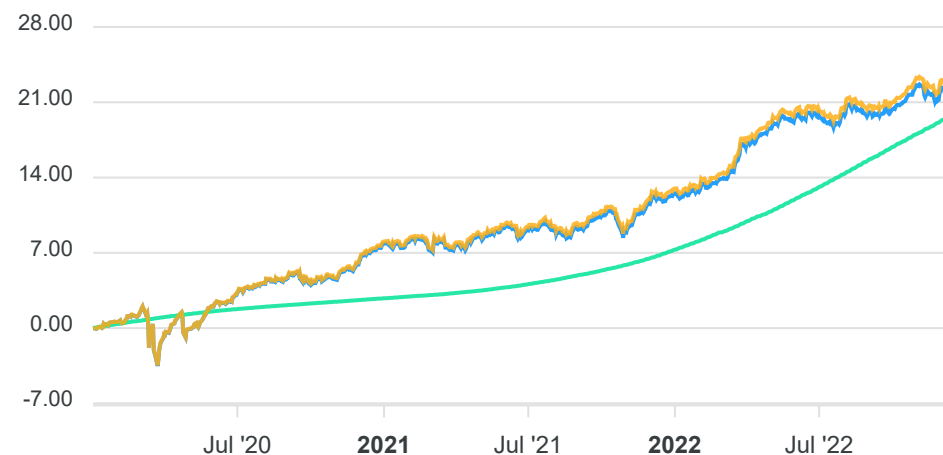
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B 5 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento. |

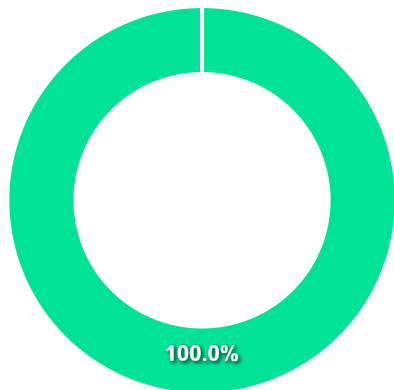
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,92% | 9,57% | 2,48% | 2,88% | 9,57% | 14,33% | 1,15% | 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 SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 835.890,44 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 61,52 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -119,74 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 835.890,44 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -53,22 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,20% |
| Taxa de Performance 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 126 |
| Patrimônio Líquido Fundo 564.735.869,38 |

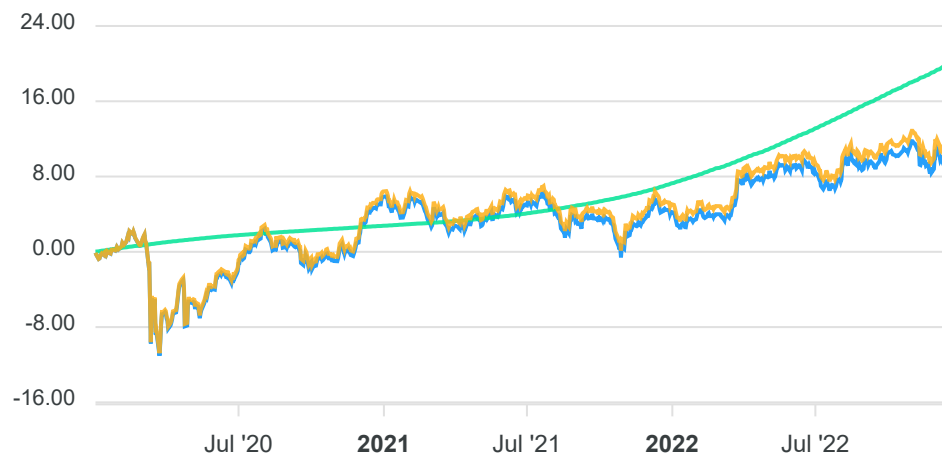
PERFIL DO FUNDO

| |
|---|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa. |

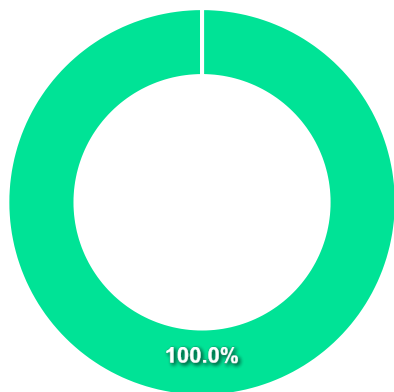
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | -0,22% | 6,11% | 0,17% | 1,81% | 6,11% | 4,49% | 2,49% | 5,25% |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP | 602.041,18 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 9,31 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -72,39 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 602.041,18 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -58,08 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,40% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 19 |
| Patrimônio Líquido Fundo 41.379.142,83 |

PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos. |

COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,14% | 11,58% | 3,05% | 6,51% | 11,58% | 14,43% | 0,08% | 0,16% |
| Benchmark | 1,48% | 8,82% | 1,74% | 6,49% | 8,82% | 6,66% | | |
| CDI | 1,12% | 12,37% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 17,31% | | |



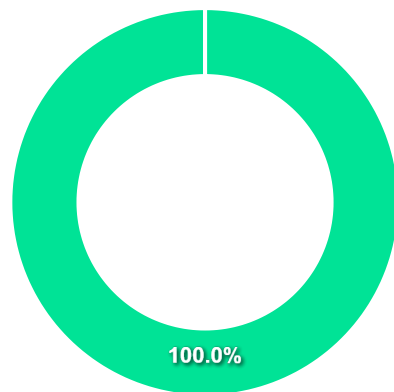
CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo

Vlr Ativo (mil)

Particip. (%)

Tipo Ativo



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|------------------------|----------------------|
| Fundos de Investimento | 41.960,61 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -0,54 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,30% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 158 |
| Patrimônio Líquido Fundo 396.851.061,29 |

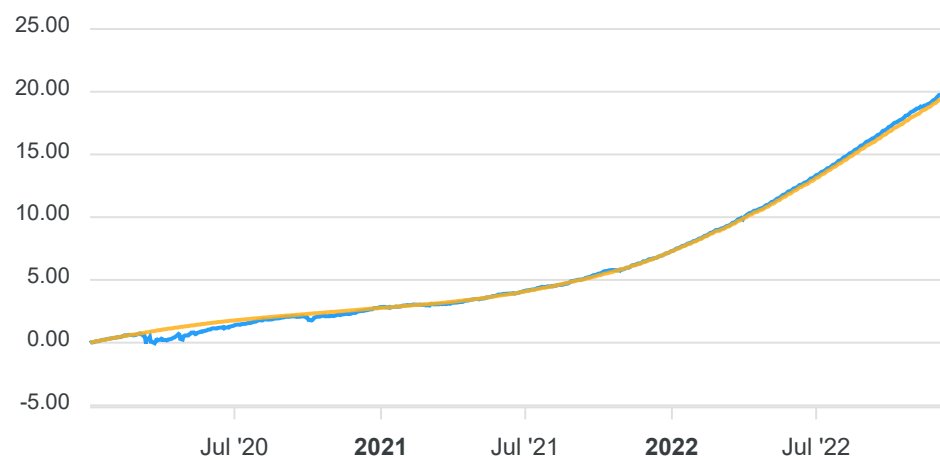
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A |
| Benchmark CDI |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais invistam em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de relacionados à variação das taxas de juros, pós ou pré-fixadas, de índices de preços, ou ambos. |

COMPARATIVO

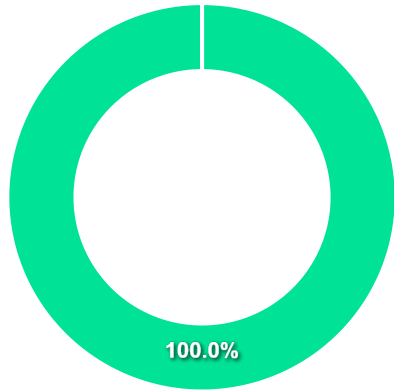
📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 12,75% | 3,23% | 6,78% | 12,75% | 17,64% | 0,05% | 0,11% |
| 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 |
|---------------|-----------------|---------------|------------|
|---------------|-----------------|---------------|------------|



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 347.074,06 | 100.04% |
| Valores a pagar/receber | -142,94 | -0.04% |

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

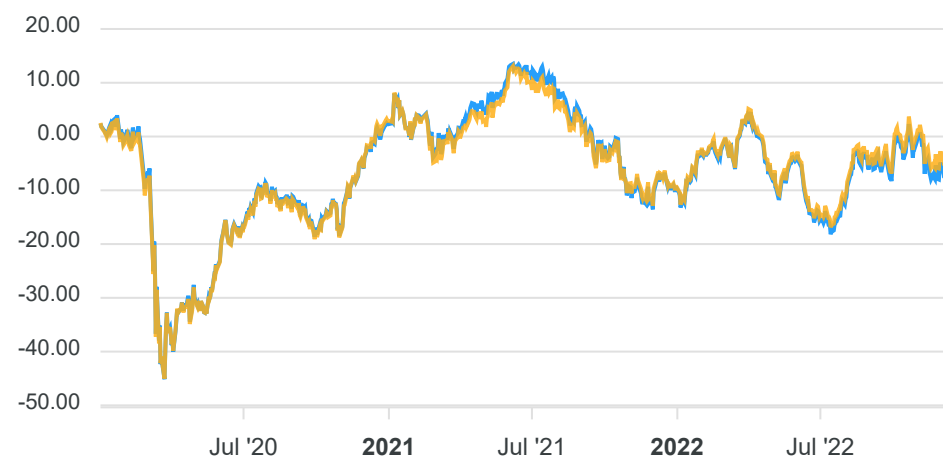
Classificação ANBIMA
Ações Sustentabilidade/Governança

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% | | |



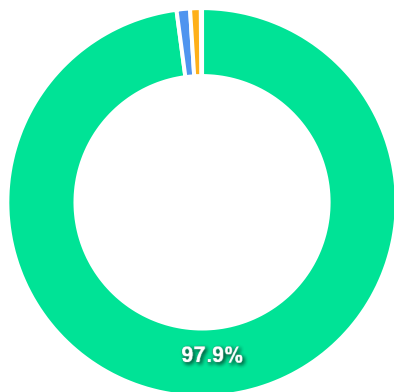
CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo

Vlr Ativo (mil)

Particip. (%)

Tipo Ativo



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|------------------------|----------------------|
| Ações | 766.546,77 | 97.90% |
| Valores a pagar/receber | 8.725,07 | 1.11% |
| Operação compromissada | 6.899,40 | 0.88% |
| Outros | 815,62 | 0.10% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,75% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+4 |
| Quantidade de Cotistas 35 |
| Patrimônio Líquido Fundo 308.702.229,09 |

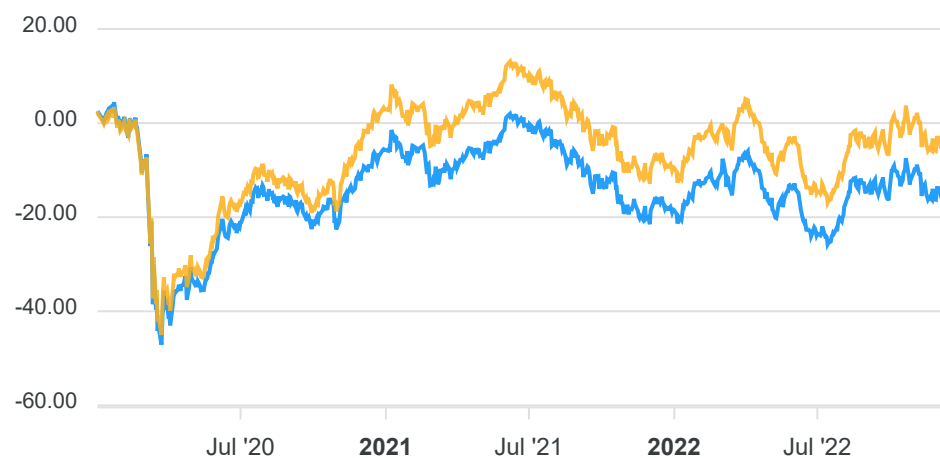
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 8º, Inciso I |
| Benchmark Ibovespa |
| Classificação ANBIMA Ações Índice Ativo |
| Política de Investimento Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III. |

COMPARATIVO

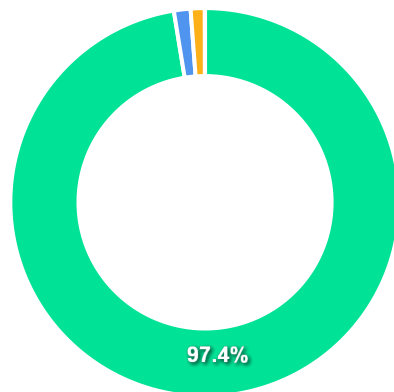
📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|-------|--------|--------|-------|---------|-----------|--------------------|
| Fundo | -2,61% | 3,29% | -1,06% | 10,77% | 3,29% | -10,61% | 9,69% | 20,40% |
| 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**



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|------------------------|----------------------|
| Ações | 321.432,35 | 97.43% |
| Operação compromissada | 4.555,31 | 1.38% |
| Valores a pagar/receber | 3.818,63 | 1.16% |
| Derivativos | 79,56 | 0.02% |
| Fundos de Investimento | 15,33 | 0.00% |

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 |

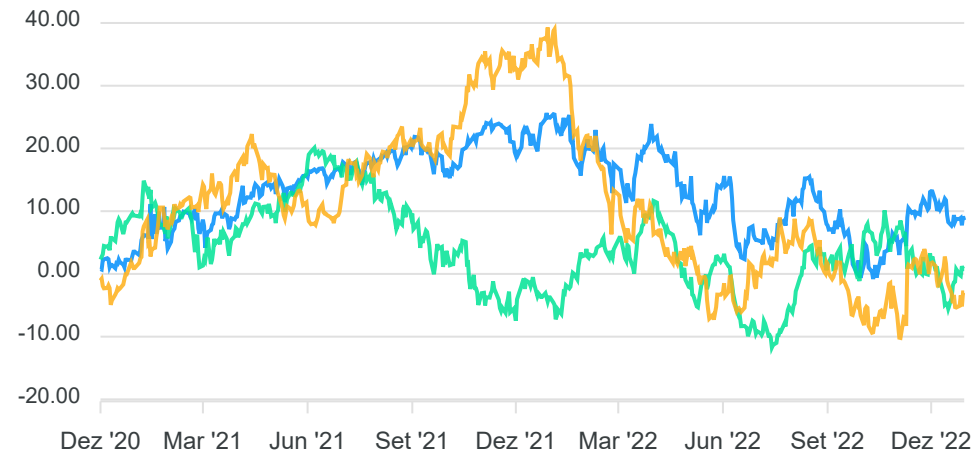
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| 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 FIC 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% | | |



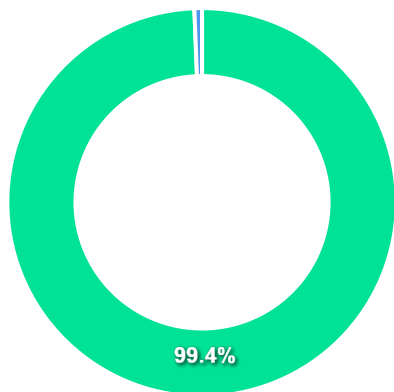
CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo

Vlr Ativo (mil)

Particip. (%)

Tipo Ativo



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 406.771,28 | 99.37% |
| Valores a pagar/receber | 2.589,86 | 0.63% |
| Outros | -6,21 | -0.00% |

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 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|---|--------------|------------|------------------|-------|----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 495.184,22 | 4,25% | 7.489.389.892,90 | 0,01% | 7º I b |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.175.988,49 | 10,09% | 5.613.586.065,55 | 0,02% | 7º I b |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.066.989,38 | 9,16% | 830.239.076,41 | 0,13% | 7º I b |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.934.417,03 | 16,60% | 6.078.064.149,48 | 0,03% | 7º I b |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 120.717,42 | 1,04% | 6.516.931.621,39 | 0,00% | 7º I b |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 3.202.056,51 | 27,49% | 827.149.677,31 | 0,39% | 7º I b |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 102.724,39 | 0,88% | 564.735.869,38 | 0,02% | 7º I b |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.758.448,63 | 15,09% | 41.379.142,83 | 4,25% | 7º I b |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 85.456,51 | 0,73% | 396.851.061,29 | 0,02% | 7º III a |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 274.638,56 | 2,36% | 844.496.837,07 | 0,03% | 8º I |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 745.513,85 | 6,40% | 308.702.229,09 | 0,24% | 8º I |
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 688.034,90 | 5,91% | 416.194.949,01 | 0,17% | 9º III |

Investimentos

\$ 11.650.169,89

Disponibilidades Financeiras

\$ 221.023,22

Total Carteira

\$ 11.871.193,11

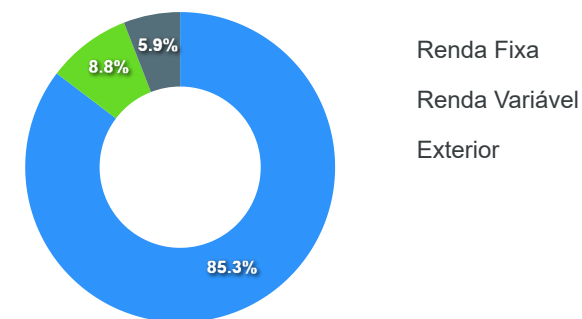
Governança (Pró Gestão)
 Não possui

| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Livre |
|--------------------------------|------------|-----------|--------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 83,03% | 2.014.667,04 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 0,72% | 7.037.259,36 |
| 8º I - Fundos de Ações | 30,00% | 8,59% | 2.541.205,52 |
| 9º III - Ações - BDR Nível I | 10,00% | 5,80% | 499.084,41 |

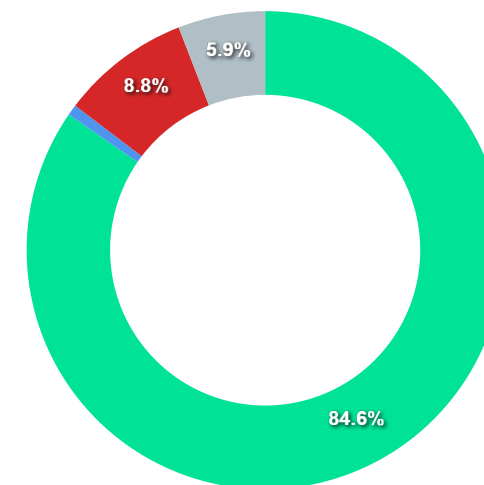
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos

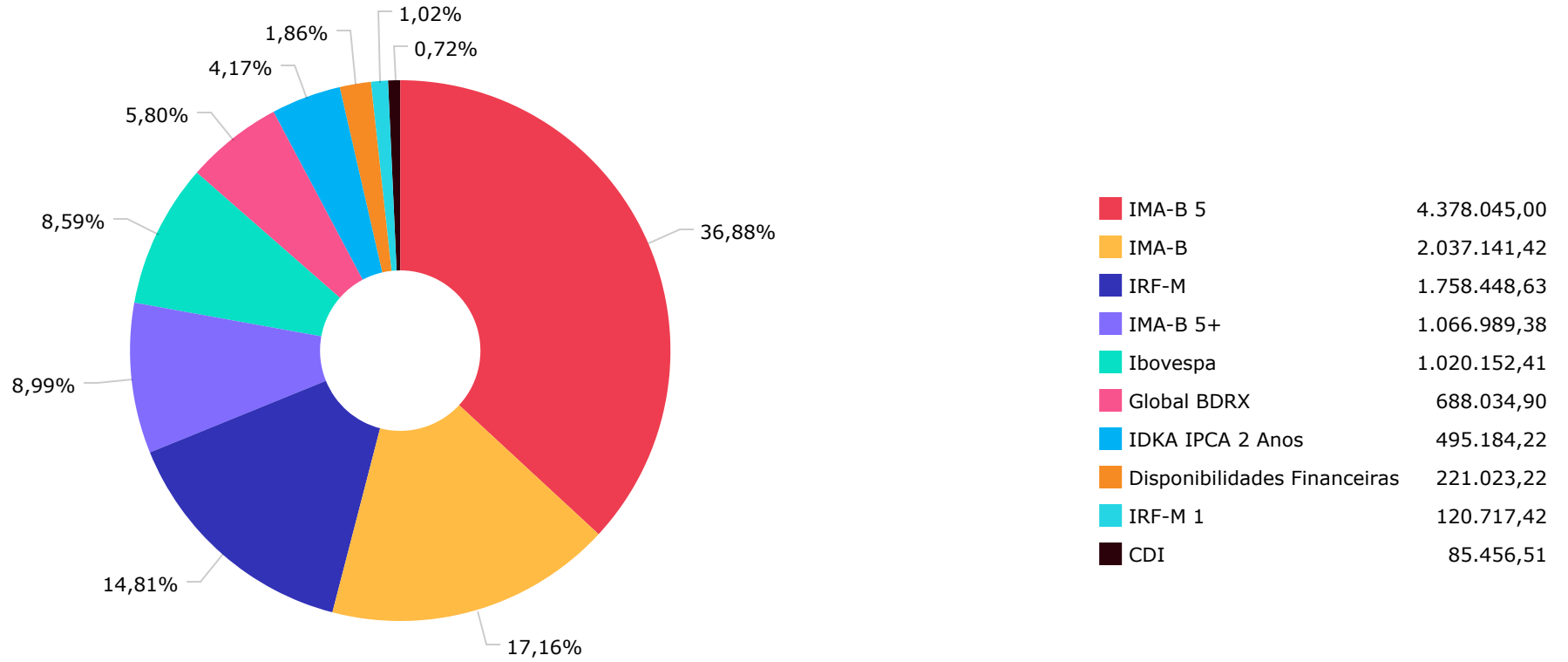


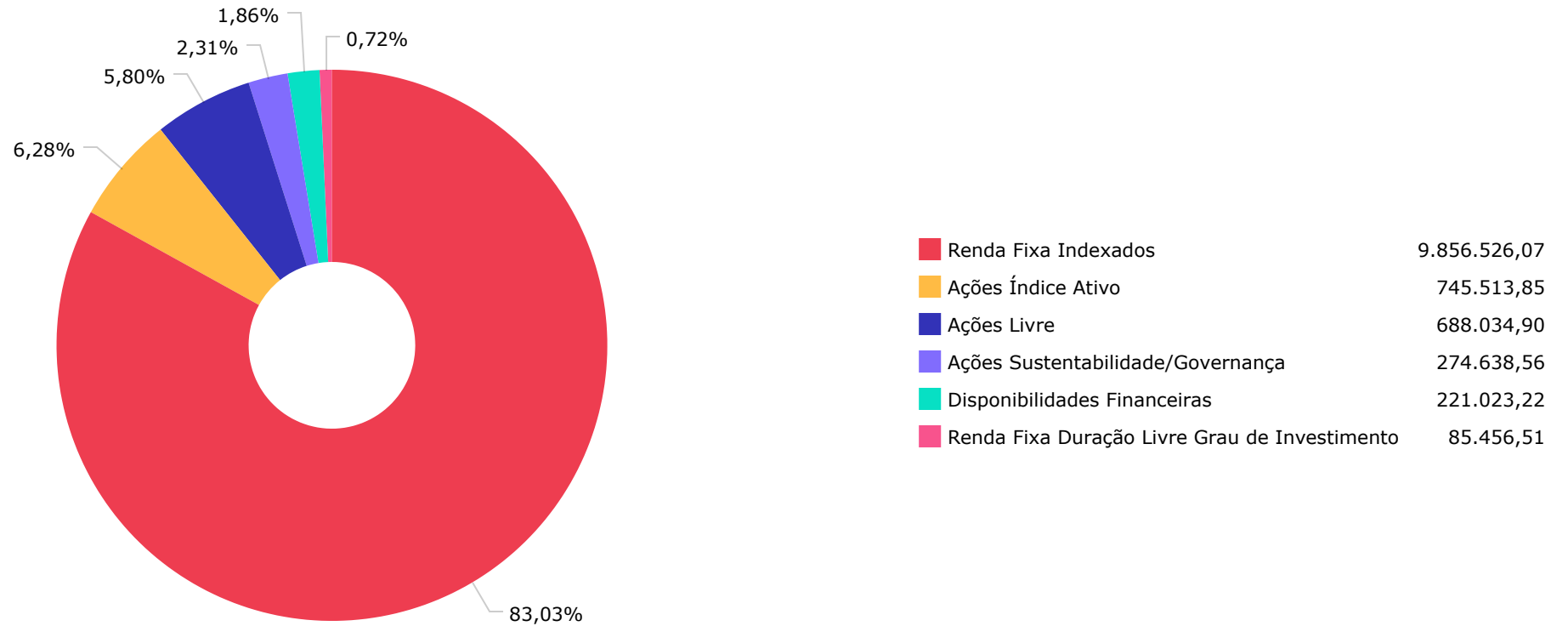
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|---------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 9,00% | 100,00% | 11.871.193,11 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 83,03% | 0,00% | 40,00% | 100,00% | 2.014.667,04 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 0,72% | 0,00% | 15,00% | 60,00% | 7.037.259,36 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 20,00% | 2.374.238,62 |

