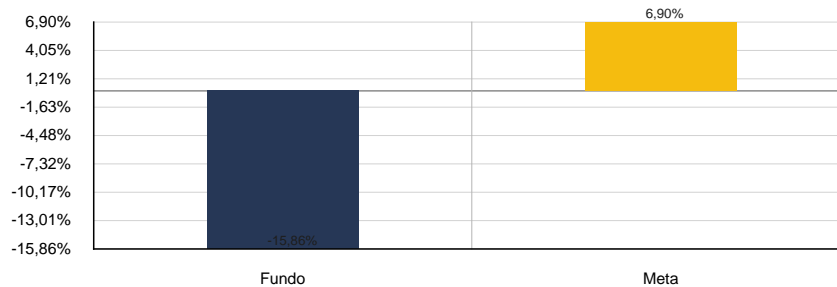
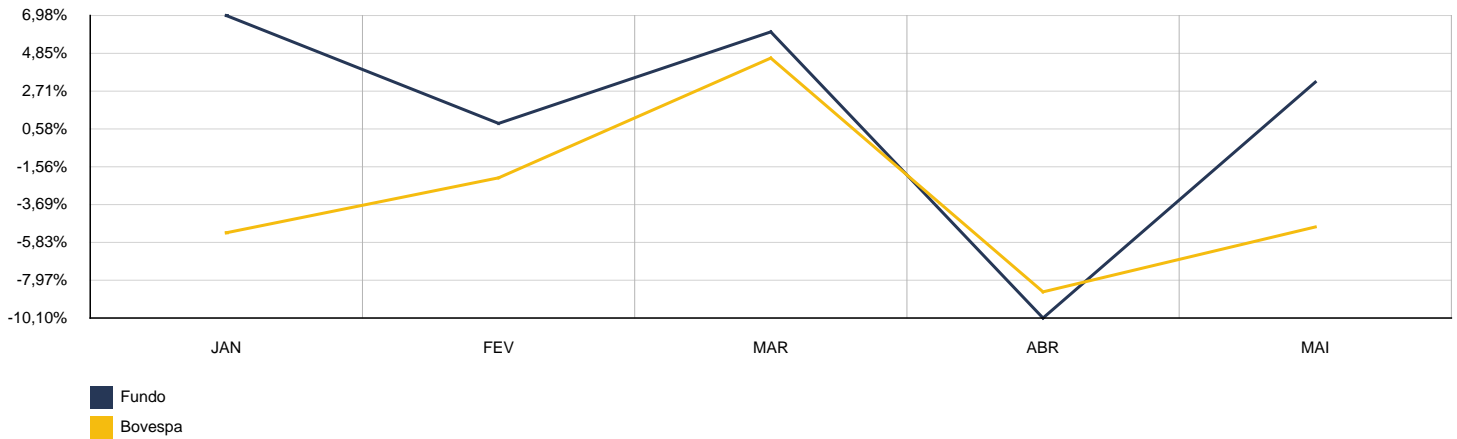


2022	ITAU PV MULTIM. SP500 BRL FICFI					CNPJ: 26.269.692/0001-61	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.477.538,14	0,00	0,00	1.399.424,05	-78.114,09	-5,29%	0,94%
Fevereiro	1.399.424,05	0,00	399.424,05	969.440,78	-30.559,22	-2,18%	1,41%
Março	969.440,78	0,00	0,00	1.013.856,94	44.416,16	4,58%	2,03%
Abril	1.013.856,94	0,00	0,00	926.418,41	-87.438,53	-8,62%	1,46%
Mai	926.418,41	0,00	880.474,40	0,00	-45.944,01	-4,96%	0,87%
Acumulado no Ano					-197.639,69	-15,86%	6,90%