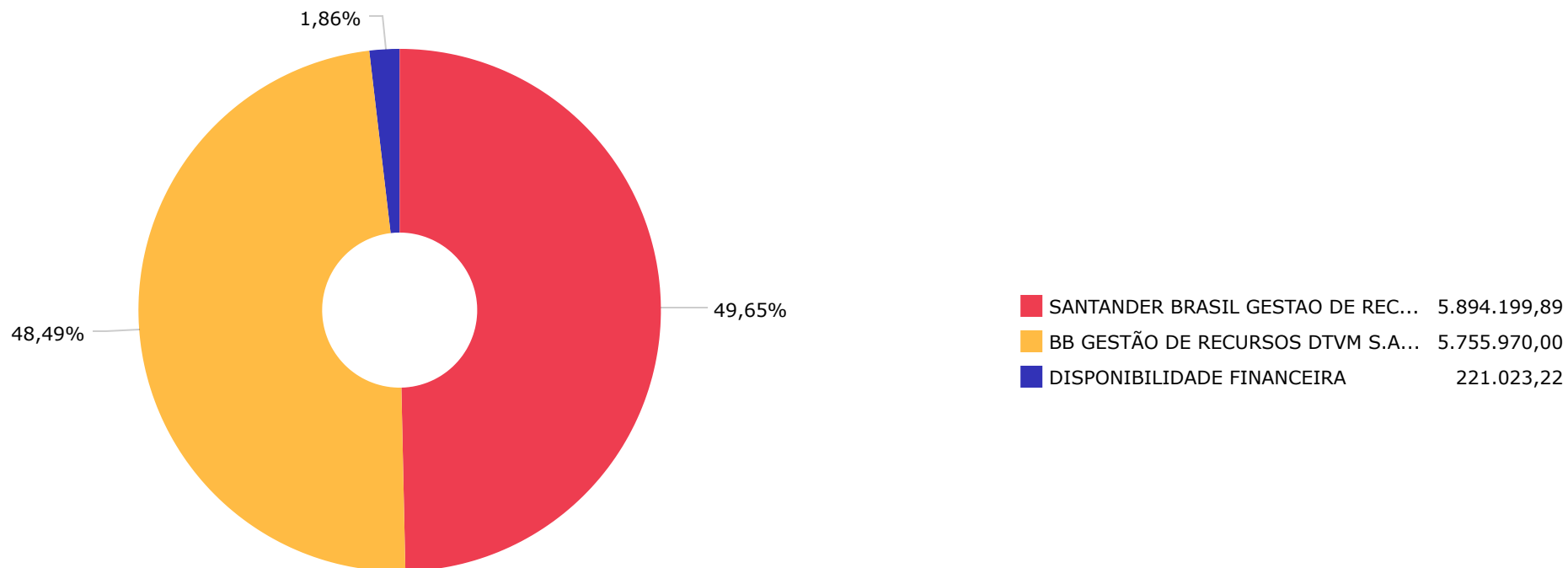
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|------------------------------|-------|----------|--------|----------|--------------|
| 8° I - Fundos de Ações | 8,59% | 0,00% | 24,00% | 30,00% | 2.541.205,52 |
| 9° III - Ações - BDR Nível I | 5,80% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 499.084,41 |
| 10° I - Fundos Multimercados | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 1.187.119,31 |

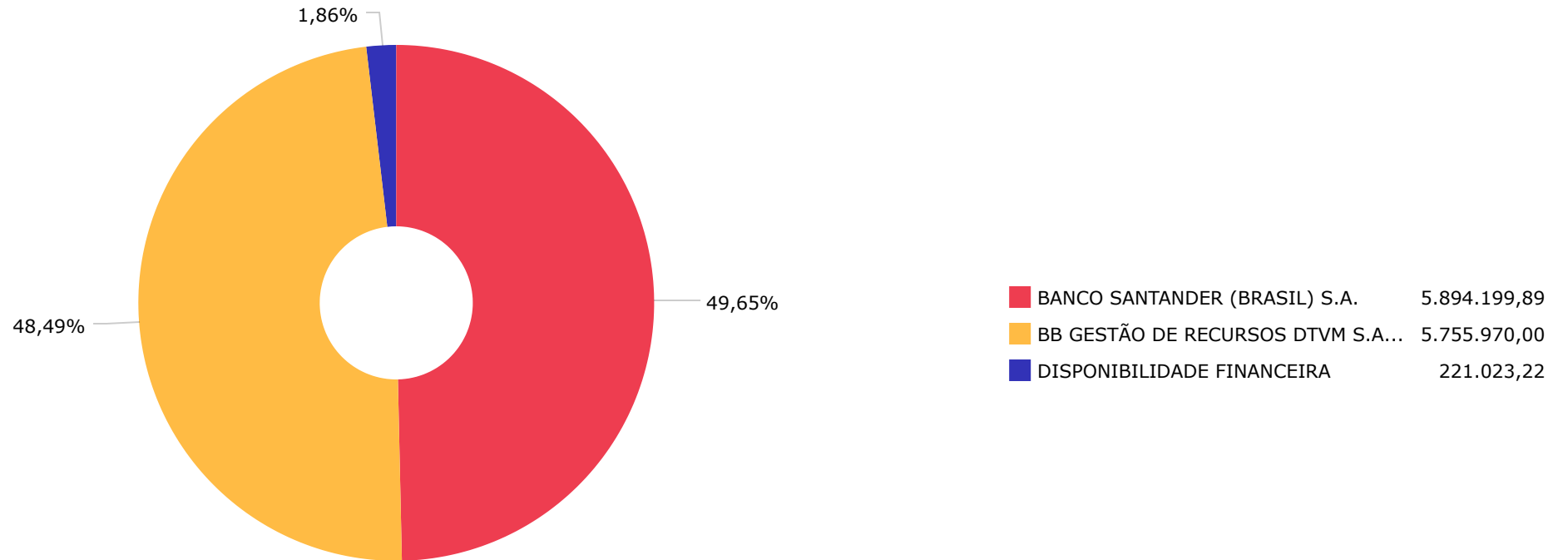
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| CDI - BENCHMARK | 1,12 | 12,37 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | | |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1,16 | 12,75 | 3,23 | 6,78 | 12,75 | 17,64 | 0,05 | 0,11 |
| GLOBAL BDRX - BENCHMARK | -4,22 | -28,05 | 3,94 | -0,61 | -28,05 | -3,84 | | |
| 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 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | -2,45 | 4,69 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | -2,61 | 3,29 | -1,06 | 10,77 | 3,29 | -10,61 | 9,69 | 20,40 |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | -2,62 | 2,43 | -1,12 | 9,89 | 2,43 | -9,39 | 10,03 | 21,13 |
| IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK | 1,24 | 9,34 | 2,25 | 2,34 | 9,34 | 14,78 | | |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,22 | 9,32 | 2,42 | 2,69 | 9,32 | 14,40 | 1,21 | 2,54 |
| IMA-B - BENCHMARK | -0,19 | 6,37 | 0,23 | 1,94 | 6,37 | 5,02 | | |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | -0,22 | 6,11 | 0,17 | 1,81 | 6,11 | 4,49 | 2,49 | 5,25 |
| 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 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 0,94 | 9,78 | 2,53 | 2,98 | 9,78 | 14,79 | | |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 0,92 | 9,57 | 2,48 | 2,88 | 9,57 | 14,33 | 1,15 | 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 |
| IMA-B 5+ - BENCHMARK | -1,19 | 3,30 | -1,72 | 1,24 | 3,30 | -3,47 | | |
| 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 |
| IPCA - BENCHMARK | 0,62 | 5,78 | 1,63 | 0,28 | 5,78 | 16,43 | | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,31 | 10,63 | 2,70 | 3,51 | 10,63 | 16,67 | 0,98 | 2,07 |

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|-------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| IRF-M - BENCHMARK | 1,48 | 8,82 | 1,74 | 6,49 | 8,82 | 6,66 | | |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1,14 | 11,58 | 3,05 | 6,51 | 11,58 | 14,43 | 0,08 | 0,16 |
| IRF-M 1 - BENCHMARK | 1,18 | 12,02 | 3,16 | 6,70 | 12,02 | 15,30 | | |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,16 | 11,73 | 3,09 | 6,56 | 11,73 | 14,68 | 0,08 | 0,17 |









| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|------------|----------|---------------|-------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 8.714.490,53 | 315.014,65 | 0,00 | 9.046.335,66 | 16.830,48 | 16.830,48 | 0,19% ▲ | 0,19% | 0,95% | 0,95% | 20,00% | 3,01% |
| Fevereiro | 9.046.335,66 | 155.349,53 | 0,00 | 9.246.328,88 | 44.643,69 | 61.474,17 | 0,49% ▲ | 0,67% | 1,38% | 2,34% | 28,63% | 2,66% |
| Março | 9.246.328,88 | 155.315,38 | 0,00 | 9.668.589,15 | 266.944,89 | 328.419,06 | 2,84% ▲ | 3,53% | 2,05% | 4,44% | 79,50% | 3,45% |
| Abril | 9.668.589,15 | 198.664,66 | 0,00 | 9.774.730,10 | -92.523,71 | 235.895,35 | -0,94% ▼ | 2,56% | 1,43% | 5,93% | 43,17% | 1,54% |
| Mai | 9.774.730,10 | 166.661,83 | 0,00 | 10.056.827,68 | 115.435,75 | 351.331,10 | 1,16% ▲ | 3,75% | 0,90% | 6,88% | 54,51% | 3,15% |
| Junho | 10.056.827,68 | 79.545,86 | 0,00 | 9.964.775,24 | -171.598,30 | 179.732,80 | -1,69% ▼ | 1,99% | 1,08% | 8,03% | 24,78% | 2,85% |
| Julho | 9.964.775,24 | 165.552,99 | 0,00 | 10.195.424,38 | 65.096,15 | 244.828,95 | 0,64% ▲ | 2,65% | -0,28% | 7,73% | 34,28% | 2,68% |
| Agosto | 10.195.424,38 | 255.790,83 | 0,00 | 10.557.126,06 | 105.910,85 | 350.739,80 | 1,01% ▲ | 3,69% | 0,08% | 7,82% | 47,19% | 3,11% |
| Setembro | 10.557.126,06 | 192.704,62 | 0,00 | 10.787.107,03 | 37.276,35 | 388.016,15 | 0,35% ▲ | 4,05% | 0,11% | 7,94% | 51,01% | 3,02% |
| Outubro | 10.787.107,03 | 0,00 | 0,00 | 11.008.646,59 | 221.539,56 | 609.555,71 | 2,05% ▲ | 6,19% | 0,98% | 8,99% | 68,85% | 2,95% |
| Novembro | 11.008.646,59 | 303.558,10 | 0,00 | 11.292.700,85 | -19.503,84 | 590.051,87 | -0,17% ▼ | 6,00% | 0,80% | 9,86% | 60,85% | 4,22% |
| Dezembro | 11.292.700,85 | 362.611,28 | 0,00 | 11.650.169,89 | -5.142,24 | 584.909,63 | -0,04% ▼ | 5,96% | 1,05% | 11,01% | 54,13% | 2,53% |

Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$ | Retorno % | Meta % |
|---------|-------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 328.419,06 | 3,53% | 4,44% |
| 2º Trim | -148.686,26 | -1,48% | 3,44% |
| 1º Sem | 179.732,80 | 1,99% | 8,03% |
| 3º Trim | 208.283,35 | 2,02% | -0,08% |
| 4º Trim | 196.893,48 | 1,83% | 2,85% |
| 2º Sem | 405.176,83 | 3,88% | 2,76% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

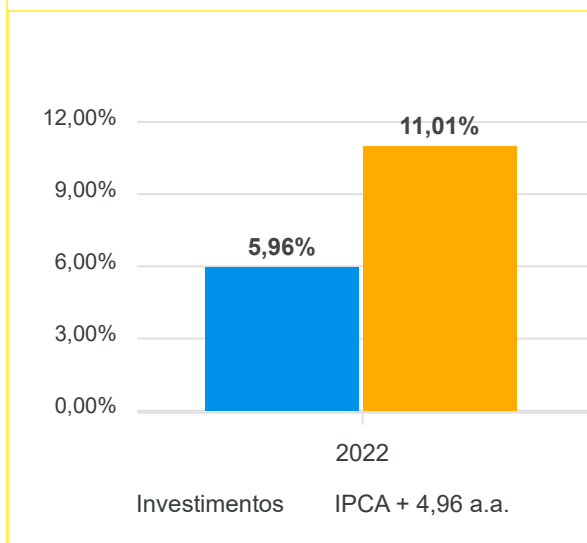


Gráfico Risco x Retorno

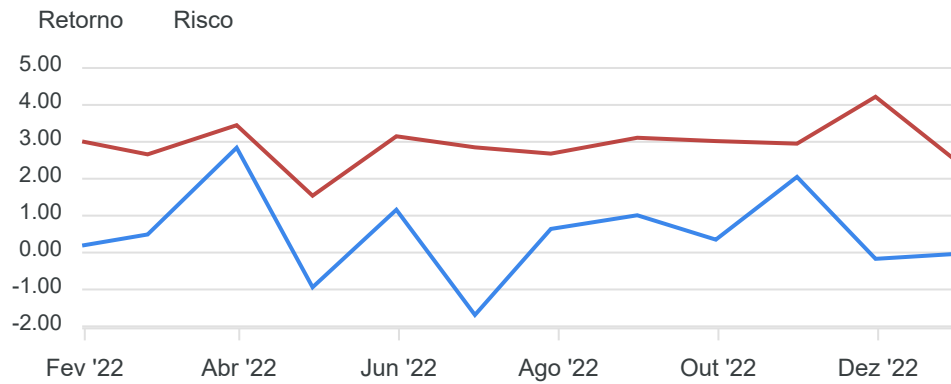
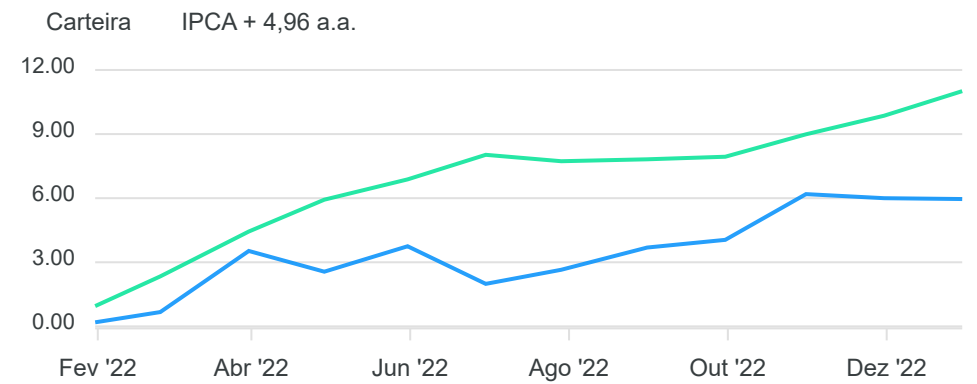
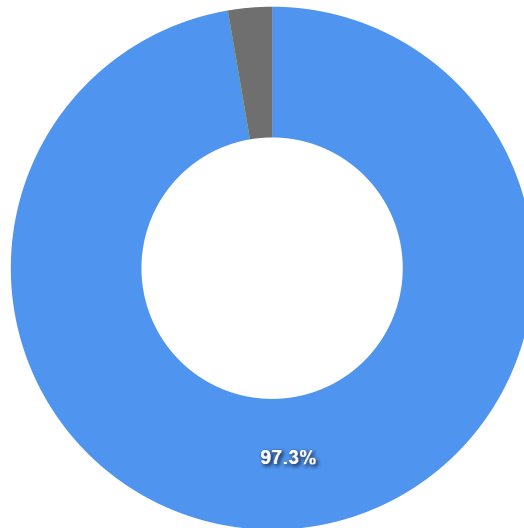


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/12/2022

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|---------------|--------|
| Até D+30 | 14.916.494,82 | 128,04 |
| Até D+180 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+360 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+720 | 415.428,08 | 3,57 |
| Até D+1800 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Acima D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Indeterminado | 0,00 | 0,00 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|---------------------|-------------------|-------------|---------------------|------------------|--------------|--------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 489.222,47 | 0,00 | 0,00 | 495.184,22 | 5.961,75 | 1,22% ▲ | 1,21% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.165.340,09 | 0,00 | 0,00 | 1.175.988,49 | 10.648,40 | 0,91% ▲ | 1,14% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.079.829,80 | 0,00 | 0,00 | 1.066.989,38 | -12.840,42 | -1,19% ▼ | 3,82% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.938.645,20 | 0,00 | 0,00 | 1.934.417,03 | -4.228,17 | -0,22% ▼ | 2,47% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 119.336,60 | 0,00 | 0,00 | 120.717,42 | 1.380,82 | 1,16% ▲ | 0,08% |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 2.894.755,51 | 277.197,00 | 0,00 | 3.202.056,51 | 30.104,00 | 0,95% ▲ | 1,15% |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 102.954,66 | 0,00 | 0,00 | 102.724,39 | -230,27 | -0,22% ▼ | 2,49% |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.738.604,00 | 0,00 | 0,00 | 1.758.448,63 | 19.844,63 | 1,14% ▲ | 0,08% |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 0,00 | 85.414,28 | 0,00 | 85.456,51 | 42,23 | 0,05% ▲ | 0,05% |
| | 9.528.688,33 | 362.611,28 | 0,00 | 9.941.982,58 | 50.682,97 | 0,51% | 1,50% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 282.035,62 | 0,00 | 0,00 | 274.638,56 | -7.397,06 | -2,62% ▼ | 10,03% |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 765.527,12 | 0,00 | 0,00 | 745.513,85 | -20.013,27 | -2,61% ▼ | 9,69% |
| - | 1.047.562,74 | 0,00 | 0,00 | 1.020.152,41 | -27.410,33 | -2,62% | 9,78% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|-------------|
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 716.449,78 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -28.414,88 | -3,97% ▼ | 6,70% |
| | 716.449,78 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -28.414,88 | -3,97% | 0,00% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 483.475,78 | 0,00 | 0,00 | 495.184,22 | 11.708,44 | 2,42% ▲ |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1.147.945,11 | 0,00 | 0,00 | 1.175.988,49 | 28.043,38 | 2,44% ▲ |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.086.448,87 | 0,00 | 0,00 | 1.066.989,38 | -19.459,49 | -1,79% ▼ |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.931.221,93 | 0,00 | 0,00 | 1.934.417,03 | 3.195,10 | 0,17% ▲ |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 117.103,47 | 0,00 | 0,00 | 120.717,42 | 3.613,95 | 3,09% ▲ |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 0,00 | 85.414,28 | 0,00 | 85.456,51 | 42,23 | 0,05% ▲ |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 2.551.042,36 | 580.755,10 | 0,00 | 3.202.056,51 | 70.259,05 | 2,24% ▲ |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 102.552,99 | 0,00 | 0,00 | 102.724,39 | 171,40 | 0,17% ▲ |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.706.347,47 | 0,00 | 0,00 | 1.758.448,63 | 52.101,16 | 3,05% ▲ |
| | 9.126.137,98 | 666.169,38 | 0,00 | 9.941.982,58 | 149.675,22 | 1,53% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 277.745,70 | 0,00 | 0,00 | 274.638,56 | -3.107,14 | -1,12% ▼ |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 753.478,13 | 0,00 | 0,00 | 745.513,85 | -7.964,28 | -1,06% ▼ |
| | 1.031.223,83 | 0,00 | 0,00 | 1.020.152,41 | -11.071,42 | -1,07% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|-------------|------------|-----------|
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 629.745,22 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | 58.289,68 | 9,26% ▲ |
| | 629.745,22 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | 58.289,68 | 9,26% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|---------------------|---------------------|-------------|---------------------|-------------------|--------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 452.962,11 | 0,00 | 0,00 | 495.184,22 | 42.222,11 | 9,32% ▲ |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 925.724,34 | 148.280,15 | 0,00 | 1.175.988,49 | 101.984,00 | 9,50% ▲ |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.036.458,50 | 0,00 | 0,00 | 1.066.989,38 | 30.530,88 | 2,95% ▲ |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.823.317,23 | 0,00 | 0,00 | 1.934.417,03 | 111.099,80 | 6,09% ▲ |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 108.043,50 | 0,00 | 0,00 | 120.717,42 | 12.673,92 | 11,73% ▲ |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 0,00 | 85.414,28 | 0,00 | 85.456,51 | 42,23 | 0,05% ▲ |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 1.080.061,06 | 1.950.340,80 | 0,00 | 3.202.056,51 | 171.654,65 | 5,66% ▲ |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 96.807,94 | 0,00 | 0,00 | 102.724,39 | 5.916,45 | 6,11% ▲ |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1.409.735,78 | 166.734,50 | 0,00 | 1.758.448,63 | 181.978,35 | 11,54% ▲ |
| | 6.933.110,46 | 2.350.769,73 | 0,00 | 9.941.982,58 | 658.102,39 | 7,09% |

| RENDA VARIÁVEL | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | 268.134,53 | 0,00 | 0,00 | 274.638,56 | 6.504,03 | 2,43% ▲ |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 721.748,68 | 0,00 | 0,00 | 745.513,85 | 23.765,17 | 3,29% ▲ |
| | 989.883,21 | 0,00 | 0,00 | 1.020.152,41 | 30.269,20 | 3,06% |

| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|----------|-------------|-------------|-----------|
| BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I | 791.496,86 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -103.461,96 | -13,07% ▼ |
| | 791.496,86 | 0,00 | 0,00 | 688.034,90 | -103.461,96 | -13,07% |

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 | 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 | 987 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 7.489.389.892,90 |

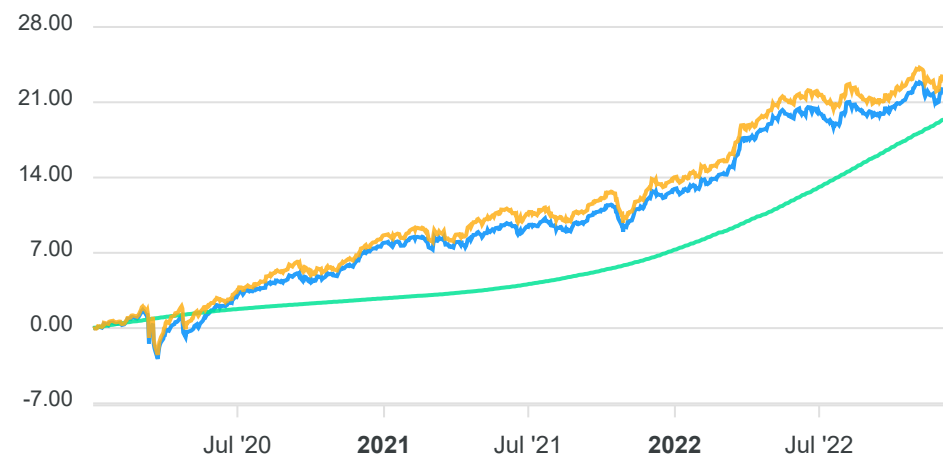
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IDKA IPCA 2 Anos |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

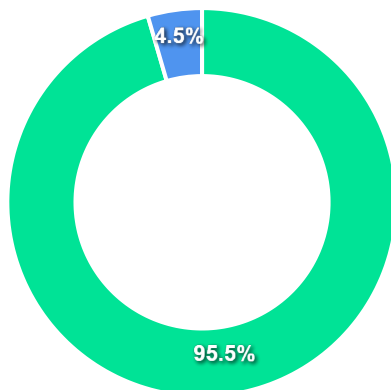
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,22% | 9,32% | 2,42% | 2,69% | 9,32% | 14,40% | 1,21% | 2,54% |
| Benchmark | 1,24% | 9,34% | 2,25% | 2,34% | 9,34% | 14,78% | | |
| CDI | 1,12% | 12,37% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 17,31% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 6.607.138,50 | 95.50% |
| Operação compromissada | 310.939,81 | 4.49% |
| Valores a pagar/receber | 175,00 | 0.00% |
| Outros | 80,32 | 0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 3.455.182,28 | 49,94 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 2.852.861,96 | 41,24 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 310.939,81 | 4,49 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 299.094,27 | 4,32 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 223,77 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 181,42 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 21,50 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,34 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,17 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,05 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -13,58 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -14,40 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -49,62 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -54,79 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -81,99 | 0,00 | Outros |

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 |

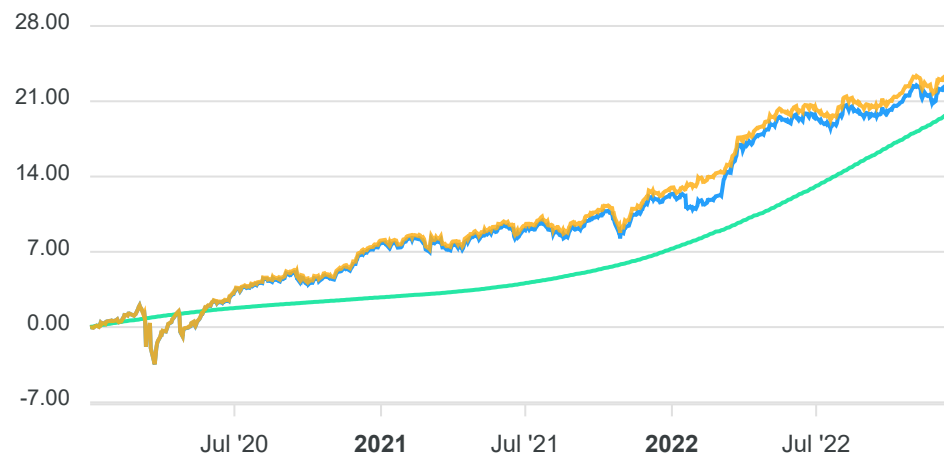
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| 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. |

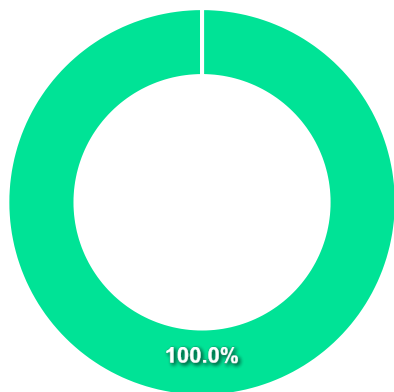
COMPARATIVO

📅 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 | 5.558.960,42 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 3,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -44,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 5.558.960,42 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -60,83 | -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. |

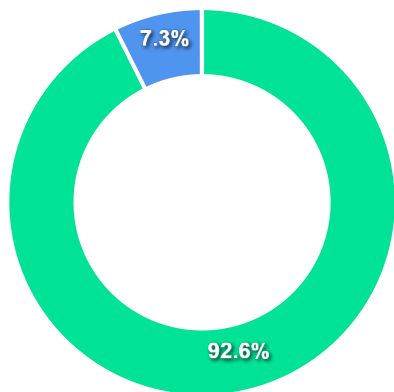
COMPARATIVO

📅 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 | 682.242,81 | 92.65% |
| Operação compromissada | 54.089,75 | 7.35% |
| Valores a pagar/receber | 184,00 | 0.02% |
| Outros | -111,14 | -0.02% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 139.690,76 | 18,97 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 111.165,66 | 15,10 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 99.050,75 | 13,45 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 92.948,14 | 12,62 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 90.152,94 | 12,24 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 61.380,00 | 8,34 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 54.089,75 | 7,35 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 40.267,68 | 5,47 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 30.636,87 | 4,16 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 16.950,02 | 2,30 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 204,72 | 0,03 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 2,57 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,60 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,03 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,01 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | -5,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -5,66 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -5,88 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -7,28 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -7,89 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -103,26 | -0,01 | Outros |

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. |

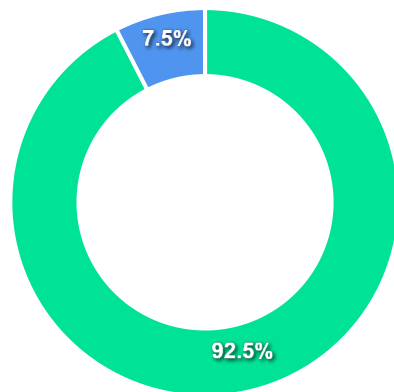
COMPARATIVO

📅 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 | 5.274.809,08 | 92.48% |
| Operação compromissada | 429.019,67 | 7.52% |
| Valores a pagar/receber | 166,36 | 0.00% |
| Outros | -99,29 | -0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 734.255,39 | 12,87 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 567.613,28 | 9,95 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 489.421,44 | 8,58 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 487.087,73 | 8,54 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 460.409,93 | 8,07 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 450.437,99 | 7,90 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 429.019,67 | 7,52 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 401.892,12 | 7,05 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 394.214,93 | 6,91 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 365.032,50 | 6,40 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 304.564,56 | 5,34 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 247.902,71 | 4,35 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 197.339,20 | 3,46 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 120.359,12 | 2,11 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 54.278,16 | 0,95 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 202,54 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 99,80 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 17,15 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,08 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -2,04 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -3,12 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -21,51 | 0,00 | Outros |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|--|
| Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+0 |
| Quantidade de Cotistas 1.114 |
| Patrimônio Líquido Fundo 6.516.931.621,39 |

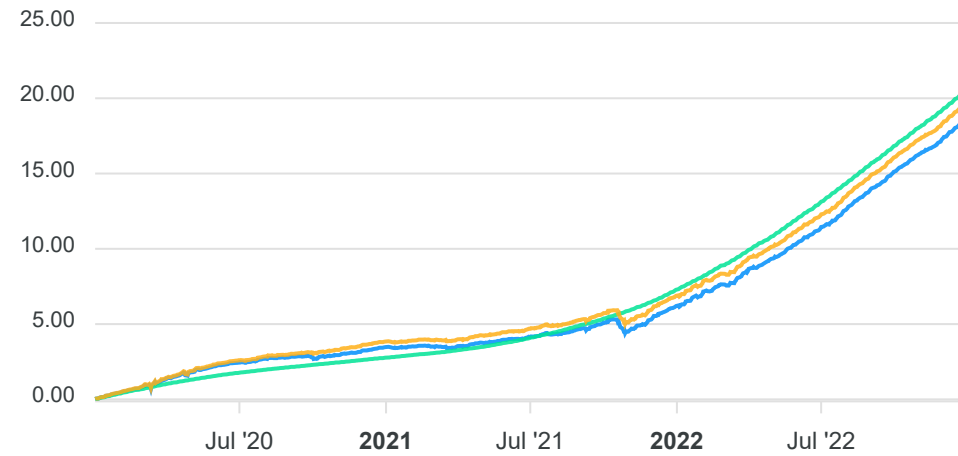
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M 1 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais. |

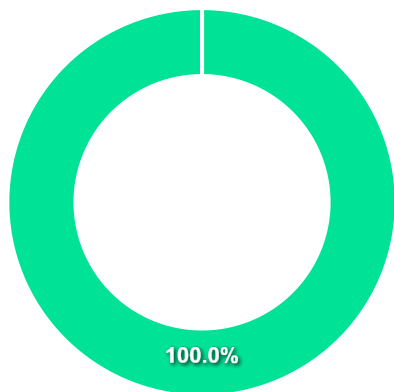
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 11,73% | 3,09% | 6,56% | 11,73% | 14,68% | 0,08% | 0,17% |
| Benchmark | 1,18% | 12,02% | 3,16% | 6,70% | 12,02% | 15,30% | | |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 6.481.908,92 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 25,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 6,49 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 6.481.908,92 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | 71,26 | 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 140 |
| Patrimônio Líquido Fundo 183.585.511,92 |

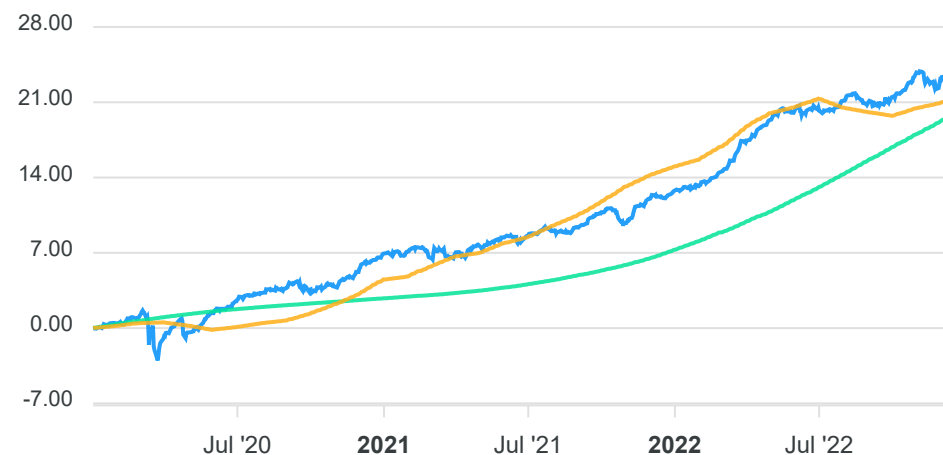
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IPCA |
| Classificação ANBIMA Não classificado |
| Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

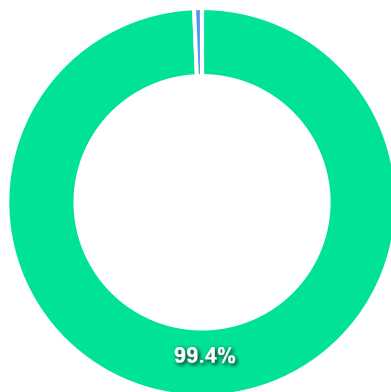
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,31% | 10,63% | 2,70% | 3,51% | 10,63% | 16,67% | 0,98% | 2,07% |
| 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 | 182.049,80 | 99,35 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 1.169,23 | 0,64 | Operação compromissada |
| Outras Disponibilidades | 35,94 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 6,96 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 0,47 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | -1,20 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -1,32 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -2,14 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | -4,52 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -4,73 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -8,42 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 182.049,80 | 99.35% |
| Operação compromissada | 1.169,23 | 0.64% |
| Valores a pagar/receber | 25,77 | 0.01% |
| Outros | -4,73 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 128 |
| Patrimônio Líquido Fundo 827.149.677,31 |

PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B 5 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento. |

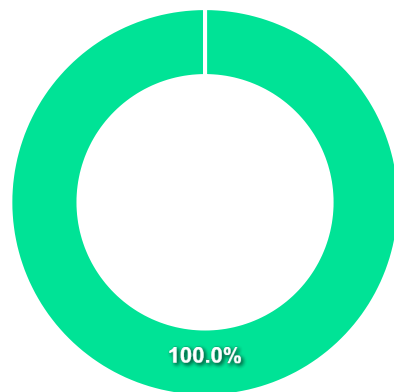
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,92% | 9,57% | 2,48% | 2,88% | 9,57% | 14,33% | 1,15% | 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 SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 835.890,44 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 61,52 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -119,74 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 835.890,44 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -53,22 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,20% |
| Taxa de Performance 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 126 |
| Patrimônio Líquido Fundo 564.735.869,38 |

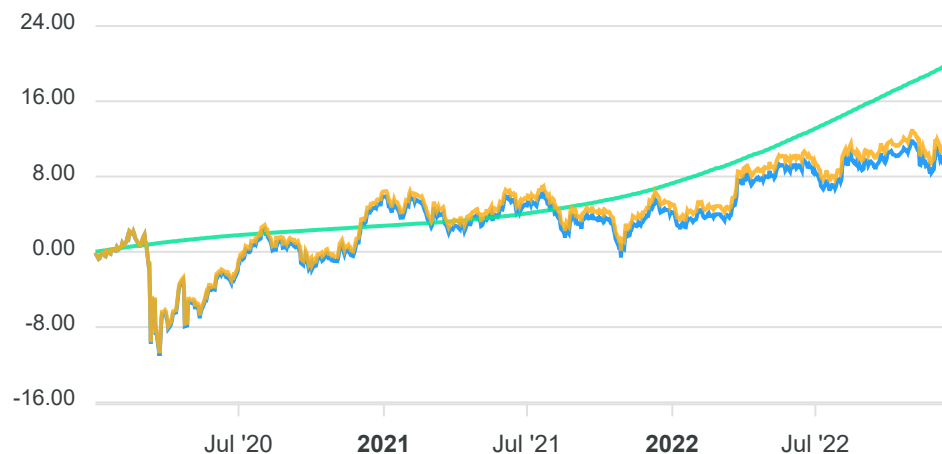
PERFIL DO FUNDO

| |
|---|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa. |

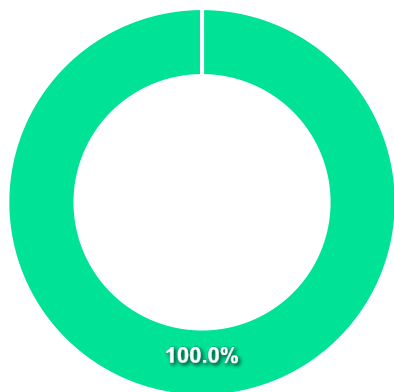
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | -0,22% | 6,11% | 0,17% | 1,81% | 6,11% | 4,49% | 2,49% | 5,25% |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP | 602.041,18 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 9,31 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -72,39 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 602.041,18 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -58,08 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,40% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 19 |
| Patrimônio Líquido Fundo 41.379.142,83 |

PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos. |

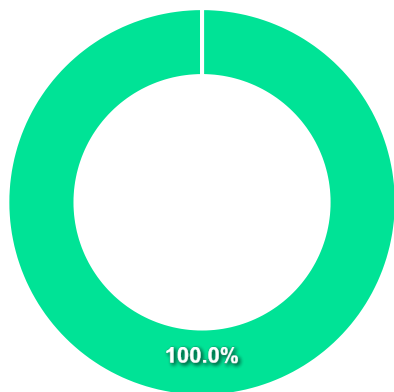
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,14% | 11,58% | 3,05% | 6,51% | 11,58% | 14,43% | 0,08% | 0,16% |
| Benchmark | 1,48% | 8,82% | 1,74% | 6,49% | 8,82% | 6,66% | | |
| 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 SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | 41.960,61 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 7,96 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -13,62 | -0,03 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 41.960,61 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -0,54 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,30% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 158 |
| Patrimônio Líquido Fundo 396.851.061,29 |

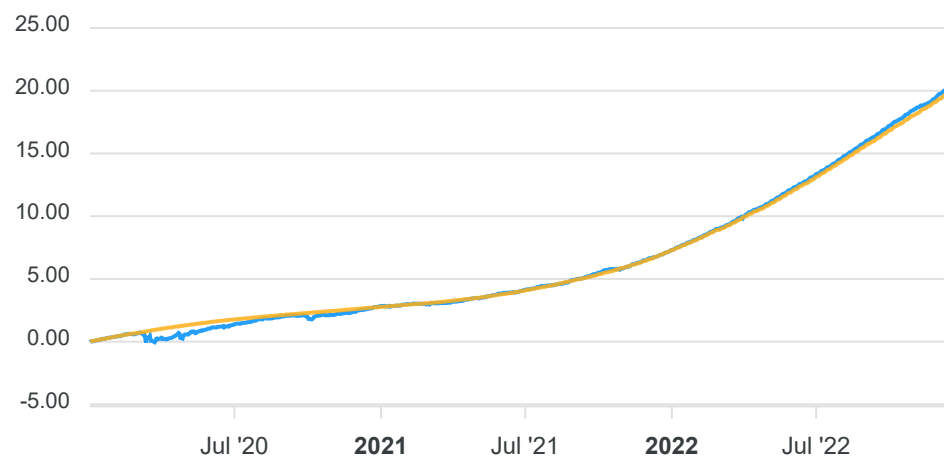
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A |
| Benchmark CDI |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais invistam em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de relacionados à variação das taxas de juros, pós ou pré-fixadas, de índices de preços, ou ambos. |

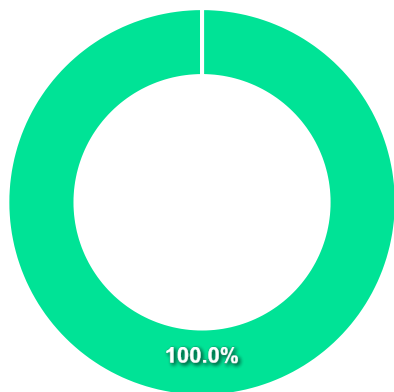
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 12,75% | 3,23% | 6,78% | 12,75% | 17,64% | 0,05% | 0,11% |
| 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 SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 345.719,71 | 99,65 | Fundos de Investimento |
| Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENC... | 1.354,35 | 0,39 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 401,22 | 0,12 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -549,16 | -0,16 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 347.074,06 | 100.04% |
| Valores a pagar/receber | -142,94 | -0.04% |

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

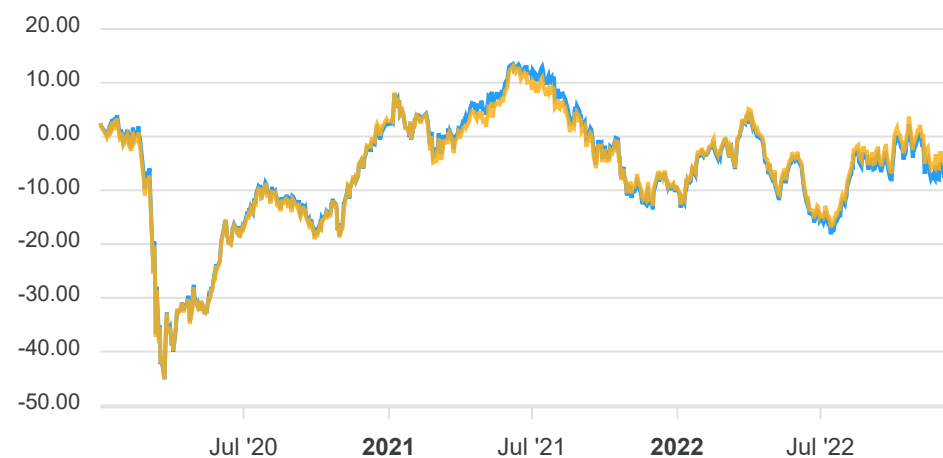
Classificação ANBIMA
Ações Sustentabilidade/Governança

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.

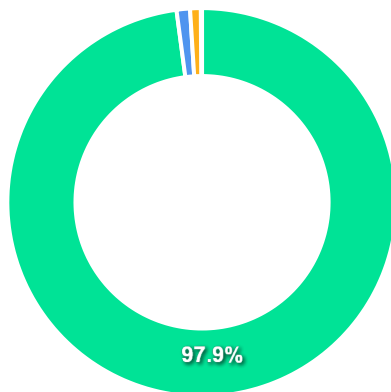
COMPARATIVO

📅 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 | 766.546,77 | 97.90% |
| Valores a pagar/receber | 8.725,07 | 1.11% |
| Operação compromissada | 6.899,40 | 0.88% |
| Outros | 815,62 | 0.10% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|------------|
| VALE ON N1 - VALE3 | 106.584,47 | 13,61 | Ações |
| PETROBRAS PN - PETR4 | 42.226,67 | 5,39 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3 | 40.785,35 | 5,21 | Ações |
| ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4 | 38.566,40 | 4,92 | Ações |
| PETROBRAS ON - PETR3 | 31.986,93 | 4,08 | Ações |
| ELETROBRAS ON N1 - ELET3 | 25.925,33 | 3,31 | Ações |
| BRASIL ON NM - BBAS3 | 21.164,87 | 2,70 | Ações |
| BRDESCO PN N1 - BBDC4 | 20.030,10 | 2,56 | Ações |
| WEG ON NM - WEGE3 | 19.625,03 | 2,51 | Ações |
| ITAUSA PN N1 - ITSA4 | 16.411,59 | 2,10 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3 | 11.689,38 | 1,49 | Ações |
| GERDAU PN N1 - GGBR4 | 11.188,69 | 1,43 | Ações |
| EQUATORIAL ON NM - EQTL3 | 11.157,36 | 1,42 | Ações |
| SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3 | 11.016,43 | 1,41 | Ações |
| B3 ON NM - B3SA3 | 10.852,67 | 1,39 | Ações |
| PETRORIO ON NM - PRIO3 | 10.682,90 | 1,36 | Ações |
| REDE D OR ON NM - RDOR3 | 9.865,29 | 1,26 | Ações |
| BTGP BANCO UNT - BPAC11 | 9.312,20 | 1,19 | Ações |
| LOCALIZA ON NM - RENT3 | 8.738,90 | 1,12 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4 | 8.485,69 | 1,08 | Ações |
| BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3 | 8.367,77 | 1,07 | Ações |
| RUMO S.A. ON NM - RAIL3 | 8.320,63 | 1,06 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3 | 8.084,82 | 1,03 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT3 | 7.895,01 | 1,01 | Ações |
| SABESP ON NM - SBSP3 | 7.265,70 | 0,93 | Ações |
| JBS ON NM - JBSS3 | 7.207,76 | 0,92 | Ações |
| ASSAI ON NM - ASAI3 | 7.137,69 | 0,91 | Ações |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---|
| Administrador | BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão | SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração | 0,75% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 35 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 308.702.229,09 |

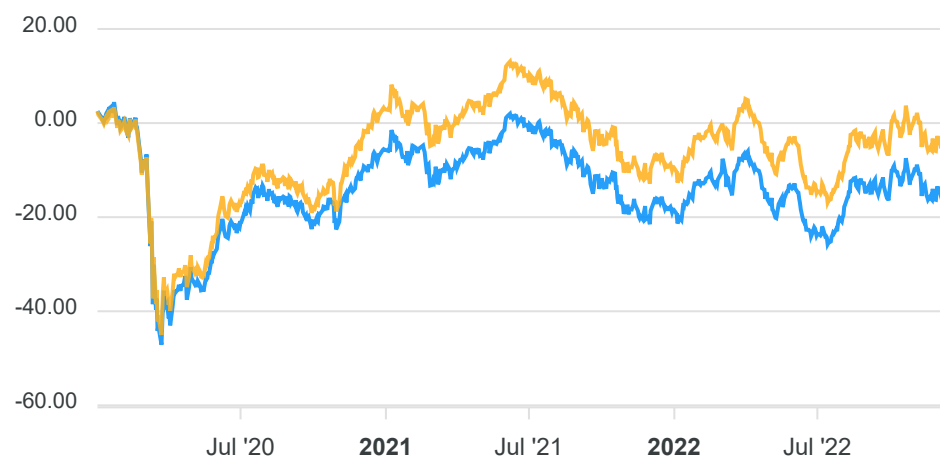
PERFIL DO FUNDO

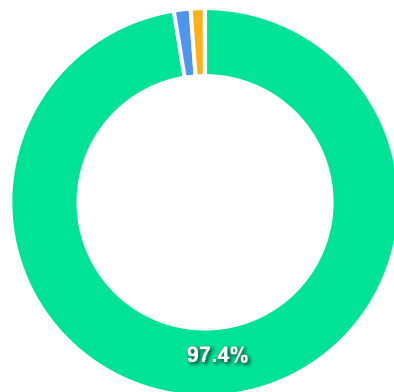
| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso I |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Índice Ativo |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III. |

COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|-------|--------|--------|-------|---------|-----------|--------------------|
| Fundo | -2,61% | 3,29% | -1,06% | 10,77% | 3,29% | -10,61% | 9,69% | 20,40% |
| Benchmark | -2,45% | 4,69% | -0,27% | 11,36% | 4,69% | -7,80% | | |



CARTEIRA DO FUNDO


| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Ações | 321.432,35 | 97.43% |
| Operação compromissada | 4.555,31 | 1.38% |
| Valores a pagar/receber | 3.818,63 | 1.16% |
| Derivativos | 79,56 | 0.02% |
| Fundos de Investimento | 15,33 | 0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| VALE ON N1 - VALE3 | 59.240,52 | 17,96 | Ações |
| ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4 | 19.102,77 | 5,79 | Ações |
| PETROBRAS PN - PETR4 | 18.459,86 | 5,60 | Ações |
| PETROBRAS ON - PETR3 | 12.786,20 | 3,88 | Ações |
| B3 ON NM - B3SA3 | 12.599,86 | 3,82 | Ações |
| BRADESCO PN N1 - BBDC4 | 12.217,96 | 3,70 | Ações |
| ELETRORBRAS ON N1 - ELET3 | 10.732,39 | 3,25 | Ações |
| AMBEV S/A ON - ABEV3 | 9.411,11 | 2,85 | Ações |
| BRASIL ON NM - BBAS3 | 9.275,43 | 2,81 | Ações |
| WEG ON NM - WEGE3 | 8.541,00 | 2,59 | Ações |
| LOCALIZA ON NM - RENT3 | 8.356,30 | 2,53 | Ações |
| ITAUSA PN N1 - ITSA4 | 7.299,74 | 2,21 | Ações |
| GERDAU PN N1 - GGBR4 | 5.400,27 | 1,64 | Ações |
| Outros Valores a receber | 5.326,44 | 1,61 | Valores a pagar/receber |
| BTGP BANCO UNT - BPAC11 | 5.294,66 | 1,60 | Ações |
| EQUATORIAL ON NM - EQTL3 | 5.096,53 | 1,54 | Ações |
| PETRORIO ON NM - PRIO3 | 4.758,60 | 1,44 | Ações |
| SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3 | 4.601,14 | 1,39 | Ações |
| Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027 | 4.555,31 | 1,38 | Operação compromissada |
| SABESP ON NM - SBSP3 | 4.218,49 | 1,28 | Ações |
| JBS ON NM - JBSS3 | 3.778,95 | 1,15 | Ações |
| RUMO S.A. ON NM - RAIL3 | 3.751,89 | 1,14 | Ações |
| BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3 | 3.653,29 | 1,11 | Ações |
| LOJAS RENNER ON NM - LREN3 | 3.576,84 | 1,08 | Ações |
| REDE D OR ON NM - RDOR3 | 3.568,79 | 1,08 | Ações |
| TOTVS ON NM - TOTS3 | 3.394,60 | 1,03 | Ações |
| BRADESCO ON N1 - BBDC3 | 3.293,73 | 1,00 | Ações |

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

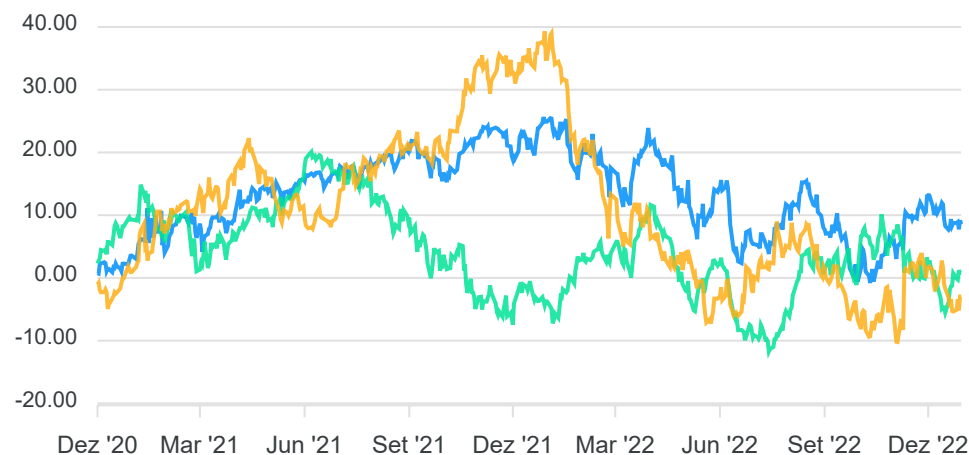
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP
AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I,
CNPJ: 39.272.928/0001-60.

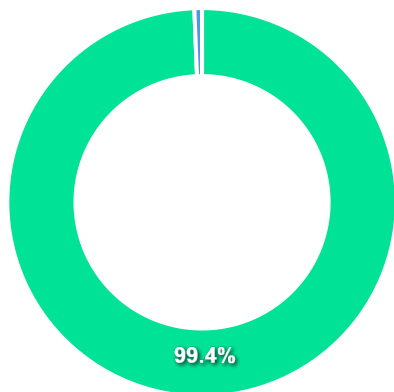
COMPARATIVO

📅 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



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIAÇÕES BD... | 394.861,67 | 96,46 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 11.909,61 | 2,91 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 2.655,54 | 0,65 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 798,51 | 0,20 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 1,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,06 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / IR a recolher | 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 | -3,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -3,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -6,21 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -48,57 | -0,01 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Cotas a resgatar | -810,56 | -0,20 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 406.771,28 | 99.37% |
| Valores a pagar/receber | 2.589,86 | 0.63% |
| Outros | -6,21 | -0.00% |

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 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|---|-------------|------------|----------------|-------|----------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 415.428,08 | 33,42% | 183.585.511,92 | 0,23% | 7º I b |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 827.782,35 | 66,58% ▲ | 396.851.061,29 | 0,21% | 7º III a |

Investimentos

\$ 1.243.210,43

Disponibilidades Financeiras

\$ 185.276,65

Total Carteira

\$ 1.428.487,08

Governança (Pró Gestão)

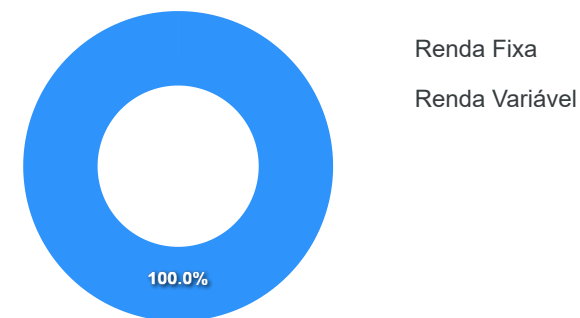
 Não possui

| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Livre |
|--------------------------------|------------|-----------|------------------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 29,08% | 415.428,08 70,92% |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 57,95% | 827.782,35 2,05% |
| | | | 1.013.059,00 29.309,90 |

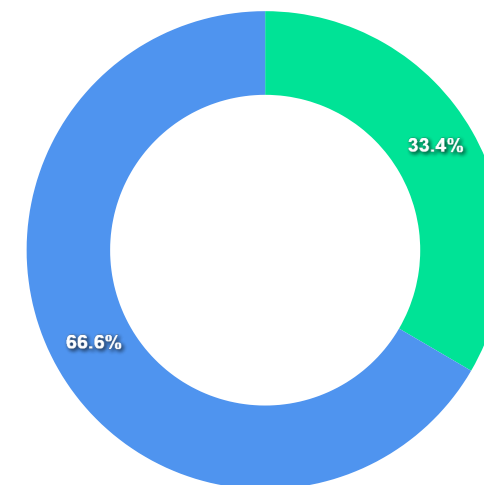
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

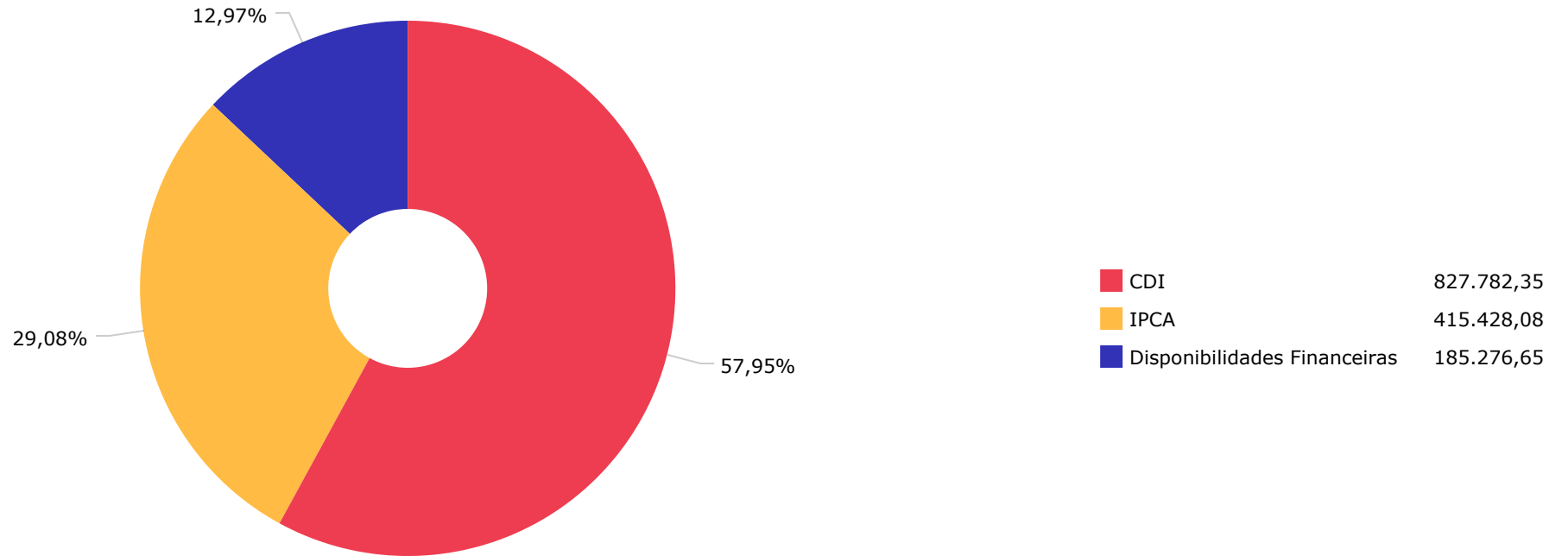


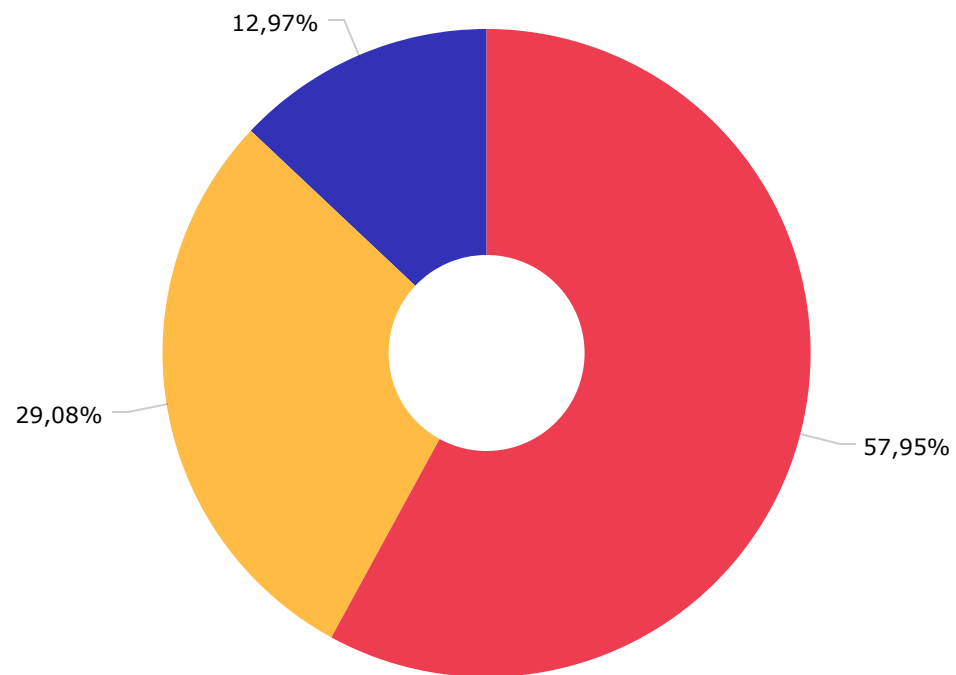
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|--------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 9,00% | 100,00% | 1.428.487,08 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 29,08% | 0,00% | 40,00% | 100,00% | 1.013.059,00 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 57,95% | 0,00% | 15,00% | 60,00% | 29.309,90 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 20,00% | 285.697,42 |

| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|------------------------------|-------|----------|--------|----------|--------------|
| 8° I - Fundos de Ações | 0,00% | 0,00% | 24,00% | 30,00% | 428.546,12 |
| 9° III - Ações - BDR Nível I | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 142.848,71 |
| 10° I - Fundos Multimercados | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 142.848,71 |

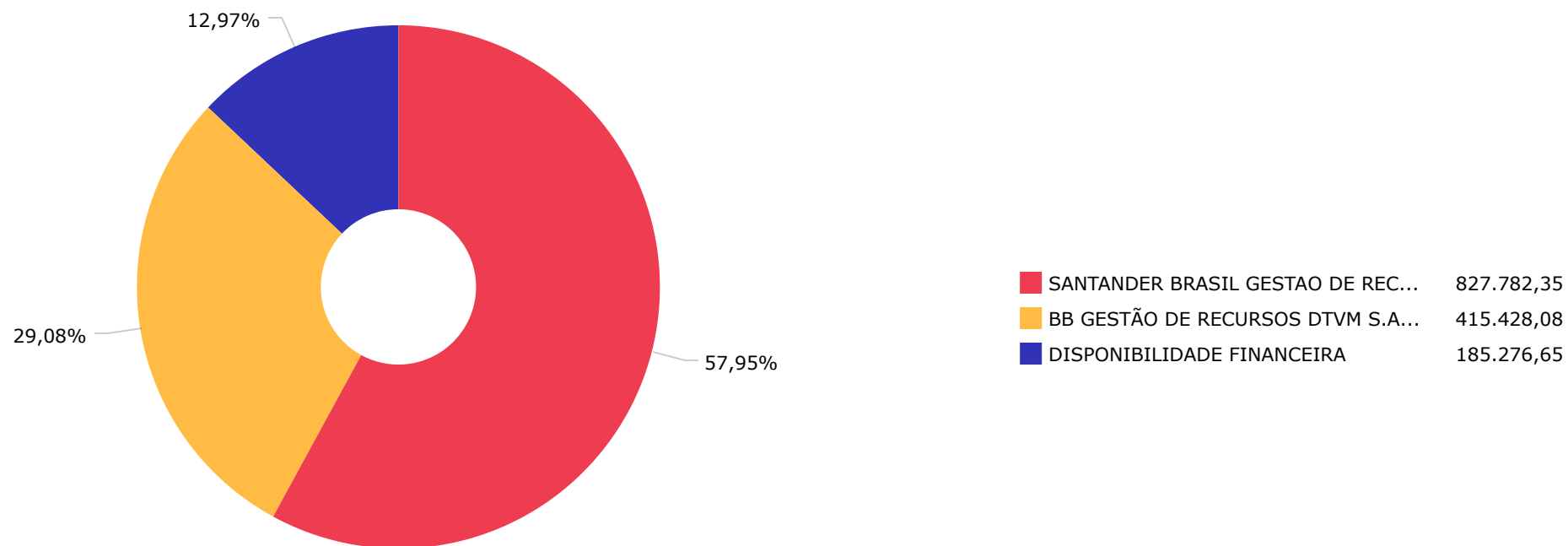
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| CDI - BENCHMARK | 1,12 | 12,37 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | | |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1,16 | 12,75 | 3,23 | 6,78 | 12,75 | 17,64 | 0,05 | 0,11 |
| GLOBAL BDRX - BENCHMARK | -4,22 | -28,05 | 3,94 | -0,61 | -28,05 | -3,84 | | |
| 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 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | -2,45 | 4,69 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | -2,61 | 3,29 | -1,06 | 10,77 | 3,29 | -10,61 | 9,69 | 20,40 |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | -2,62 | 2,43 | -1,12 | 9,89 | 2,43 | -9,39 | 10,03 | 21,13 |
| IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK | 1,24 | 9,34 | 2,25 | 2,34 | 9,34 | 14,78 | | |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,22 | 9,32 | 2,42 | 2,69 | 9,32 | 14,40 | 1,21 | 2,54 |
| IMA-B - BENCHMARK | -0,19 | 6,37 | 0,23 | 1,94 | 6,37 | 5,02 | | |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | -0,22 | 6,11 | 0,17 | 1,81 | 6,11 | 4,49 | 2,49 | 5,25 |
| 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 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 0,94 | 9,78 | 2,53 | 2,98 | 9,78 | 14,79 | | |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 0,92 | 9,57 | 2,48 | 2,88 | 9,57 | 14,33 | 1,15 | 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 |
| IMA-B 5+ - BENCHMARK | -1,19 | 3,30 | -1,72 | 1,24 | 3,30 | -3,47 | | |
| 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 |
| IPCA - BENCHMARK | 0,62 | 5,78 | 1,63 | 0,28 | 5,78 | 16,43 | | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,31 | 10,63 | 2,70 | 3,51 | 10,63 | 16,67 | 0,98 | 2,07 |

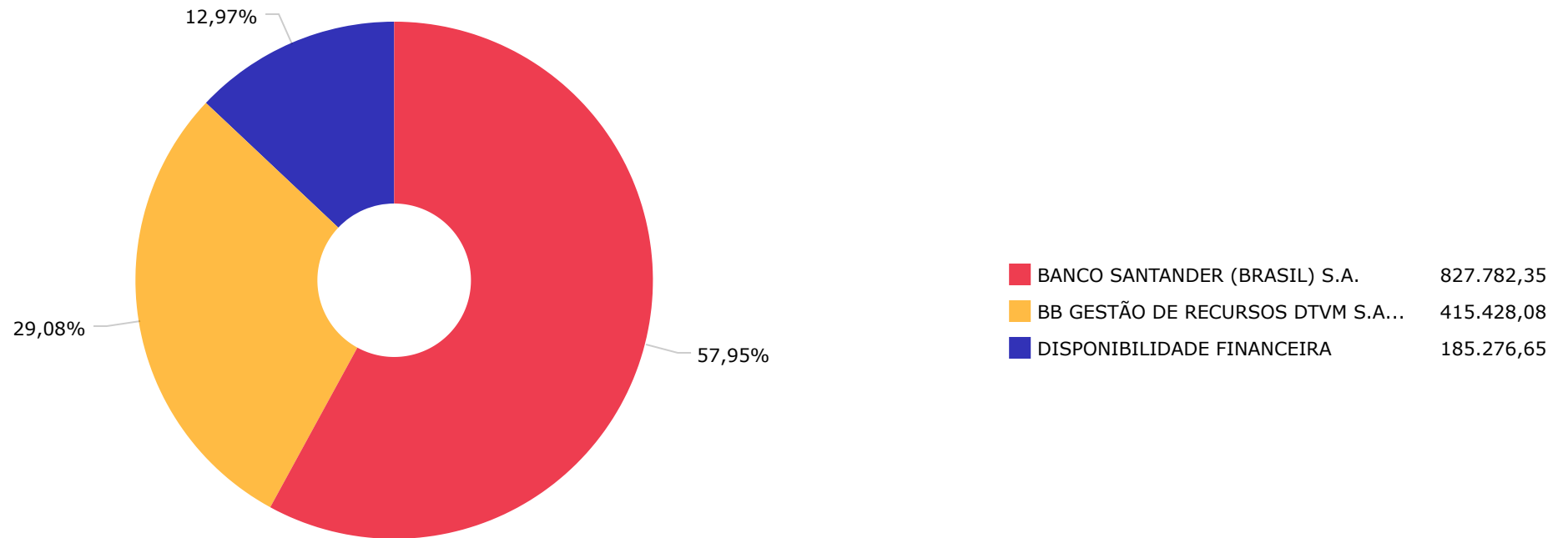
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|-------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| IRF-M - BENCHMARK | 1,48 | 8,82 | 1,74 | 6,49 | 8,82 | 6,66 | | |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1,14 | 11,58 | 3,05 | 6,51 | 11,58 | 14,43 | 0,08 | 0,16 |
| IRF-M 1 - BENCHMARK | 1,18 | 12,02 | 3,16 | 6,70 | 12,02 | 15,30 | | |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,16 | 11,73 | 3,09 | 6,56 | 11,73 | 14,68 | 0,08 | 0,17 |





| | |
|---|------------|
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 827.782,35 |
| Não classificado | 415.428,08 |
| Disponibilidades Financeiras | 185.276,65 |





| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|--------------|--------------|--------------|------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 2.032.254,92 | 2.268.981,55 | 2.981.265,11 | 1.336.697,77 | 16.726,41 | 16.726,41 | 0,82% ▲ | 0,82% | 0,95% | 0,95% | 86,32% | 0,80% |
| Fevereiro | 1.336.697,77 | 3.000.000,00 | 2.044.320,37 | 2.314.275,08 | 21.897,68 | 38.624,09 | 0,96% ▲ | 1,79% | 1,38% | 2,34% | 76,50% | 0,34% |
| Março | 2.314.275,08 | 850.000,00 | 400.000,00 | 2.807.207,71 | 42.932,63 | 81.556,72 | 1,55% ▲ | 3,37% | 2,05% | 4,44% | 75,90% | 0,45% |
| Abril | 2.807.207,71 | 3.000.000,00 | 3.476.351,59 | 2.370.173,60 | 39.317,48 | 120.874,20 | 1,40% ▲ | 4,81% | 1,43% | 5,93% | 81,11% | 0,16% |
| Mai | 2.370.173,60 | 1.365.427,29 | 1.346.000,00 | 2.412.832,51 | 23.231,62 | 144.105,82 | 0,97% ▲ | 5,83% | 0,90% | 6,88% | 84,74% | 0,46% |
| Junho | 2.412.832,51 | 0,00 | 495.423,50 | 1.928.218,21 | 10.809,20 | 154.915,02 | 0,45% ▲ | 6,31% | 1,08% | 8,03% | 78,58% | 0,93% |
| Julho | 1.928.218,21 | 1.450.162,57 | 2.000.000,00 | 1.396.268,54 | 17.887,76 | 172.802,78 | 0,93% ▲ | 7,29% | -0,28% | 7,73% | 94,31% | 0,80% |
| Agosto | 1.396.268,54 | 3.550.000,00 | 3.120.960,56 | 1.847.612,54 | 22.304,56 | 195.107,34 | 1,22% ▲ | 8,61% | 0,08% | 7,82% | 110,10% | 0,20% |
| Setembro | 1.847.612,54 | 1.927.830,99 | 2.500.000,00 | 1.300.742,97 | 25.299,44 | 220.406,78 | 1,37% ▲ | 10,09% | 0,11% | 7,94% | 127,08% | 0,50% |
| Outubro | 1.300.742,97 | 2.400.000,00 | 2.360.000,00 | 1.363.270,34 | 22.527,37 | 242.934,15 | 1,68% ▲ | 11,94% | 0,98% | 8,99% | 132,81% | 0,29% |
| Novembro | 1.363.270,34 | 2.780.809,40 | 2.542.799,69 | 1.610.743,19 | 9.463,14 | 252.397,29 | 0,59% ▲ | 12,60% | 0,80% | 9,86% | 127,79% | 0,59% |
| Dezembro | 1.610.743,19 | 1.800.000,00 | 2.184.270,24 | 1.243.210,43 | 16.737,48 | 269.134,77 | 1,04% ▲ | 13,77% | 1,05% | 11,01% | 125,07% | 0,36% |

Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$ | Retorno % | Meta % |
|---------|------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 81.556,72 | 3,37% | 4,44% |
| 2º Trim | 73.358,30 | 2,85% | 3,44% |
| 1º Sem | 154.915,02 | 6,31% | 8,03% |
| 3º Trim | 65.491,76 | 3,56% | -0,08% |
| 4º Trim | 48.727,99 | 3,34% | 2,85% |
| 2º Sem | 114.219,75 | 7,02% | 2,76% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

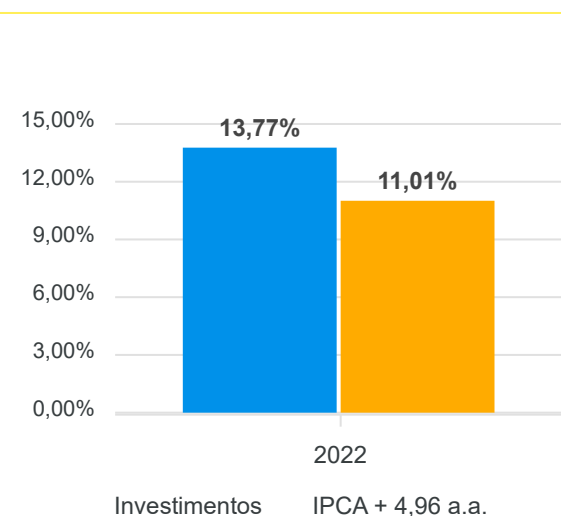


Gráfico Risco x Retorno

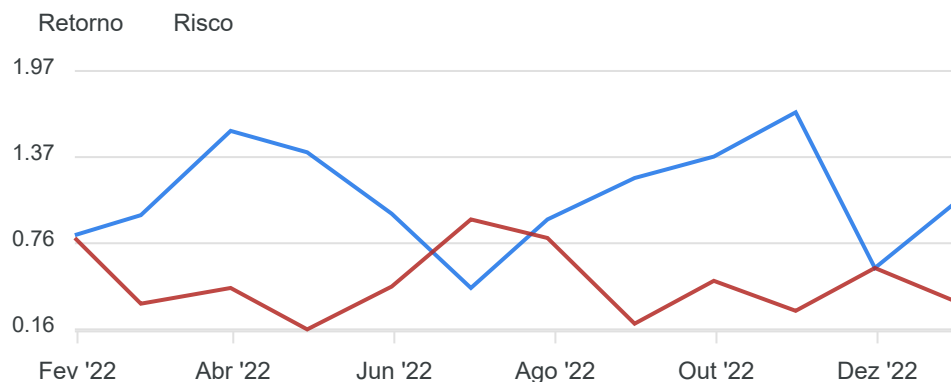
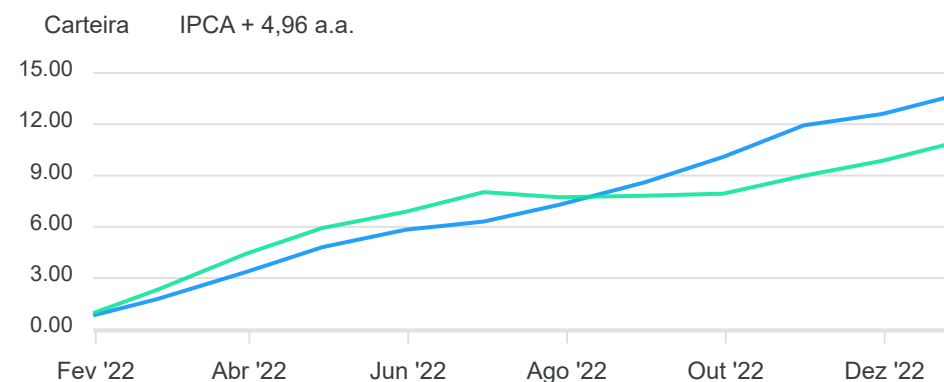
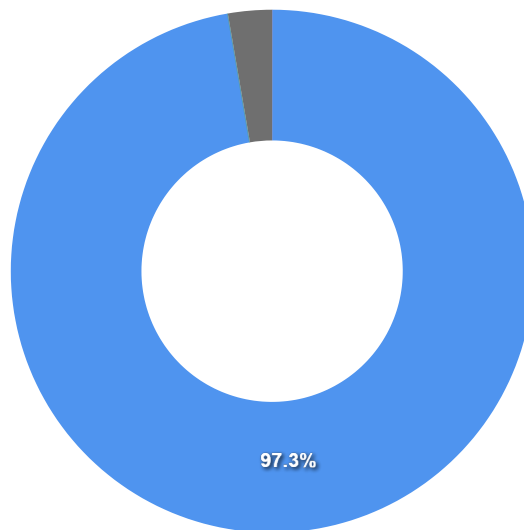


Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



Liquidez - 30/12/2022

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|---------------|----------|
| Até D+30 | 14.916.494,82 | 1.199,84 |
| Até D+180 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+360 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+720 | 415.428,08 | 33,42 |
| Até D+1800 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Acima D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Indeterminado | 0,00 | 0,00 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|--------------|--------------|------------|-----------|-------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 410.043,67 | 0,00 | 0,00 | 415.428,08 | 5.384,41 | 1,31% ▲ | 0,98% |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1.200.699,52 | 1.800.000,00 | 2.184.270,24 | 827.782,35 | 11.353,07 | 0,38% ▲ | 0,05% |
| | 1.610.743,19 | 1.800.000,00 | 2.184.270,24 | 1.243.210,43 | 16.737,48 | 1,04% | 0,36% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|--------------|--------------|--------------|------------|-----------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 404.513,67 | 0,00 | 0,00 | 415.428,08 | 10.914,41 | 2,70% ▲ |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 896.229,30 | 6.980.809,40 | 7.087.069,93 | 827.782,35 | 37.813,58 | 0,48% ▲ |
| | 1.300.742,97 | 6.980.809,40 | 7.087.069,93 | 1.243.210,43 | 48.727,99 | 3,75% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|---------------|---------------|--------------|------------|-----------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.331.566,94 | 0,00 | 1.030.437,19 | 415.428,08 | 114.298,33 | 8,58% ▲ |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 700.687,98 | 24.393.211,80 | 24.420.953,87 | 827.782,35 | 154.836,44 | 0,62% ▲ |
| | 2.032.254,92 | 24.393.211,80 | 25.451.391,06 | 1.243.210,43 | 269.134,77 | 13,24% |

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 | 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 | 987 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 7.489.389.892,90 |

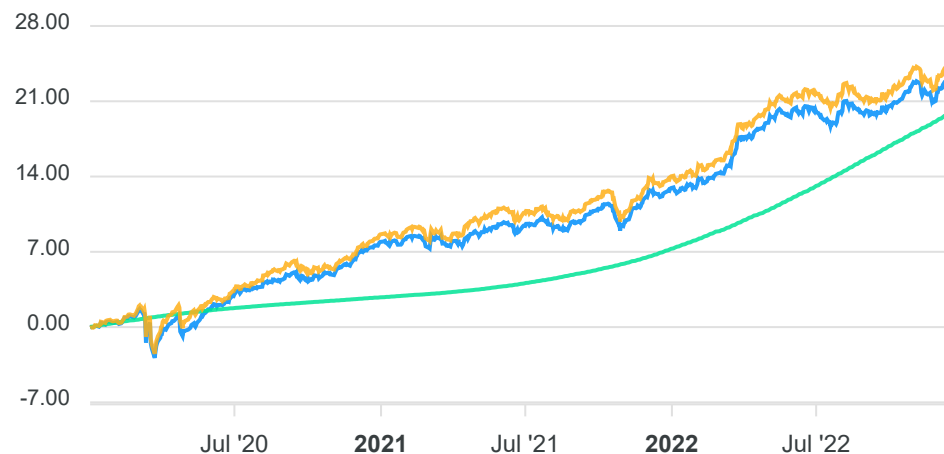
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IDKA IPCA 2 Anos |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

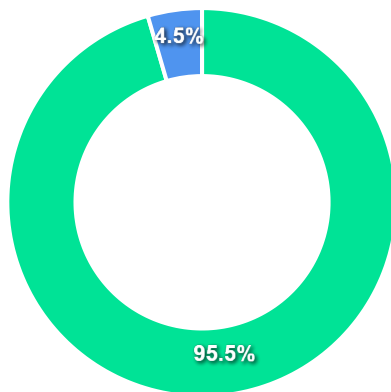
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,22% | 9,32% | 2,42% | 2,69% | 9,32% | 14,40% | 1,21% | 2,54% |
| Benchmark | 1,24% | 9,34% | 2,25% | 2,34% | 9,34% | 14,78% | | |
| CDI | 1,12% | 12,37% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 17,31% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 6.607.138,50 | 95.50% |
| Operação compromissada | 310.939,81 | 4.49% |
| Valores a pagar/receber | 175,00 | 0.00% |
| Outros | 80,32 | 0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 3.455.182,28 | 49,94 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 2.852.861,96 | 41,24 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 310.939,81 | 4,49 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 299.094,27 | 4,32 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 223,77 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 181,42 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 21,50 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,34 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,17 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,05 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -13,58 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -14,40 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -49,62 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -54,79 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -81,99 | 0,00 | Outros |

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

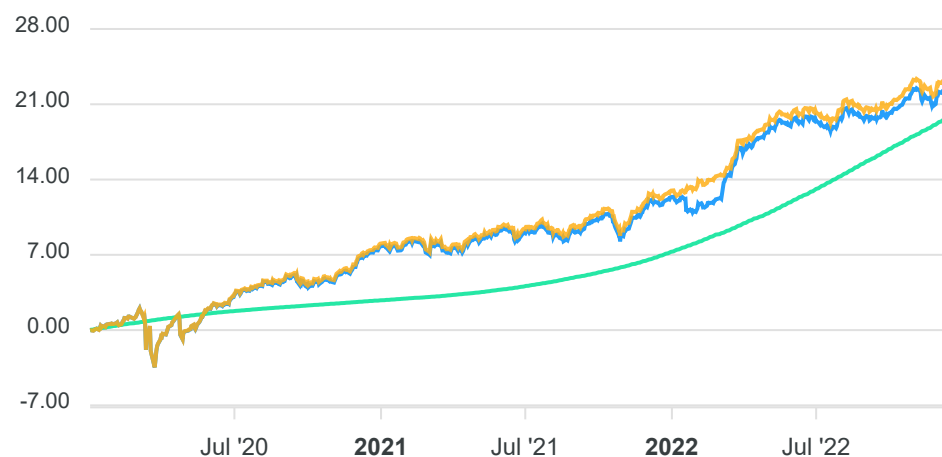
Classificação ANBIMA
Renda Fixa Indexados

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.

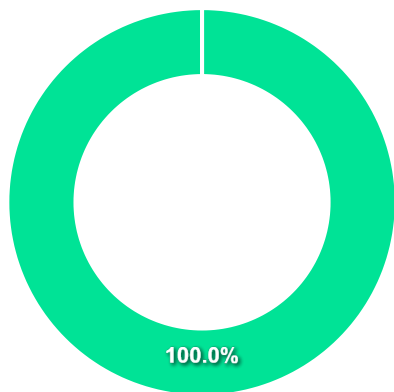
COMPARATIVO

📅 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 | 5.558.960,42 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 3,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -44,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 5.558.960,42 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -60,83 | -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. |

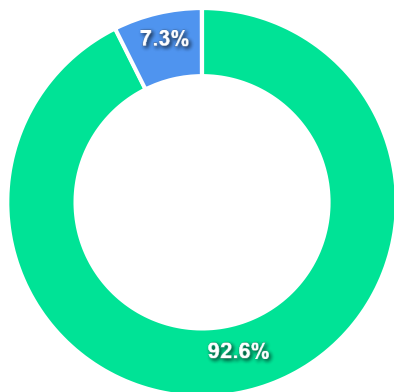
COMPARATIVO

📅 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 | 682.242,81 | 92.65% |
| Operação compromissada | 54.089,75 | 7.35% |
| Valores a pagar/receber | 184,00 | 0.02% |
| Outros | -111,14 | -0.02% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 139.690,76 | 18,97 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 111.165,66 | 15,10 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 99.050,75 | 13,45 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 92.948,14 | 12,62 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 90.152,94 | 12,24 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 61.380,00 | 8,34 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 54.089,75 | 7,35 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 40.267,68 | 5,47 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 30.636,87 | 4,16 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 16.950,02 | 2,30 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 204,72 | 0,03 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 2,57 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,60 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,03 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,01 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | -5,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -5,66 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -5,88 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -7,28 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -7,89 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -103,26 | -0,01 | Outros |

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. |

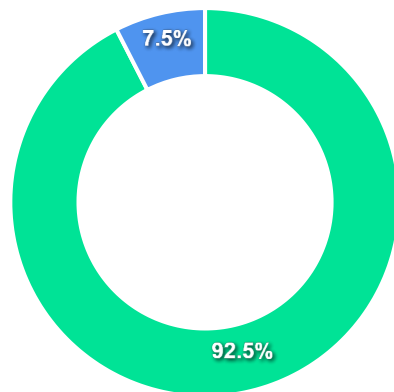
COMPARATIVO

📅 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 | 5.274.809,08 | 92.48% |
| Operação compromissada | 429.019,67 | 7.52% |
| Valores a pagar/receber | 166,36 | 0.00% |
| Outros | -99,29 | -0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 734.255,39 | 12,87 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 567.613,28 | 9,95 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 489.421,44 | 8,58 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 487.087,73 | 8,54 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 460.409,93 | 8,07 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 450.437,99 | 7,90 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 429.019,67 | 7,52 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 401.892,12 | 7,05 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 394.214,93 | 6,91 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 365.032,50 | 6,40 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 304.564,56 | 5,34 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 247.902,71 | 4,35 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 197.339,20 | 3,46 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 120.359,12 | 2,11 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 54.278,16 | 0,95 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 202,54 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 99,80 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 17,15 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,08 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -2,04 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -3,12 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -21,51 | 0,00 | Outros |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|--|
| Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+0 |
| Quantidade de Cotistas 1.114 |
| Patrimônio Líquido Fundo 6.516.931.621,39 |

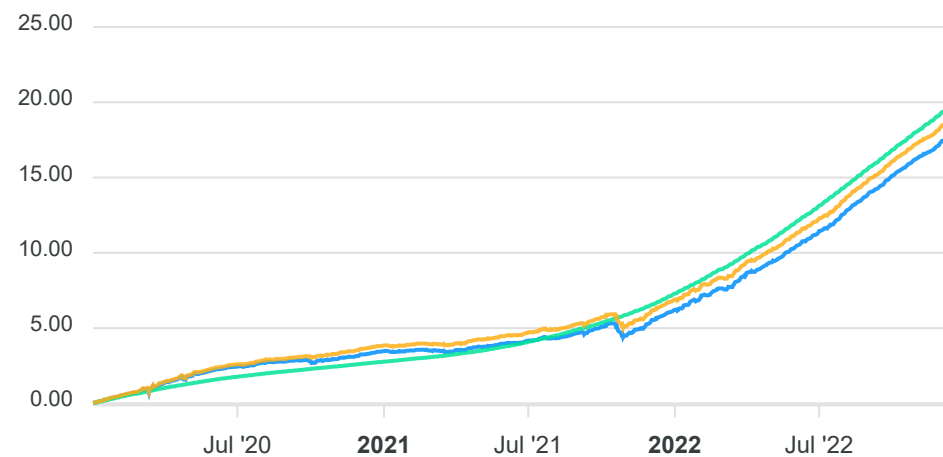
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M 1 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais. |

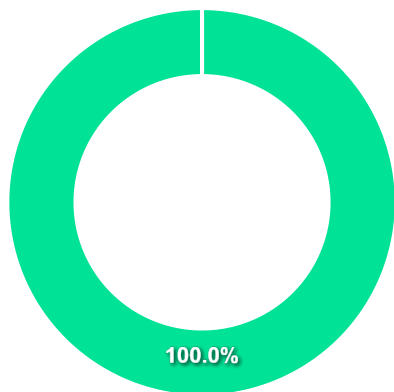
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 11,73% | 3,09% | 6,56% | 11,73% | 14,68% | 0,08% | 0,17% |
| Benchmark | 1,18% | 12,02% | 3,16% | 6,70% | 12,02% | 15,30% | | |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 6.481.908,92 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 25,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 6,49 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 6.481.908,92 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | 71,26 | 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 | 140 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 183.585.511,92 |

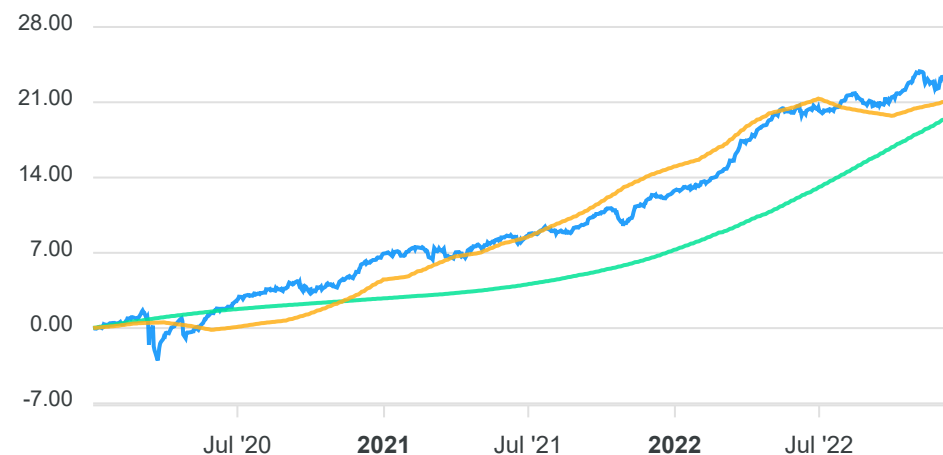
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IPCA |
| Classificação ANBIMA | Não classificado |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

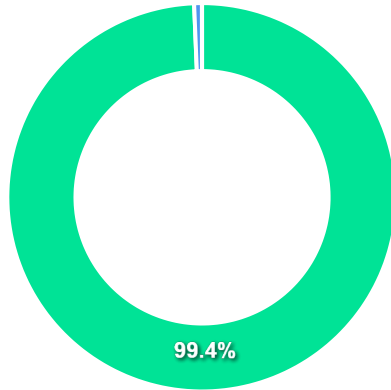
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,31% | 10,63% | 2,70% | 3,51% | 10,63% | 16,67% | 0,98% | 2,07% |
| 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 | 182.049,80 | 99,35 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 1.169,23 | 0,64 | Operação compromissada |
| Outras Disponibilidades | 35,94 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 6,96 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 0,47 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | -1,20 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -1,32 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -2,14 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | -4,52 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -4,73 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -8,42 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 182.049,80 | 99.35% |
| Operação compromissada | 1.169,23 | 0.64% |
| Valores a pagar/receber | 25,77 | 0.01% |
| Outros | -4,73 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 128 |
| Patrimônio Líquido Fundo 827.149.677,31 |

PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B 5 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento. |

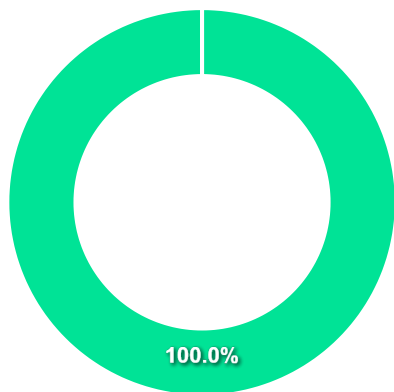
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,92% | 9,57% | 2,48% | 2,88% | 9,57% | 14,33% | 1,15% | 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 SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 835.890,44 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 61,52 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -119,74 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 835.890,44 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -53,22 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,20% |
| Taxa de Performance 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 126 |
| Patrimônio Líquido Fundo 564.735.869,38 |

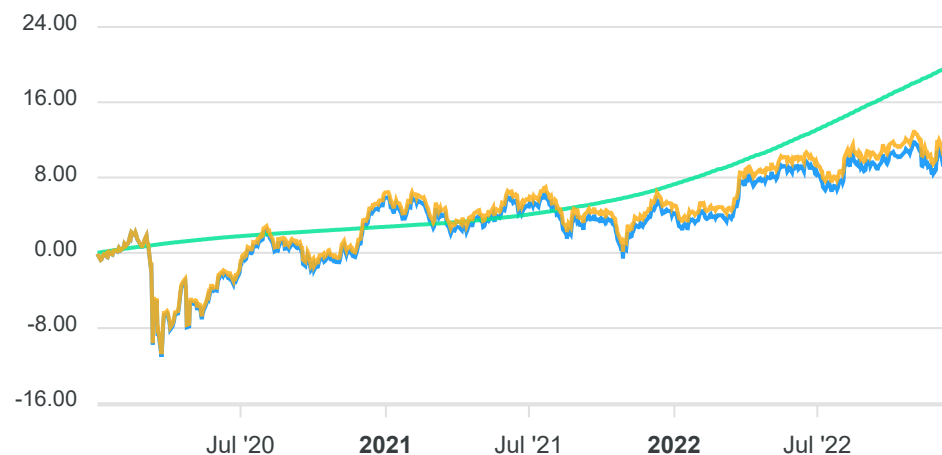
PERFIL DO FUNDO

| |
|---|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa. |

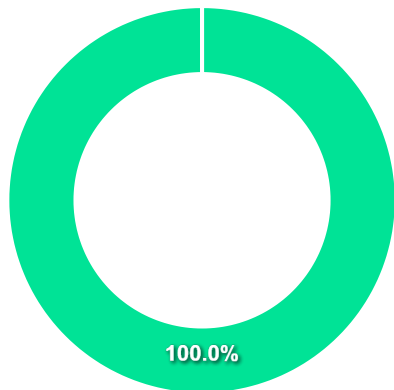
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | -0,22% | 6,11% | 0,17% | 1,81% | 6,11% | 4,49% | 2,49% | 5,25% |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP | 602.041,18 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 9,31 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -72,39 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 602.041,18 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -58,08 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,40% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 19 |
| Patrimônio Líquido Fundo 41.379.142,83 |

PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos. |

COMPARATIVO

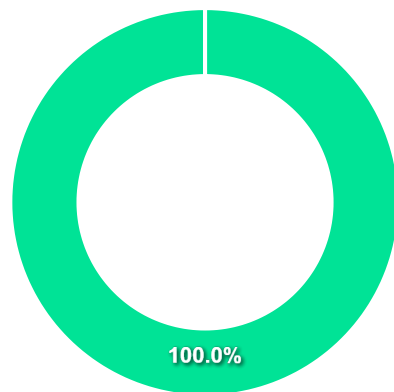
📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,14% | 11,58% | 3,05% | 6,51% | 11,58% | 14,43% | 0,08% | 0,16% |
| Benchmark | 1,48% | 8,82% | 1,74% | 6,49% | 8,82% | 6,66% | | |
| 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 SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | 41.960,61 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 7,96 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -13,62 | -0,03 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 41.960,61 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -0,54 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,30% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 158 |
| Patrimônio Líquido Fundo 396.851.061,29 |