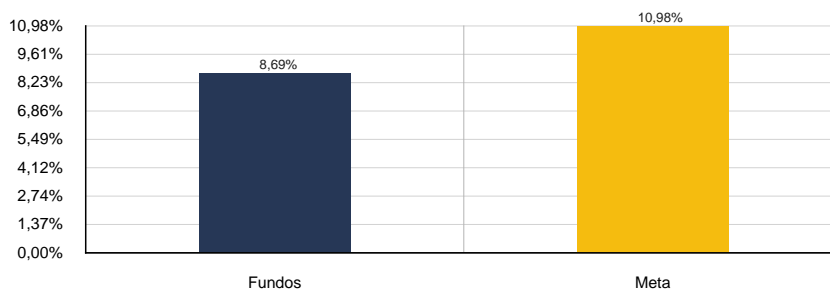
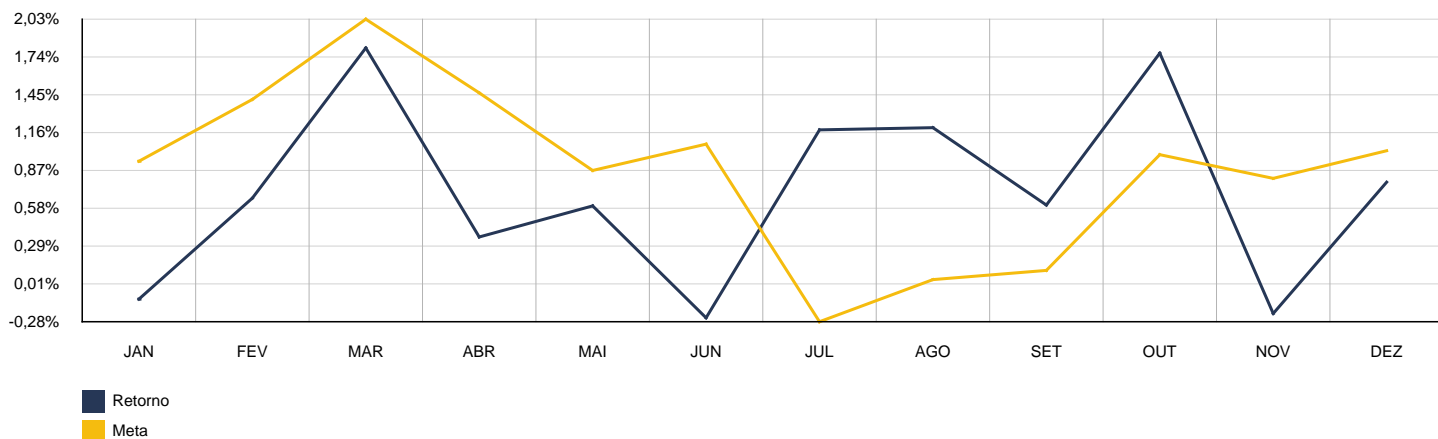
ITAU PV MULTIM. SP500 BRL FICFI



4. CONSOLIDADO

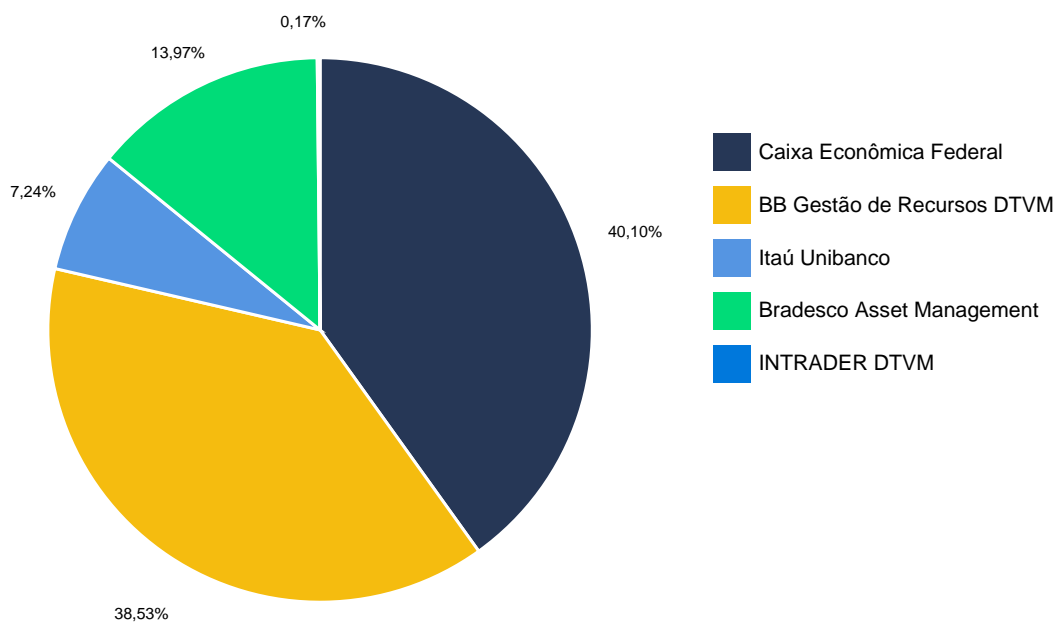
Como pode ser observado pela tabela abaixo a rentabilidade no acumulado do ano ficou em 8,69% enquanto que a meta atuarial acumulada foi de 10,98%, ou seja, o Instituto atingiu 79,18% da meta atuarial.