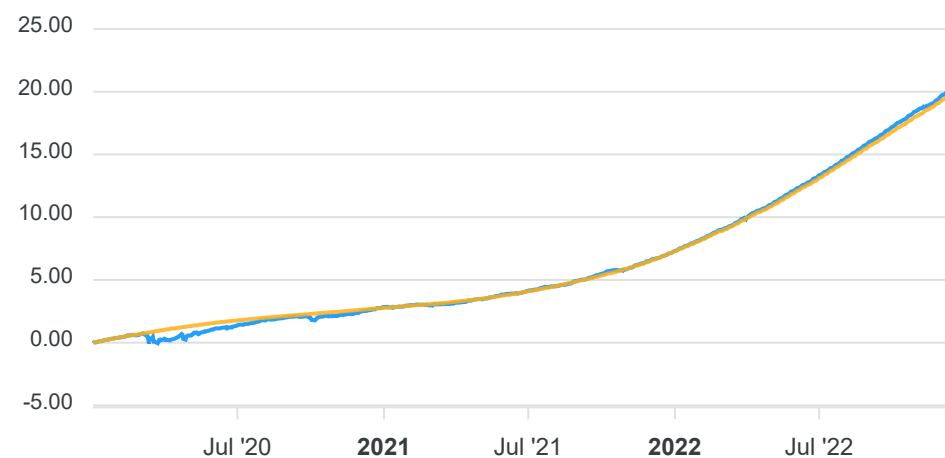
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A |
| Benchmark CDI |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais invistam em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de relacionados à variação das taxas de juros, pós ou pré-fixadas, de índices de preços, ou ambos. |

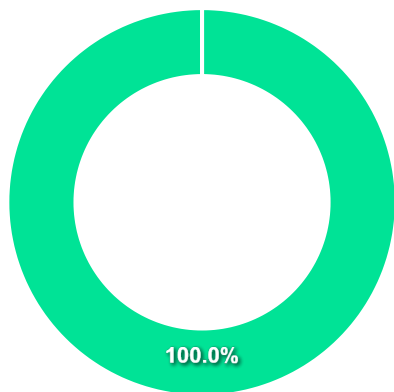
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 12,75% | 3,23% | 6,78% | 12,75% | 17,64% | 0,05% | 0,11% |
| 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 SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 345.719,71 | 99,65 | Fundos de Investimento |
| Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENC... | 1.354,35 | 0,39 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 401,22 | 0,12 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -549,16 | -0,16 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 347.074,06 | 100.04% |
| Valores a pagar/receber | -142,94 | -0.04% |

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

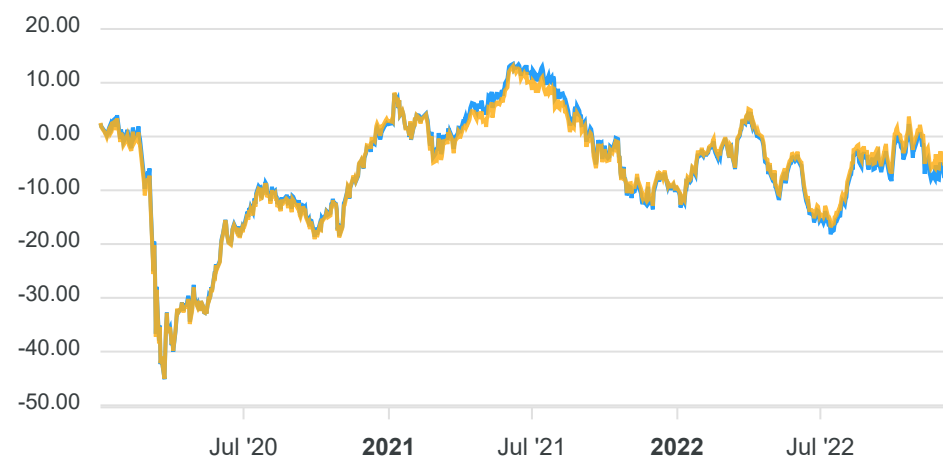
Classificação ANBIMA
Ações Sustentabilidade/Governança

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.

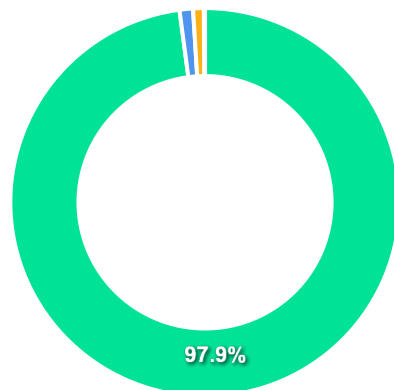
COMPARATIVO

📅 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 | 766.546,77 | 97.90% |
| Valores a pagar/receber | 8.725,07 | 1.11% |
| Operação compromissada | 6.899,40 | 0.88% |
| Outros | 815,62 | 0.10% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|------------|
| VALE ON N1 - VALE3 | 106.584,47 | 13,61 | Ações |
| PETROBRAS PN - PETR4 | 42.226,67 | 5,39 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - VALE3 | 40.785,35 | 5,21 | Ações |
| ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4 | 38.566,40 | 4,92 | Ações |
| PETROBRAS ON - PETR3 | 31.986,93 | 4,08 | Ações |
| ELETROBRAS ON N1 - ELET3 | 25.925,33 | 3,31 | Ações |
| BRASIL ON NM - BBAS3 | 21.164,87 | 2,70 | Ações |
| BRADERSCO PN N1 - BBDC4 | 20.030,10 | 2,56 | Ações |
| WEG ON NM - WEGE3 | 19.625,03 | 2,51 | Ações |
| ITAUSA PN N1 - ITSA4 | 16.411,59 | 2,10 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - B3SA3 | 11.689,38 | 1,49 | Ações |
| GERDAU PN N1 - GGBR4 | 11.188,69 | 1,43 | Ações |
| EQUATORIAL ON NM - EQTL3 | 11.157,36 | 1,42 | Ações |
| SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3 | 11.016,43 | 1,41 | Ações |
| B3 ON NM - B3SA3 | 10.852,67 | 1,39 | Ações |
| PETRORIO ON NM - PRIO3 | 10.682,90 | 1,36 | Ações |
| REDE D OR ON NM - RDOR3 | 9.865,29 | 1,26 | Ações |
| BTGP BANCO UNT - BPAC11 | 9.312,20 | 1,19 | Ações |
| LOCALIZA ON NM - RENT3 | 8.738,90 | 1,12 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - ITUB4 | 8.485,69 | 1,08 | Ações |
| BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3 | 8.367,77 | 1,07 | Ações |
| RUMO S.A. ON NM - RAIL3 | 8.320,63 | 1,06 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - PETR3 | 8.084,82 | 1,03 | Ações |
| Ações e outros TVM cedidos em empréstimo - RENT3 | 7.895,01 | 1,01 | Ações |
| SABESP ON NM - SBSP3 | 7.265,70 | 0,93 | Ações |
| JBS ON NM - JBSS3 | 7.207,76 | 0,92 | Ações |
| ASSAI ON NM - ASAI3 | 7.137,69 | 0,91 | Ações |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---|
| Administrador | BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão | SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração | 0,75% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 35 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 308.702.229,09 |

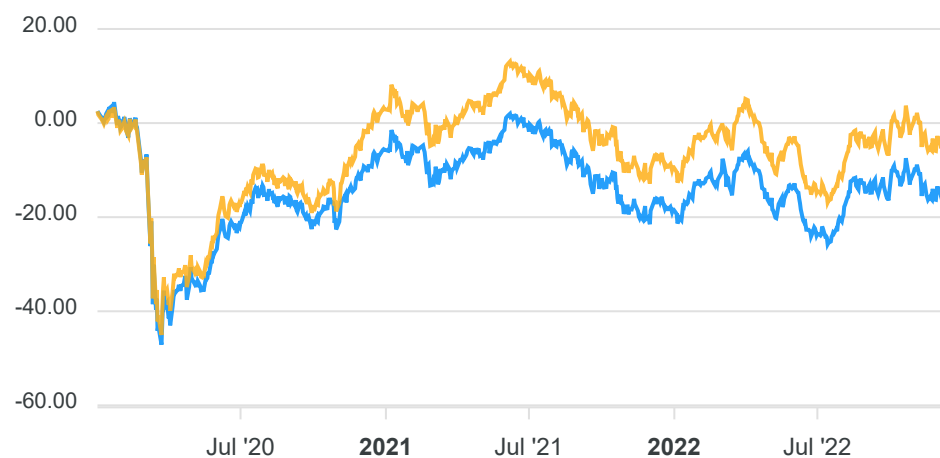
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso I |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Índice Ativo |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III. |

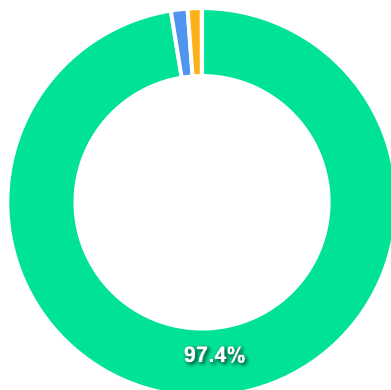
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|-------|--------|--------|-------|---------|-----------|--------------------|
| Fundo | -2,61% | 3,29% | -1,06% | 10,77% | 3,29% | -10,61% | 9,69% | 20,40% |
| Benchmark | -2,45% | 4,69% | -0,27% | 11,36% | 4,69% | -7,80% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Ações | 321.432,35 | 97.43% |
| Operação compromissada | 4.555,31 | 1.38% |
| Valores a pagar/receber | 3.818,63 | 1.16% |
| Derivativos | 79,56 | 0.02% |
| Fundos de Investimento | 15,33 | 0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| VALE ON N1 - VALE3 | 59.240,52 | 17,96 | Ações |
| ITAUUNIBANCO PN N1 - ITUB4 | 19.102,77 | 5,79 | Ações |
| PETROBRAS PN - PETR4 | 18.459,86 | 5,60 | Ações |
| PETROBRAS ON - PETR3 | 12.786,20 | 3,88 | Ações |
| B3 ON NM - B3SA3 | 12.599,86 | 3,82 | Ações |
| BRADERCO PN N1 - BBDC4 | 12.217,96 | 3,70 | Ações |
| ELETRONBRAS ON N1 - ELET3 | 10.732,39 | 3,25 | Ações |
| AMBEV S/A ON - ABEV3 | 9.411,11 | 2,85 | Ações |
| BRASIL ON NM - BBAS3 | 9.275,43 | 2,81 | Ações |
| WEG ON NM - WEGE3 | 8.541,00 | 2,59 | Ações |
| LOCALIZA ON NM - RENT3 | 8.356,30 | 2,53 | Ações |
| ITAUSA PN N1 - ITSA4 | 7.299,74 | 2,21 | Ações |
| GERDAU PN N1 - GGBR4 | 5.400,27 | 1,64 | Ações |
| Outros Valores a receber | 5.326,44 | 1,61 | Valores a pagar/receber |
| BTGP BANCO UNT - BPAC11 | 5.294,66 | 1,60 | Ações |
| EQUATORIAL ON NM - EQTL3 | 5.096,53 | 1,54 | Ações |
| PETRORIO ON NM - PRIO3 | 4.758,60 | 1,44 | Ações |
| SUZANO PAPEL ON NM - SUZB3 | 4.601,14 | 1,39 | Ações |
| Operações Compromissadas - NTN-F - Venc: 01/01/2027 | 4.555,31 | 1,38 | Operação compromissada |
| SABESP ON NM - SBSP3 | 4.218,49 | 1,28 | Ações |
| JBS ON NM - JBSS3 | 3.778,95 | 1,15 | Ações |
| RUMO S.A. ON NM - RAIL3 | 3.751,89 | 1,14 | Ações |
| BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3 | 3.653,29 | 1,11 | Ações |
| LOJAS RENNER ON NM - LREN3 | 3.576,84 | 1,08 | Ações |
| REDE D OR ON NM - RDOR3 | 3.568,79 | 1,08 | Ações |
| TOTVS ON NM - TOTS3 | 3.394,60 | 1,03 | Ações |
| BRADERCO ON N1 - BBDC3 | 3.293,73 | 1,00 | Ações |

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

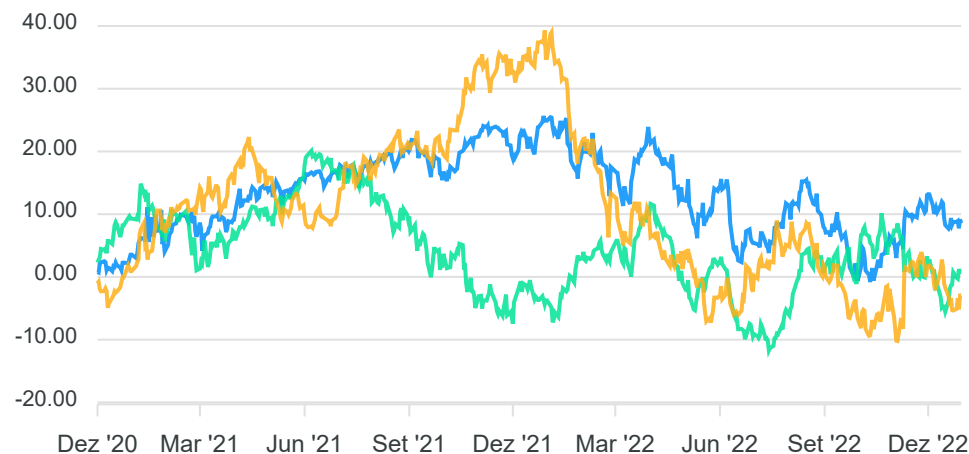
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP
AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I,
CNPJ: 39.272.928/0001-60.

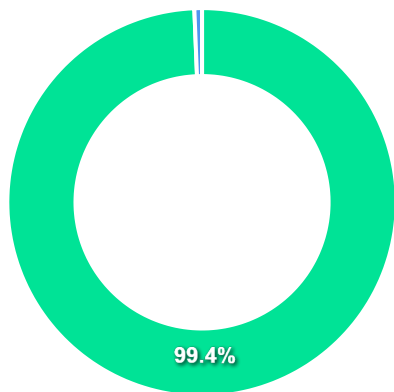
COMPARATIVO

📅 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



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIAÇÕES BD... | 394.861,67 | 96,46 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 11.909,61 | 2,91 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 2.655,54 | 0,65 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 798,51 | 0,20 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 1,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,06 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / IR a recolher | 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 | -3,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -3,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -6,21 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -48,57 | -0,01 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Cotas a resgatar | -810,56 | -0,20 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 406.771,28 | 99.37% |
| Valores a pagar/receber | 2.589,86 | 0.63% |
| Outros | -6,21 | -0.00% |

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 3.4, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 4.248, de 22 de dezembro de 2022.

| Ativo | Saldo Atual | % Carteira | PL R\$ | % PL | Lei |
|---|-------------|------------|----------------|-------|----------|
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 708.755,71 | 34,90% | 827.149.677,31 | 0,09% | 7º I b |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 843.396,61 | 41,53% | 564.735.869,38 | 0,15% | 7º I b |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 478.486,77 | 23,56% ▲ | 396.851.061,29 | 0,12% | 7º III a |

Investimentos

\$ 2.030.639,09


Disponibilidades Financeiras

\$ 1.603,62

Total Carteira

\$ 2.032.242,71

Governança (Pró Gestão)

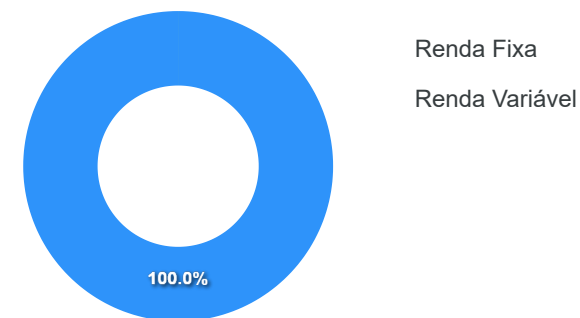
 Não possui

| Artigos | Limite (%) | Utilizado | Livre |
|--------------------------------|------------|-----------|--------------------------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN | 100,00% | 76,38% | 1.552.152,32 23,62% 480.090,39 |
| 7º III a - FI Referenciados RF | 60,00% | 23,54% | 478.486,77 36,46% 740.858,86 |

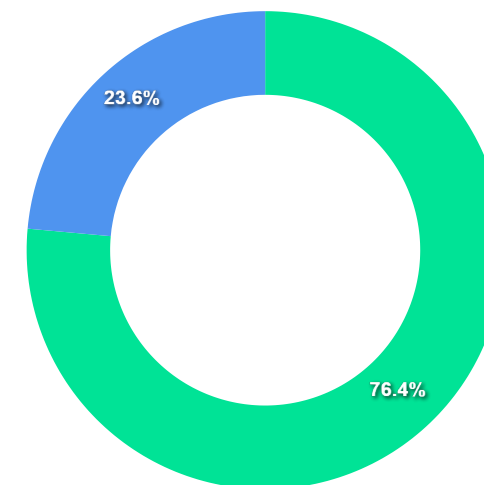
Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

Segmentos



Artigos

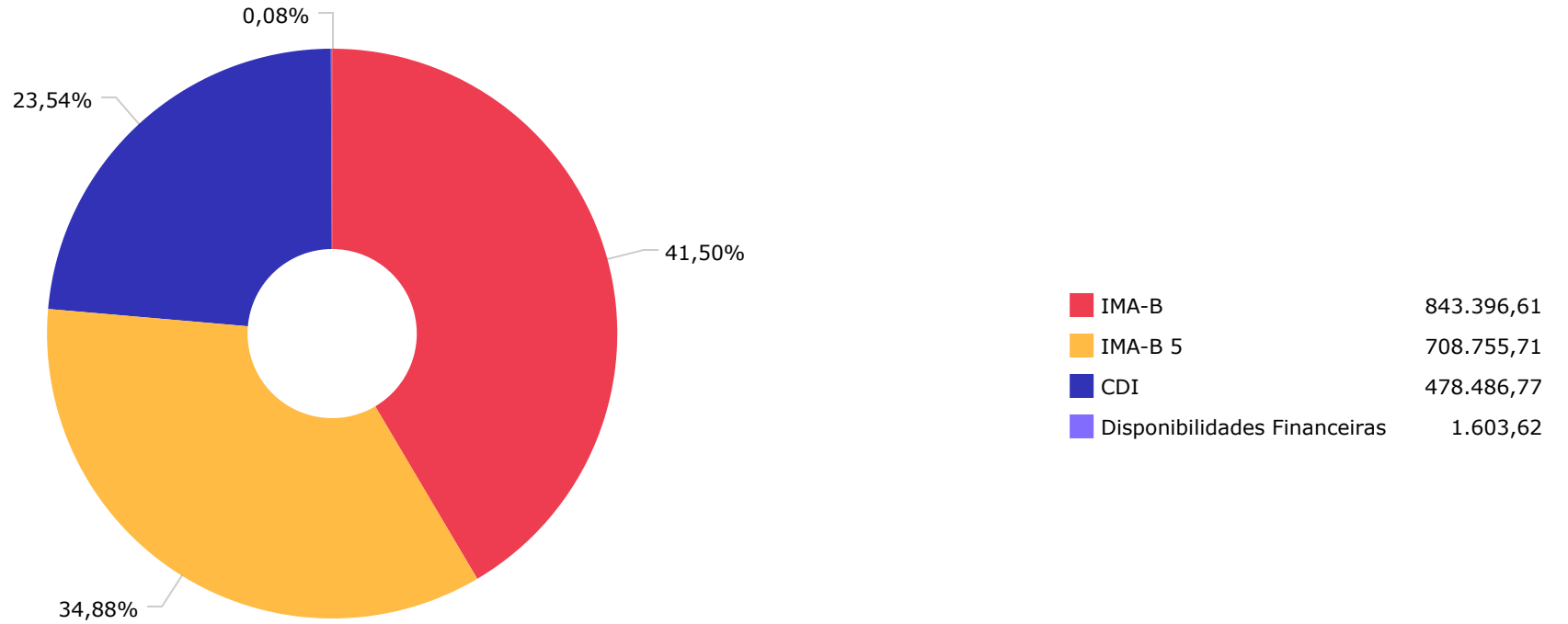


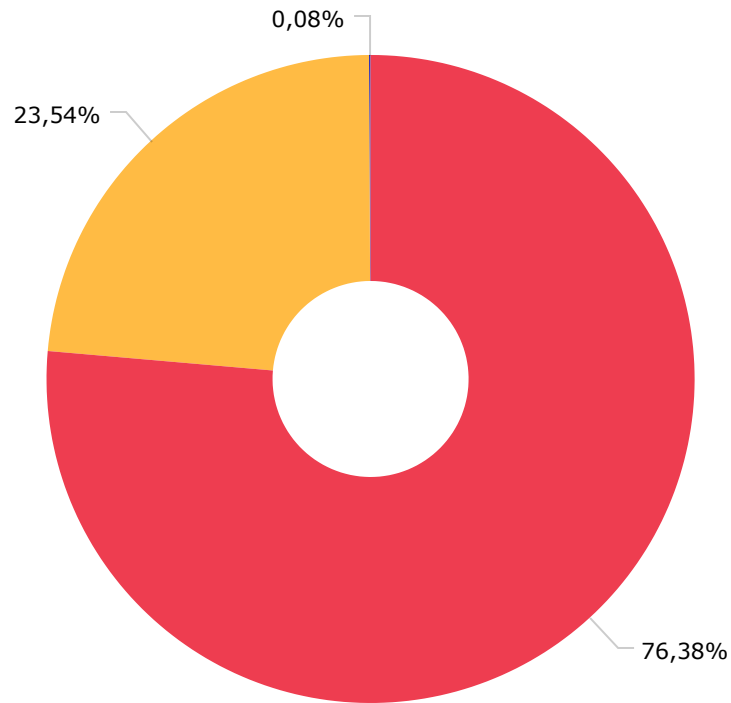
| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|-----------------------------------|--------|----------|--------|----------|--------------|
| 7° I a - Títulos TN SELIC | 0,00% | 0,00% | 9,00% | 100,00% | 2.032.242,71 |
| 7° I b - FI 100% Títulos TN | 76,38% | 0,00% | 40,00% | 100,00% | 480.090,39 |
| 7° III a - FI Referenciados RF | 23,54% | 0,00% | 15,00% | 60,00% | 740.858,86 |
| 7° IV - Ativos Financeiros de ... | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 20,00% | 406.448,54 |

| Artigos | Atual | Inferior | Alvo | Superior | GAP Superior |
|------------------------------|-------|----------|--------|----------|--------------|
| 8° I - Fundos de Ações | 0,00% | 0,00% | 24,00% | 30,00% | 609.672,81 |
| 9° III - Ações - BDR Nível I | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 203.224,27 |
| 10° I - Fundos Multimercados | 0,00% | 0,00% | 1,00% | 10,00% | 203.224,27 |

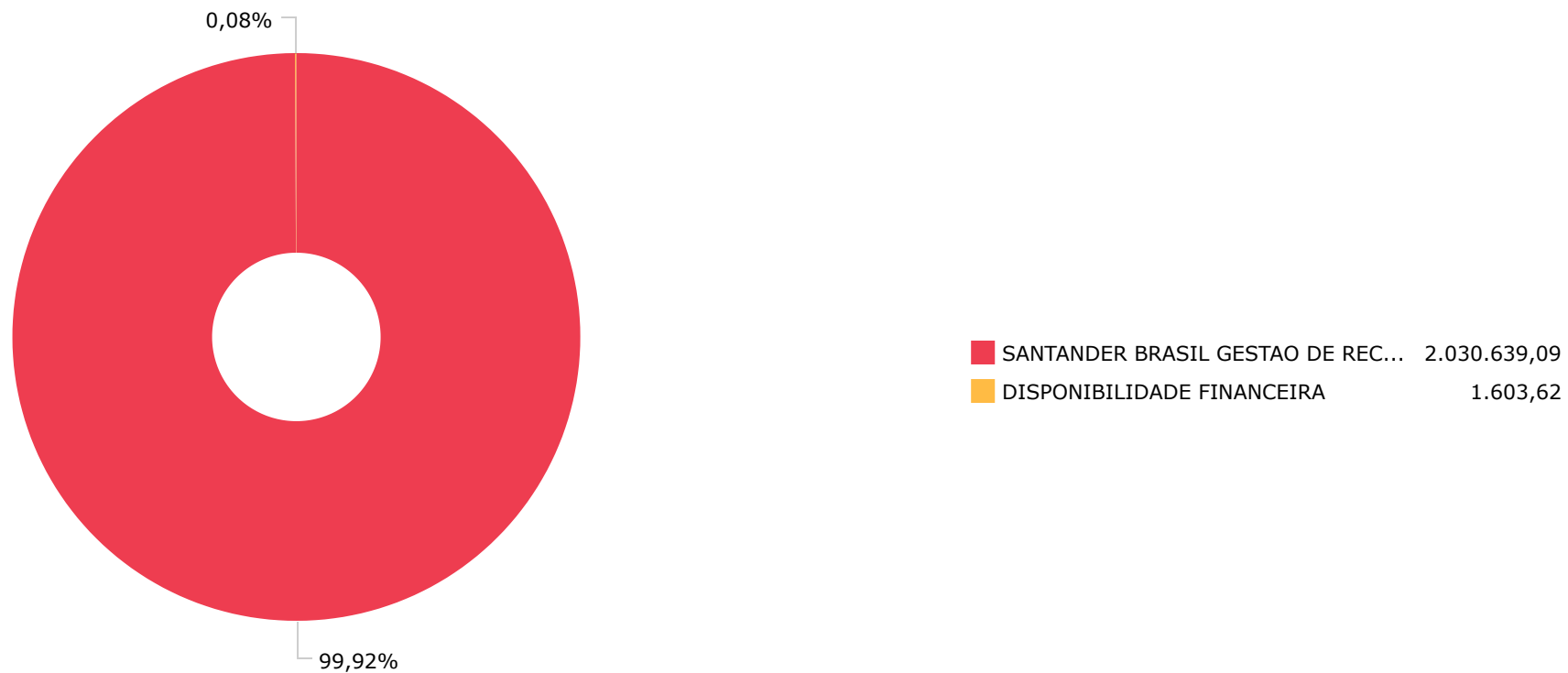
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|---------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| CDI - BENCHMARK | 1,12 | 12,37 | 3,20 | 6,61 | 12,37 | 17,31 | | |
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1,16 | 12,75 | 3,23 | 6,78 | 12,75 | 17,64 | 0,05 | 0,11 |
| GLOBAL BDRX - BENCHMARK | -4,22 | -28,05 | 3,94 | -0,61 | -28,05 | -3,84 | | |
| 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 |
| IBOVESPA - BENCHMARK | -2,45 | 4,69 | -0,27 | 11,36 | 4,69 | -7,80 | | |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | -2,61 | 3,29 | -1,06 | 10,77 | 3,29 | -10,61 | 9,69 | 20,40 |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES | -2,62 | 2,43 | -1,12 | 9,89 | 2,43 | -9,39 | 10,03 | 21,13 |
| IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK | 1,24 | 9,34 | 2,25 | 2,34 | 9,34 | 14,78 | | |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,22 | 9,32 | 2,42 | 2,69 | 9,32 | 14,40 | 1,21 | 2,54 |
| IMA-B - BENCHMARK | -0,19 | 6,37 | 0,23 | 1,94 | 6,37 | 5,02 | | |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | -0,22 | 6,11 | 0,17 | 1,81 | 6,11 | 4,49 | 2,49 | 5,25 |
| 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 |
| IMA-B 5 - BENCHMARK | 0,94 | 9,78 | 2,53 | 2,98 | 9,78 | 14,79 | | |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 0,92 | 9,57 | 2,48 | 2,88 | 9,57 | 14,33 | 1,15 | 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 |
| IMA-B 5+ - BENCHMARK | -1,19 | 3,30 | -1,72 | 1,24 | 3,30 | -3,47 | | |
| 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 |
| IPCA - BENCHMARK | 0,62 | 5,78 | 1,63 | 0,28 | 5,78 | 16,43 | | |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,31 | 10,63 | 2,70 | 3,51 | 10,63 | 16,67 | 0,98 | 2,07 |

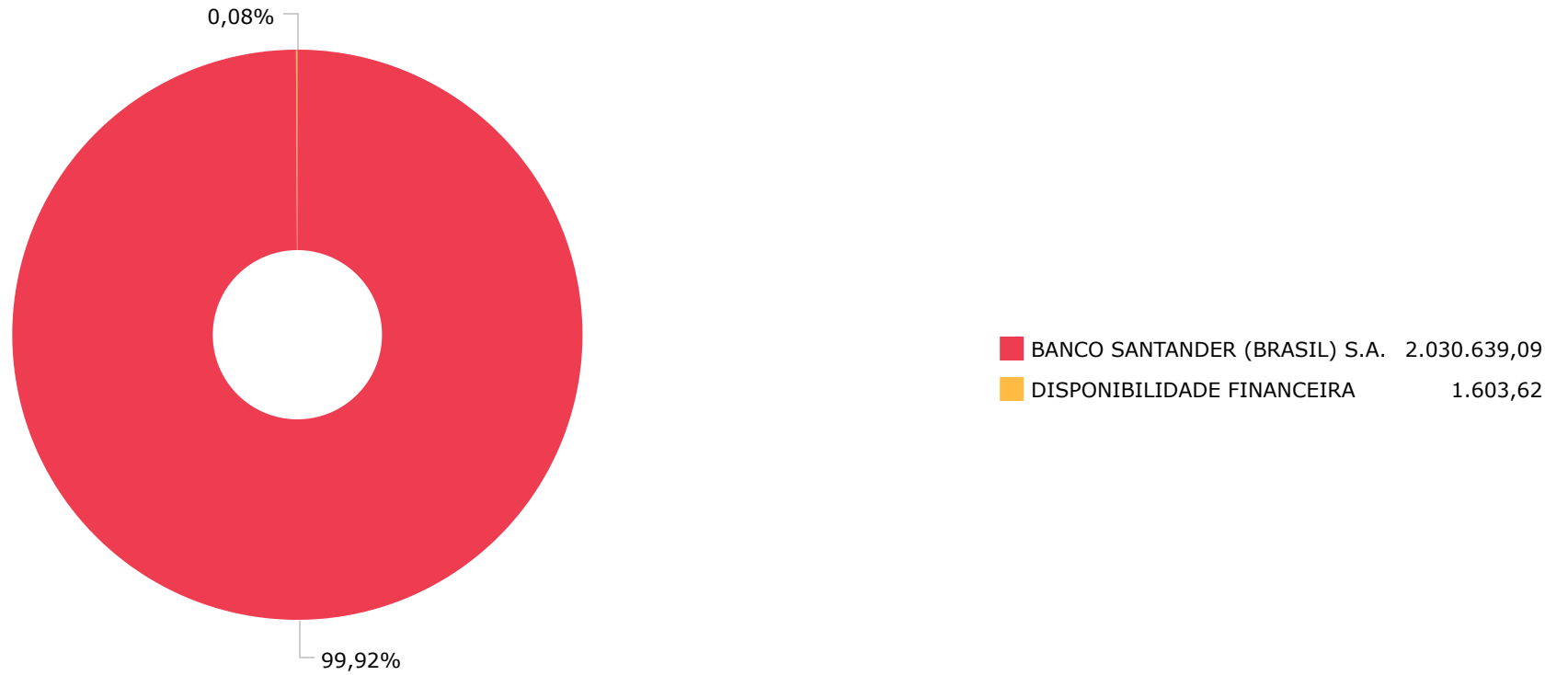
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|--------------|-------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| IRF-M - BENCHMARK | 1,48 | 8,82 | 1,74 | 6,49 | 8,82 | 6,66 | | |
| SANTANDER IRF-M 1 PRO FIC RENDA FIXA | 1,14 | 11,58 | 3,05 | 6,51 | 11,58 | 14,43 | 0,08 | 0,16 |
| IRF-M 1 - BENCHMARK | 1,18 | 12,02 | 3,16 | 6,70 | 12,02 | 15,30 | | |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,16 | 11,73 | 3,09 | 6,56 | 11,73 | 14,68 | 0,08 | 0,17 |





| | |
|---|--------------|
| Renda Fixa Indexados | 1.552.152,32 |
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 478.486,77 |
| Disponibilidades Financeiras | 1.603,62 |





| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|------------|------------|--------------|------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro | 2.247.218,29 | 0,00 | 0,00 | 2.252.564,23 | 5.345,94 | 5.345,94 | 0,24% ▲ | 0,24% | 0,95% | 0,95% | 25,26% | 0,72% |
| Fevereiro | 2.252.564,23 | 37.304,92 | 0,00 | 2.305.367,38 | 15.498,23 | 20.844,17 | 0,68% ▲ | 0,92% | 1,38% | 2,34% | 39,32% | 0,62% |
| Março | 2.305.367,38 | 0,00 | 19.325,00 | 2.324.746,71 | 38.704,33 | 59.548,50 | 1,68% ▲ | 2,61% | 2,05% | 4,44% | 58,78% | 0,98% |
| Abril | 2.324.746,71 | 500.000,00 | 500.000,00 | 2.344.065,24 | 19.318,53 | 78.867,03 | 0,83% ▲ | 3,46% | 1,43% | 5,93% | 58,35% | 0,47% |
| Mai | 2.344.065,24 | 0,00 | 0,00 | 2.366.624,14 | 22.558,90 | 101.425,93 | 0,96% ▲ | 4,46% | 0,90% | 6,88% | 64,83% | 1,00% |
| Junho | 2.366.624,14 | 0,00 | 0,00 | 2.375.618,79 | 8.994,65 | 110.420,58 | 0,38% ▲ | 4,86% | 1,08% | 8,03% | 60,52% | 1,01% |
| Julho | 2.375.618,79 | 90.000,00 | 0,00 | 2.469.850,08 | 4.231,29 | 114.651,87 | 0,17% ▲ | 5,04% | -0,28% | 7,73% | 65,20% | 1,13% |
| Agosto | 2.469.850,08 | 46.966,57 | 20.000,00 | 2.518.419,71 | 21.603,06 | 136.254,93 | 0,87% ▲ | 5,94% | 0,08% | 7,82% | 75,96% | 1,40% |
| Setembro | 2.518.419,71 | 35.000,00 | 0,00 | 2.580.003,24 | 26.583,53 | 162.838,46 | 1,04% ▲ | 7,05% | 0,11% | 7,94% | 88,79% | 1,16% |
| Outubro | 2.580.003,24 | 10.000,00 | 0,00 | 2.624.724,09 | 34.720,85 | 197.559,31 | 1,34% ▲ | 8,48% | 0,98% | 8,99% | 94,33% | 0,73% |
| Novembro | 2.624.724,09 | 0,00 | 50.000,00 | 2.575.566,48 | 842,39 | 198.401,70 | 0,03% ▲ | 8,52% | 0,80% | 9,86% | 86,41% | 2,09% |
| Dezembro | 2.575.566,48 | 40.000,00 | 600.000,00 | 2.030.639,09 | 15.072,61 | 213.474,31 | 0,59% ▲ | 9,15% | 1,05% | 11,01% | 83,11% | 1,45% |

Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$ | Retorno % | Meta % |
|---------|------------|-----------|--------|
| 1º Trim | 59.548,50 | 2,61% | 4,44% |
| 2º Trim | 50.872,08 | 2,19% | 3,44% |
| 1º Sem | 110.420,58 | 4,86% | 8,03% |
| 3º Trim | 52.417,88 | 2,09% | -0,08% |
| 4º Trim | 50.635,85 | 1,97% | 2,85% |
| 2º Sem | 103.053,73 | 4,10% | 2,76% |

Gráfico Retorno e Meta Acumulado

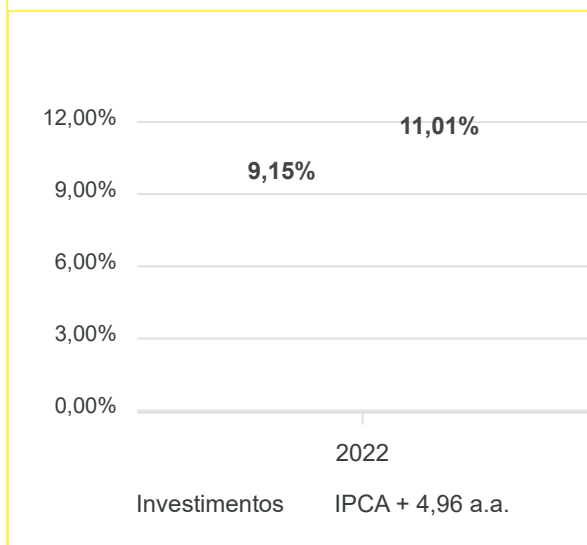
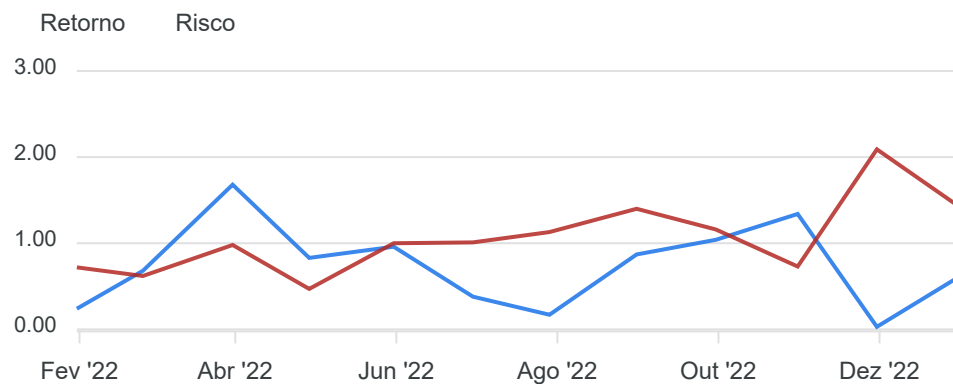
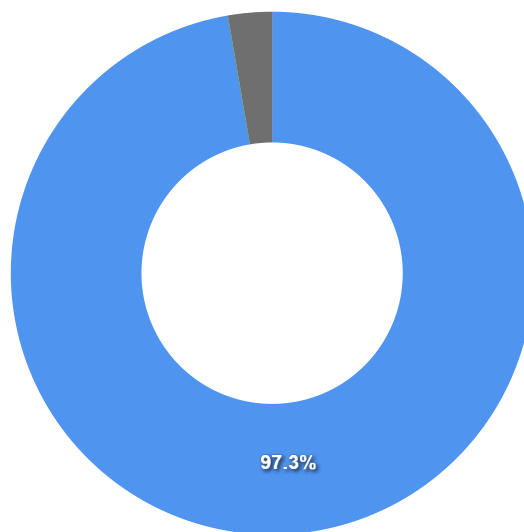


Gráfico Risco x Retorno



Liquidez - 30/12/2022

| Disponibilidade | Valor | % |
|-----------------|---------------|--------|
| Até D+30 | 14.916.494,82 | 734,57 |
| Até D+180 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+360 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+720 | 415.428,08 | 20,46 |
| Até D+1800 | 0,00 | 0,00 |
| Até D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Acima D+3600 | 0,00 | 0,00 |
| Indeterminado | 0,00 | 0,00 |



| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|------------|--------------|------------|-----------|-------------|
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1.028.011,75 | 40.000,00 | 600.000,00 | 478.486,77 | 10.475,02 | 0,98% ▲ | 0,05% |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 702.267,54 | 0,00 | 0,00 | 708.755,71 | 6.488,17 | 0,92% ▲ | 1,15% |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 845.287,19 | 0,00 | 0,00 | 843.396,61 | -1.890,58 | -0,22% ▼ | 2,49% |
| | 2.575.566,48 | 40.000,00 | 600.000,00 | 2.030.639,09 | 15.072,61 | 0,59% | 1,45% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|------------|--------------|------------|-----------|
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1.056.363,61 | 40.000,00 | 650.000,00 | 478.486,77 | 32.123,16 | 2,93% ▲ |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 681.650,32 | 10.000,00 | 0,00 | 708.755,71 | 17.105,39 | 2,47% ▲ |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 841.989,31 | 0,00 | 0,00 | 843.396,61 | 1.407,30 | 0,17% ▲ |
| | 2.580.003,24 | 50.000,00 | 650.000,00 | 2.030.639,09 | 50.635,85 | 1,96% |

| RENDA FIXA | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno \$ | Retorno % |
|---|----------------|------------|--------------|--------------|------------|-----------|
| SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL ADVANCED FIC RENDA FIXA | 1.452.397,42 | 77.304,92 | 1.189.325,00 | 478.486,77 | 138.109,43 | 9,03% ▲ |
| SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA | 0,00 | 681.966,57 | 0,00 | 708.755,71 | 26.789,14 | 3,93% ▲ |
| SANTANDER IMA-B PREMIUM FIC RENDA FIXA LP | 794.820,87 | 0,00 | 0,00 | 843.396,61 | 48.575,74 | 6,11% ▲ |
| | 2.247.218,29 | 759.271,49 | 1.189.325,00 | 2.030.639,09 | 213.474,31 | 9,50% |

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 | 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 | 987 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 7.489.389.892,90 |

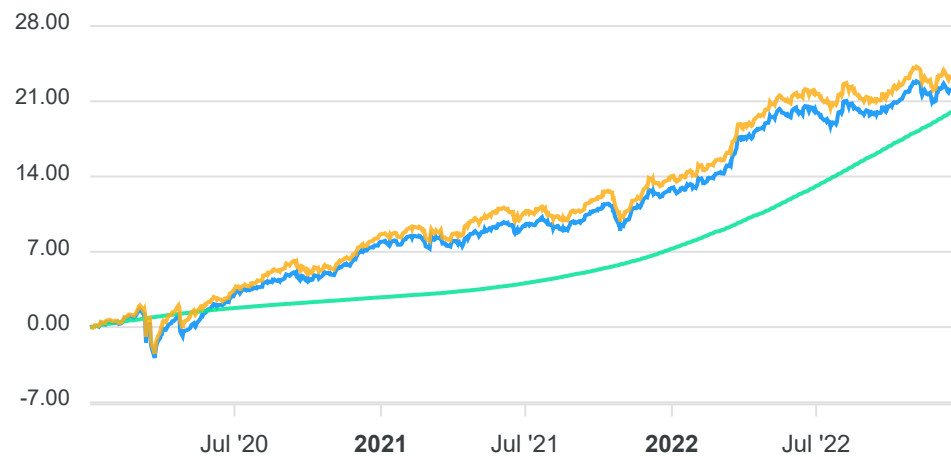
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|---|
| Enquadramento Resolução | Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark | IDKA IPCA 2 Anos |
| Classificação ANBIMA | Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 80% de seus recursos em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

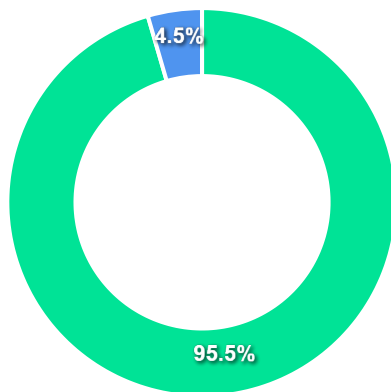
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,22% | 9,32% | 2,42% | 2,69% | 9,32% | 14,40% | 1,21% | 2,54% |
| Benchmark | 1,24% | 9,34% | 2,25% | 2,34% | 9,34% | 14,78% | | |
| CDI | 1,12% | 12,37% | 3,20% | 6,61% | 12,37% | 17,31% | | |



CARTEIRA DO FUNDO



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 6.607.138,50 | 95.50% |
| Operação compromissada | 310.939,81 | 4.49% |
| Valores a pagar/receber | 175,00 | 0.00% |
| Outros | 80,32 | 0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 3.455.182,28 | 49,94 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 2.852.861,96 | 41,24 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 310.939,81 | 4,49 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 299.094,27 | 4,32 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 223,77 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 181,42 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 21,50 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,34 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,17 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,05 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -13,58 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -14,40 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -49,62 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -54,79 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -81,99 | 0,00 | Outros |

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. |

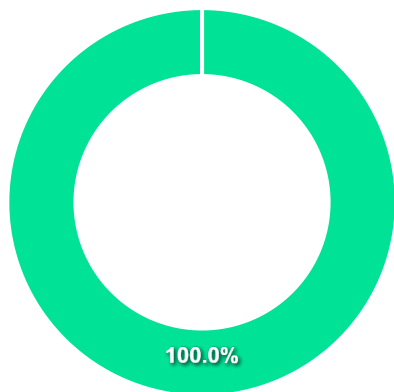
COMPARATIVO

📅 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 | 5.558.960,42 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 3,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Ajuste de Cota Negativa | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -44,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 5.558.960,42 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -60,83 | -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. |

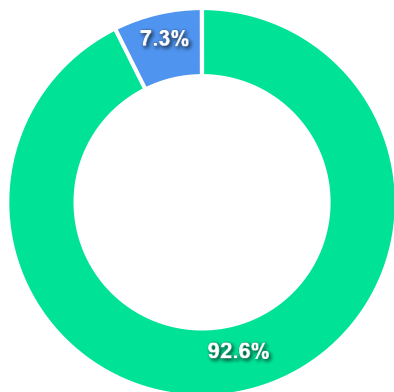
COMPARATIVO

📅 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 | 682.242,81 | 92.65% |
| Operação compromissada | 54.089,75 | 7.35% |
| Valores a pagar/receber | 184,00 | 0.02% |
| Outros | -111,14 | -0.02% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 139.690,76 | 18,97 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 111.165,66 | 15,10 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 99.050,75 | 13,45 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 92.948,14 | 12,62 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 90.152,94 | 12,24 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 61.380,00 | 8,34 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 54.089,75 | 7,35 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 40.267,68 | 5,47 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 30.636,87 | 4,16 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 16.950,02 | 2,30 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 204,72 | 0,03 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 2,57 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,60 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 0,03 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,01 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | -5,12 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -5,66 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -5,88 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -7,28 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -7,89 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -103,26 | -0,01 | Outros |

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. |

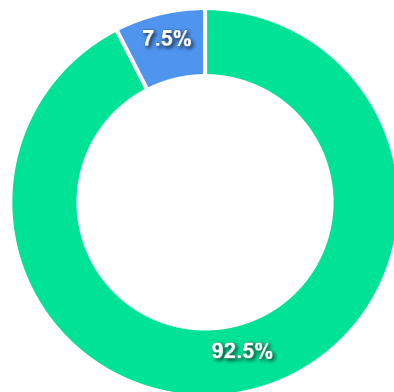
COMPARATIVO

📅 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 | 5.274.809,08 | 92.48% |
| Operação compromissada | 429.019,67 | 7.52% |
| Valores a pagar/receber | 166,36 | 0.00% |
| Outros | -99,29 | -0.00% |

| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| NTN-B - Venc.: 15/08/2024 | 734.255,39 | 12,87 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2050 | 567.613,28 | 9,95 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2026 | 489.421,44 | 8,58 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2023 | 487.087,73 | 8,54 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2025 | 460.409,93 | 8,07 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2035 | 450.437,99 | 7,90 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 429.019,67 | 7,52 | Operação compromissada |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2030 | 401.892,12 | 7,05 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2055 | 394.214,93 | 6,91 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2045 | 365.032,50 | 6,40 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2028 | 304.564,56 | 5,34 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2040 | 247.902,71 | 4,35 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/05/2027 | 197.339,20 | 3,46 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2032 | 120.359,12 | 2,11 | Títulos Federais |
| NTN-B - Venc.: 15/08/2060 | 54.278,16 | 0,95 | Títulos Federais |
| Outras Disponibilidades | 202,54 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | 99,80 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 27,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | 17,15 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | 8,87 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 5,10 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 0,75 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 0,08 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -2,04 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 15/... | -3,12 | 0,00 | Outros |
| Mercado Futuro - Posições compradas / DAP FUTURO BMF - 17/... | -21,51 | 0,00 | Outros |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|--|
| Administrador BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Gestão BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+0 |
| Quantidade de Cotistas 1.114 |
| Patrimônio Líquido Fundo 6.516.931.621,39 |