MÊS	ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META	GAP
Janeiro	40.790.388,86	0,00	816.751,13	39.929.614,14	-44.023,59	-0,11%	0,94%	-11,69%
Fevereiro	39.929.614,14	871.860,01	468.727,73	40.599.375,98	266.629,56	0,66%	1,41%	46,74%
Março	40.599.375,98	598.191,57	29.689,62	41.912.017,81	744.139,88	1,81%	2,03%	89,18%
Abril	41.912.017,81	325.665,13	322.382,36	42.068.038,55	152.737,97	0,36%	1,46%	24,88%
Mai	42.058.038,55	10.396.022,15	10.751.302,78	41.953.661,08	250.903,16	0,60%	0,87%	68,99%
Junho	41.946.128,21	6.433.873,01	5.690.378,49	42.581.714,29	-107.908,44	-0,25%	1,07%	-23,56%
Julho	42.580.612,44	0,00	0,00	43.083.914,64	503.302,20	1,18%	-0,28%	-418,43%
Agosto	43.083.914,64	15.988.019,60	16.284.080,56	43.300.798,07	512.944,39	1,20%	0,04%	3.086,21%
Setembro	43.300.798,07	2.043.701,74	1.500.000,00	44.111.078,75	266.578,94	0,61%	0,11%	557,60%
Outubro	44.111.078,75	487.798,59	0,00	45.387.326,84	788.449,50	1,77%	0,99%	178,09%
Novembro	45.387.326,84	0,00	98.363,62	45.189.357,15	-99.606,07	-0,22%	0,81%	-27,09%
Dezembro	45.189.357,15	1.000.000,00	1.000.000,00	45.543.145,61	353.788,46	0,78%	1,02%	76,55%
Acumulado no Ano					3.587.935,96	8,69%	10,98%	79,18%
Disponibilidade Financeira					R\$ 517.782,21			
Patrimônio Líquido					R\$ 46.060.927,82			



5. CONSOLIDADO POR GESTOR

GESTÃO	VALOR	% S/ CARTEIRA	% S/ PL GESTÃO
Caixa Econômica Federal	18.260.762,59	40,10%	0,04%
BB Gestão de Recursos DTVM	17.547.000,87	38,53%	0,03%
Itaú Unibanco	3.297.531,11	7,24%	0,07%
Bradesco Asset Management	6.361.044,45	13,97%	0,06%
INTRADER DTVM	76.806,59	0,17%	0,74%
Total da Carteira	45.543.145,61	100,00%	



6. RETORNO POR SEGMENTO

SEGMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
Renda Fixa	39.250.849,80	1.000.000,00	1.000.000,00	39.683.256,61	432.406,81	1,10%
Renda Variável	3.189.376,88	0,00	0,00	3.080.630,93	-108.745,95	-3,41%
Estruturado	2.749.130,47	0,00	0,00	2.779.258,07	30.127,60	1,10%

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.165.305,60	0,00	0,00	1.178.789,11	13.483,51	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.428.857,15	0,00	0,00	1.444.894,81	16.037,66	1,12%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	9.355.252,72	0,00	0,00	9.478.667,91	123.415,19	1,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.348.689,64	0,00	0,00	3.380.668,52	31.978,88	0,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.399.714,80	0,00	0,00	3.431.241,59	31.526,79	0,93%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.290.696,46	0,00	0,00	1.287.254,11	-3.442,35	-0,27%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.399.793,52	0,00	0,00	1.412.795,84	13.002,32	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RENDA FIXA	6.010.484,76	1.000.000,00	0,00	7.085.170,56	74.685,80	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RENDA FIXA LP	1.508.136,48	0,00	0,00	1.529.912,33	21.775,85	1,44%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	9.134.927,06	0,00	1.000.000,00	8.232.883,86	97.956,80	1,07%
FI RECUPERACAO BRASIL RF LONGO PRAZO	77.790,22	0,00	0,00	76.806,59	-983,63	-1,26%
ITAU INST. GLOBAL DINAMICO RF LP FIC	1.131.201,39	0,00	0,00	1.144.171,38	12.969,99	1,15%

ATIVOS RENDA VARIÁVEL	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
-----------------------	----------------	------------	----------	-------------	---------	---------