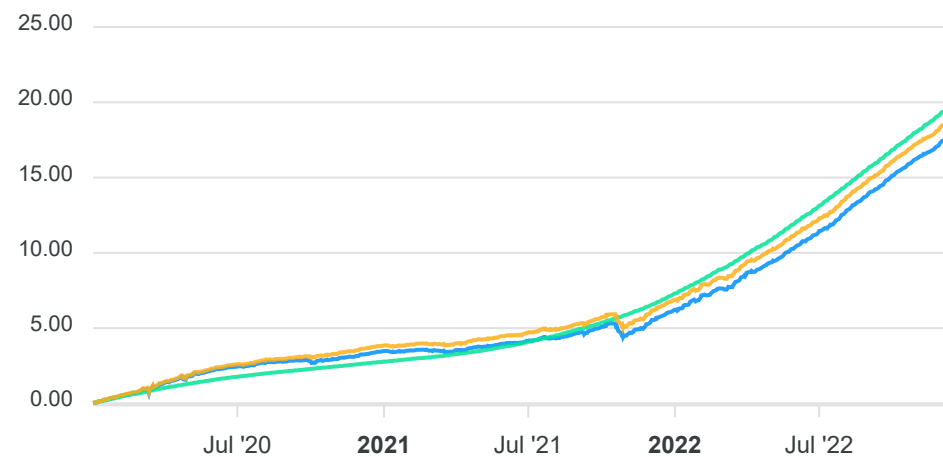
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M 1 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento que mantenham 100% de suas carteiras em Títulos Públicos Federais. |

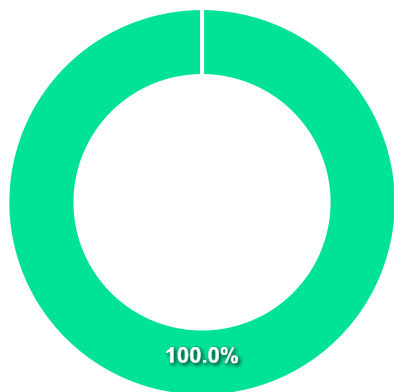
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 11,73% | 3,09% | 6,56% | 11,73% | 14,68% | 0,08% | 0,17% |
| Benchmark | 1,18% | 12,02% | 3,16% | 6,70% | 12,02% | 15,30% | | |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 6.481.908,92 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | 29,36 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | 25,72 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa CVM | 8,87 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 6,49 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 6.481.908,92 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | 71,26 | 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 140 |
| Patrimônio Líquido Fundo 183.585.511,92 |

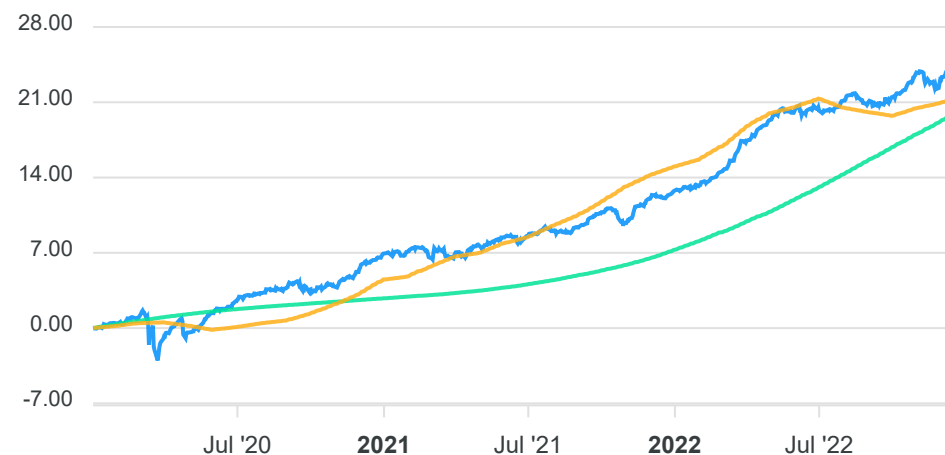
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IPCA |
| Classificação ANBIMA Não classificado |
| Política de Investimento Aplica, no mínimo, 80% (oitenta por cento) de sua carteira em ativos financeiros cuja rentabilidade esteja atrelada à variação da taxa de juros doméstica e/ou de índices de preços. |

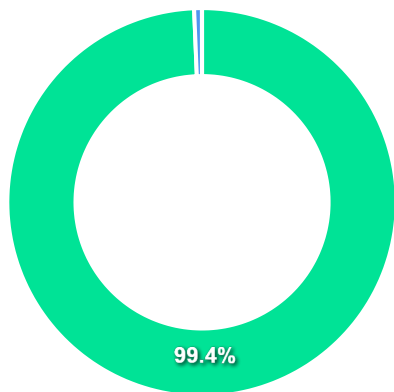
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,31% | 10,63% | 2,70% | 3,51% | 10,63% | 16,67% | 0,98% | 2,07% |
| 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 | 182.049,80 | 99,35 | Títulos Federais |
| Operações Compromissadas - LFT - Venc.: 01/09/2028 | 1.169,23 | 0,64 | Operação compromissada |
| Outras Disponibilidades | 35,94 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 6,96 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Auditoria | 0,47 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Selic | -1,20 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa de Custódia | -1,32 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -2,14 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | -4,52 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -4,73 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -8,42 | 0,00 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Títulos Federais | 182.049,80 | 99.35% |
| Operação compromissada | 1.169,23 | 0.64% |
| Valores a pagar/receber | 25,77 | 0.01% |
| Outros | -4,73 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,10% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 128 |
| Patrimônio Líquido Fundo 827.149.677,31 |

PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B 5 |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aloca os seus recursos em cotas de fundos da classe Renda Fixa, que tenham como principal fator de risco a variação dos índices de preços ou da taxa de juros doméstica. Pode atuar nos mercados de derivativos para fins de hedge e posicionamento. |

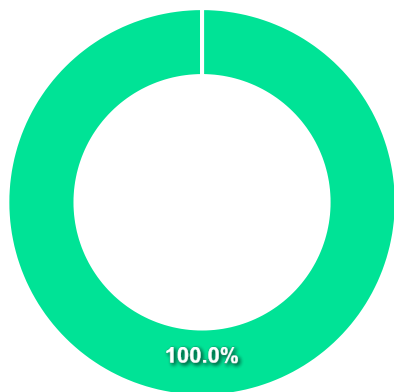
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 0,92% | 9,57% | 2,48% | 2,88% | 9,57% | 14,33% | 1,15% | 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 |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de SANTANDER IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 835.890,44 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 61,52 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -119,74 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vir Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 835.890,44 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -53,22 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,20% |
| Taxa de Performance 20,00% |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 126 |
| Patrimônio Líquido Fundo 564.735.869,38 |

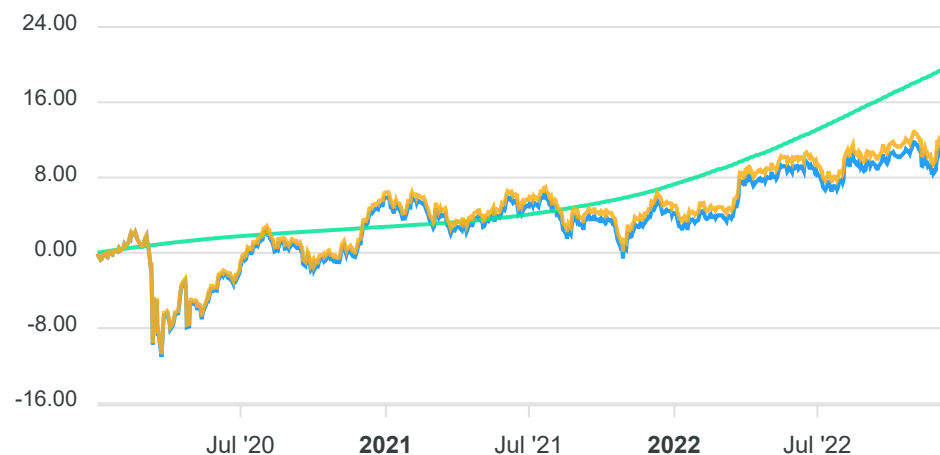
PERFIL DO FUNDO

| |
|---|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IMA-B |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento os quais investem em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de renda fixa. |

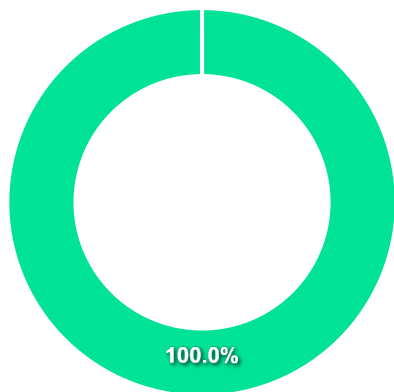
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | -0,22% | 6,11% | 0,17% | 1,81% | 6,11% | 4,49% | 2,49% | 5,25% |
| 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 |
|---|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de SANTANDER IMA-B FI RENDA FIXA LP | 602.041,18 | 100,01 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 9,31 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -72,39 | -0,01 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 602.041,18 | 100.01% |
| Valores a pagar/receber | -58,08 | -0.01% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,40% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 19 |
| Patrimônio Líquido Fundo 41.379.142,83 |

PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso I, Alínea B |
| Benchmark IRF-M |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Indexados |
| Política de Investimento Aplica seus recursos, principalmente, em cotas de fundos de investimento em renda fixa e fundos de investimento em índice de renda fixa que invistam apenas em títulos públicos e operações compromissadas lastradas nesses títulos. |

COMPARATIVO

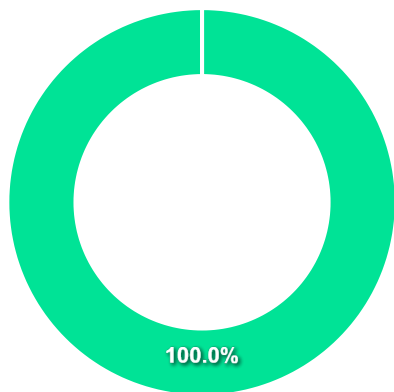
📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,14% | 11,58% | 3,05% | 6,51% | 11,58% | 14,43% | 0,08% | 0,16% |
| Benchmark | 1,48% | 8,82% | 1,74% | 6,49% | 8,82% | 6,66% | | |
| 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 SANTANDER IRF-M 1 PREMIUM FI RENDA FIXA | 41.960,61 | 100,00 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 7,96 | 0,02 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,01 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -13,62 | -0,03 | Valores a pagar/receber |



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 41.960,61 | 100.00% |
| Valores a pagar/receber | -0,54 | -0.00% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| |
|---|
| Administrador BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração 0,30% |
| Taxa de Performance Não possui |
| Disponibilidade de Resgate D+1 |
| Quantidade de Cotistas 158 |
| Patrimônio Líquido Fundo 396.851.061,29 |

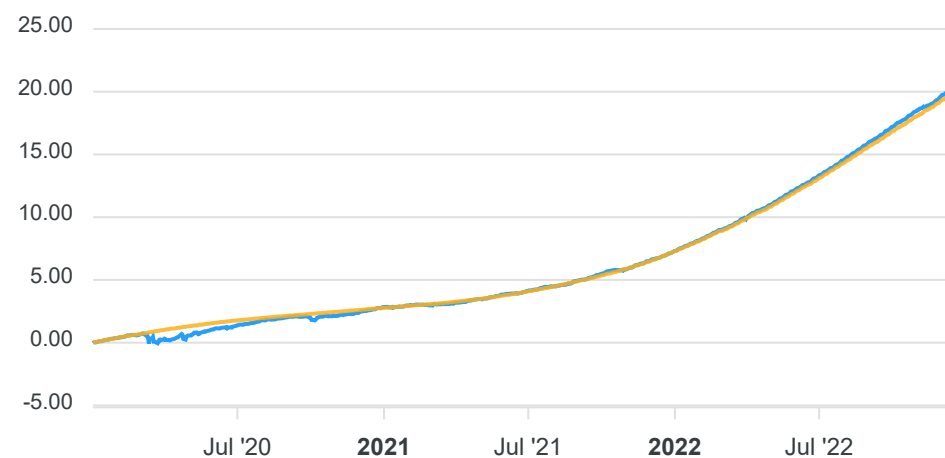
PERFIL DO FUNDO

| |
|--|
| Enquadramento Resolução Artigo 7º, Inciso III, Alínea A |
| Benchmark CDI |
| Classificação ANBIMA Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento |
| Política de Investimento Aplica seus recursos em cotas de fundos de investimento da classe Renda Fixa, os quais invistam em ativos financeiros e/ou modalidades operacionais de relacionados à variação das taxas de juros, pós ou pré-fixadas, de índices de preços, ou ambos. |

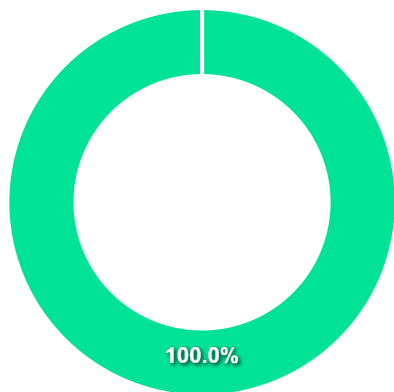
COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-----------|--------------------|
| Fundo | 1,16% | 12,75% | 3,23% | 6,78% | 12,75% | 17,64% | 0,05% | 0,11% |
| 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 SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA | 345.719,71 | 99,65 | Fundos de Investimento |
| Cotas de SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA REFERENC... | 1.354,35 | 0,39 | Fundos de Investimento |
| Outros Valores a receber | 401,22 | 0,12 | Valores a pagar/receber |
| Outras Disponibilidades | 5,00 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | -549,16 | -0,16 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 347.074,06 | 100.04% |
| Valores a pagar/receber | -142,94 | -0.04% |

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

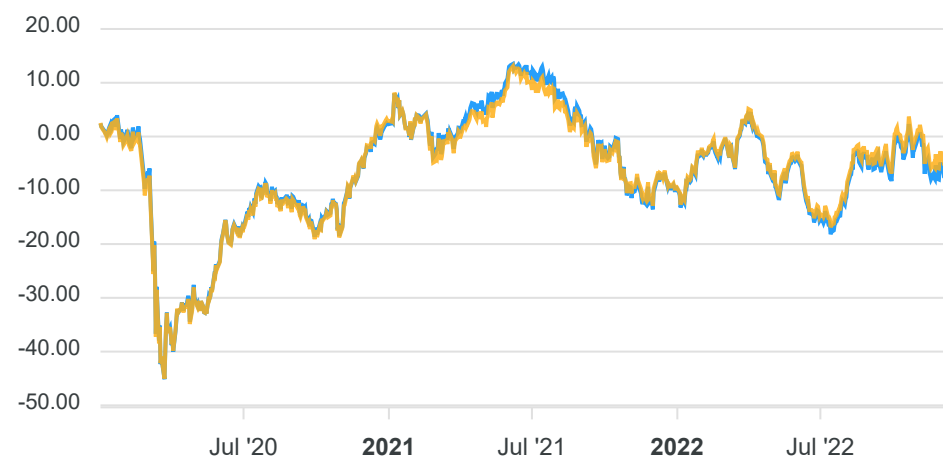
Classificação ANBIMA
Ações Sustentabilidade/Governança

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% | | |



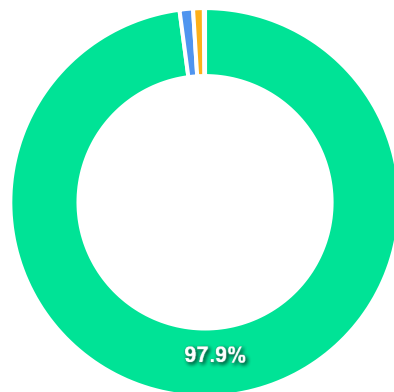
CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo

Vlr Ativo (mil)

Particip. (%)

Tipo Ativo



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|------------------------|----------------------|
| Ações | 766.546,77 | 97.90% |
| Valores a pagar/receber | 8.725,07 | 1.11% |
| Operação compromissada | 6.899,40 | 0.88% |
| Outros | 815,62 | 0.10% |

PERFIL E CARACTERÍSTICAS

| | |
|----------------------------|---|
| Administrador | BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. |
| Gestão | SANTANDER BRASIL GESTAO DE RECURSOS LTDA. |
| Taxa de Administração | 0,75% |
| Taxa de Performance | Não possui |
| Disponibilidade de Resgate | D+4 |
| Quantidade de Cotistas | 35 |
| Patrimônio Líquido Fundo | 308.702.229,09 |

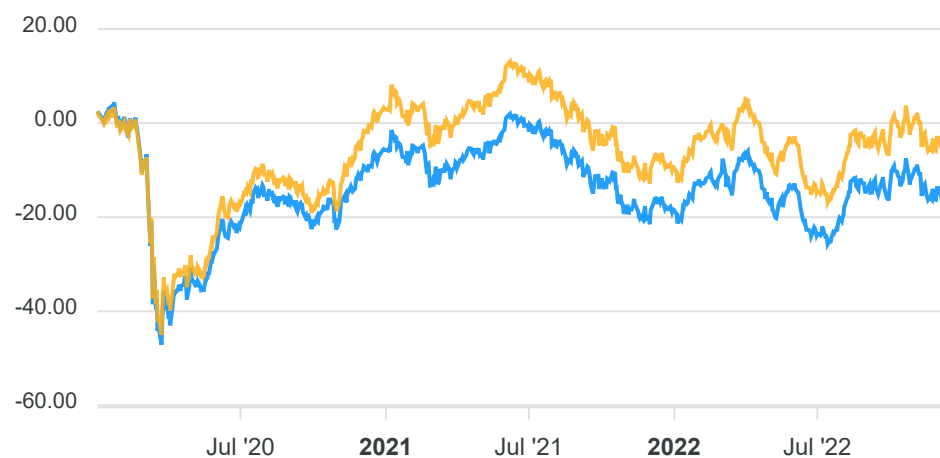
PERFIL DO FUNDO

| | |
|--------------------------|--|
| Enquadramento Resolução | Artigo 8º, Inciso I |
| Benchmark | Ibovespa |
| Classificação ANBIMA | Ações Índice Ativo |
| Política de Investimento | Aplica, no mínimo, 67% de seus recursos em ações, bônus ou recibos de subscrição, certificados de depósitos de ações, cotas de fundos de ações e cotas dos fundos de índice de ações negociadas em mercado organizado e BDR classificados como nível II e III. |

COMPARATIVO

📅 30/12/2022

| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|-----------|--------|-------|--------|--------|-------|---------|-----------|--------------------|
| Fundo | -2,61% | 3,29% | -1,06% | 10,77% | 3,29% | -10,61% | 9,69% | 20,40% |
| Benchmark | -2,45% | 4,69% | -0,27% | 11,36% | 4,69% | -7,80% | | |



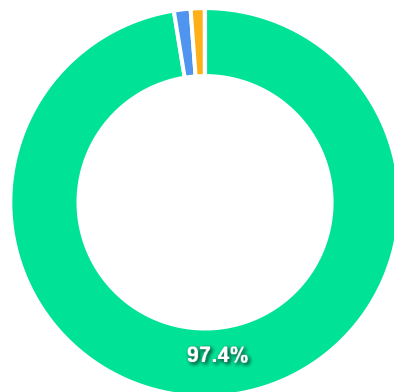
CARTEIRA DO FUNDO

Nome do Ativo

Vlr Ativo (mil)

Particip. (%)

Tipo Ativo



| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|------------------------|----------------------|
| Ações | 321.432,35 | 97.43% |
| Operação compromissada | 4.555,31 | 1.38% |
| Valores a pagar/receber | 3.818,63 | 1.16% |
| Derivativos | 79,56 | 0.02% |
| Fundos de Investimento | 15,33 | 0.00% |

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

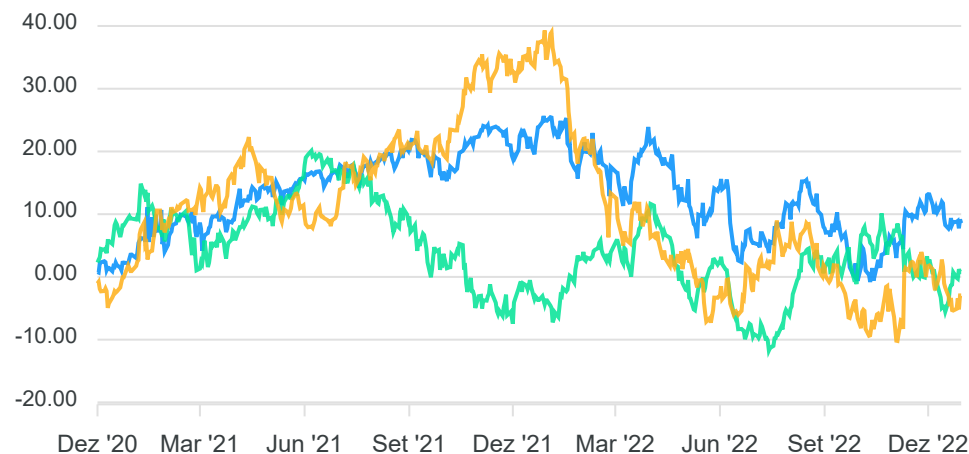
Classificação ANBIMA
Ações Livre

Política de Investimento
Aplica seus recursos, principalmente, em cotas do BB TOP
AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I,
CNPJ: 39.272.928/0001-60.

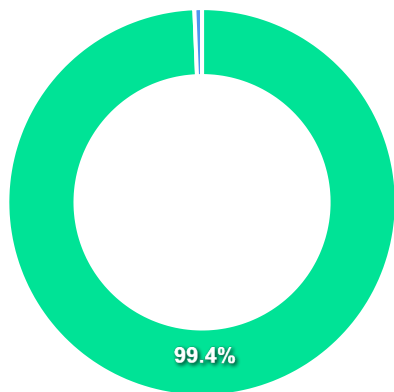
COMPARATIVO

📅 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



| Nome do Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) | Tipo Ativo |
|--|-----------------|---------------|-------------------------|
| Cotas de BB TOP AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIAÇÕES BD... | 394.861,67 | 96,46 | Fundos de Investimento |
| Cotas de BB TOP DI FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 11.909,61 | 2,91 | Fundos de Investimento |
| Outras Disponibilidades | 2.655,54 | 0,65 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a receber | 798,51 | 0,20 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Auditoria | 1,58 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Outros Valores a pagar | 0,06 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / IR a recolher | 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 | -3,02 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Taxa Cetip | -3,81 | 0,00 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / PROV.CVM 28/04/23 | -6,21 | 0,00 | Outros |
| Valores a pagar / Taxa de Administração | -48,57 | -0,01 | Valores a pagar/receber |
| Valores a pagar / Cotas a resgatar | -810,56 | -0,20 | Valores a pagar/receber |

| Ativo | Vlr Ativo (mil) | Particip. (%) |
|-------------------------|-----------------|---------------|
| Fundos de Investimento | 406.771,28 | 99.37% |
| Valores a pagar/receber | 2.589,86 | 0.63% |
| Outros | -6,21 | -0.00% |