BB AÇÕES AGRO FIC FI	952.309,45	0,00	0,00	927.271,20	-25.038,25	-2,63%
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	956.825,78	0,00	0,00	934.601,01	-22.224,77	-2,32%
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI	1.280.241,65	0,00	0,00	1.218.758,72	-61.482,93	-4,80%

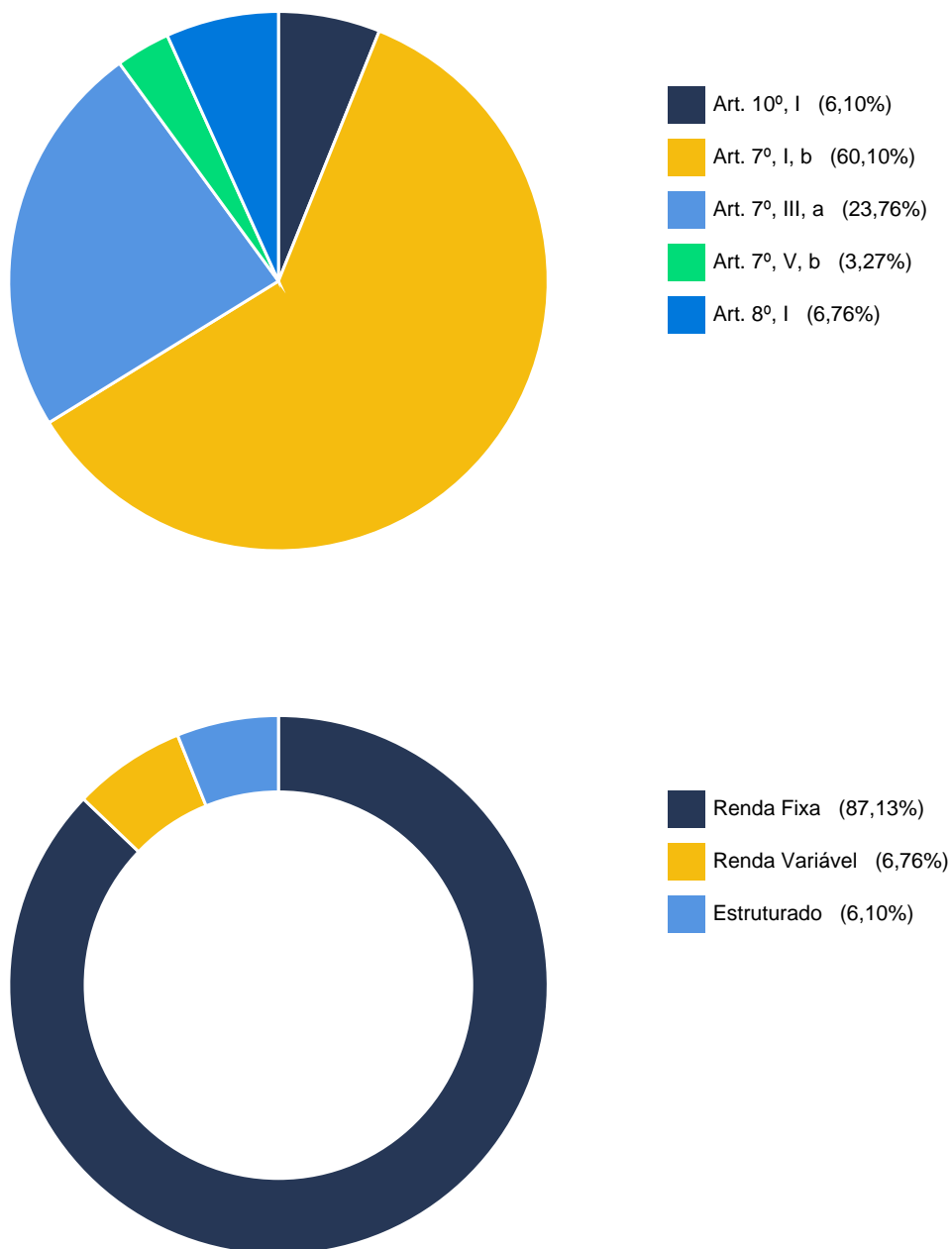
ATIVOS ESTRUTURADO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.124.869,28	0,00	0,00	1.136.709,32	11.840,04	1,05%
BRADESCO FC DE FI MULTIMERCADO MACRO INST	1.624.261,19	0,00	0,00	1.642.548,75	18.287,56	1,13%

7. ENQUADRAMENTO

O enquadramento da carteira é com base na legislação vigente, a proposta de estratégia para o exercício é deliberada pelo colegiado, a carteira deve seguir a PAI - Política Anual de Investimento considerando limites mínimos e máximos.

OBJETIVO DE ALOCAÇÃO DOS RECURSOS POR SEGMENTO DE APLICAÇÃO E CARTEIRA					
Alocação dos Recursos / Diversificação	Alocação dos Recursos				
	Limite da Resolução	Limite Inferior %	Enquadramento Atual	%	Limite Superior %
Renda Fixa					
Títulos TN SELIC - Art.7º, I, "a"	100%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, "b"		0,00%	R\$ 27.371.704,13	60,10%	100,00%
FI Ref em Índices de RF 100 TP - Art.7º, I, "c"		0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Oper. Compromissadas em TP TN - Art. 7º, II	5%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
FI referenciados RF - Art. 7º, III, "a"	60%	0,00%	R\$ 10.821.950,05	23,76%	60,00%
FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Renda Fixa de emissão Bancária - Art. 7º, IV	20%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
FI em Direito Creditório - Sênior - Art. 7º, V, "a"	5%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		0,00%	R\$ 1.489.602,43	3,27%	5,00%
FI de Debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c"		0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Renda Variável e Investimentos Estruturados					
FI de Ações - Art. 8, I	30%	0,00%	R\$ 3.080.630,93	6,76%	30,00%
ETF - Índices de ações - Art. 8º, II		0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Investimento do Exterior					
Renda Fixa - Dívida Externa - Art. 9º, I	10%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Constituído no Brasil - Art. 9º, II		0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Ações - BDR Nível I - Art. 9º, III		0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Estruturado					
FI Multimercados - Art. 10, I	10%	0,00%	R\$ 2.779.258,07	6,10%	10,00%
FI em Participações - Art. 10, II	5%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
FI Mercado de Acesso - Art. 10, III		0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Imobiliário					
FI Imobiliários - Art. 11	5%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
Consignado					
Empréstimos consignado - Art. 12	5%	0,00%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%
TOTAL GERAL		0,00%	R\$ 45.543.145,61	100,00%	205,00%

8. ENQUADRAMENTO RESOLUÇÃO N. 4.963/2021



9. GERENCIAMENTO DE RISCO

Fundo	Sharpe	VAR	Modi M.	Sharpe M.
BB AÇÕES AGRO FIC FI	0,00	0,01%	0,12	0,00
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	0,00%	0,12	0,00
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENVIÁRIO	0,00	0,00%	0,12	0,00
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01	0,00%	0,13	0,01
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,00	0,00%	0,11	0,00
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	0,01%	0,12	0,00
BRADESCO FC DE FI MULTIMERCADO MACRO INST	0,00	0,00%	0,12	0,00
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	0,00	0,01%	0,12	0,00
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	0,02%	0,12	0,00
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	0,01%	0,12	0,00
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RENDA FIXA	0,00	0,00%	0,12	0,00
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RENDA FIXA LP	0,00	0,01%	0,12	0,00
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	0,03	0,00%	0,13	0,03
FI RECUPERACAO BRASIL RF LONGO PRAZO	0,00	0,01%	0,10	0,00
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	0,00	0,05%	0,12	0,00
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI	0,00	0,06%	0,12	0,00
ITAU INST. GLOBAL DINAMICO RF LP FIC	0,00	0,00%	0,12	0,00

10. ÍNDICES ECONÔMICOS

ÍNDICE	MÊS	ANTERIOR	6 MESES	ANO	12 MESES
Bovespa	-2,45%	-3,06%	11,36%	4,69%	4,69%
CDI	1,12%	1,02%	7,70%	12,39%	13,26%
IMA-B	-0,19%	-0,79%	1,94%	6,37%	6,37%
IMA-B 5	0,94%	-0,33%	2,98%	9,78%	9,78%
IMA-B 5+	-1,19%	-1,18%	1,24%	3,30%	3,30%
IMA-Geral	0,77%	-0,06%	4,95%	9,66%	9,66%
IMA-Geral ex-C	0,83%	0,00%	5,22%	9,73%	9,73%
IMA-S	1,11%	1,01%	6,71%	12,74%	12,74%
INPC	0,69%	0,38%	0,30%	5,93%	5,93%
IPCA	0,62%	0,41%	0,28%	5,79%	5,79%
IRF-M	1,48%	-0,66%	6,49%	8,82%	8,82%
IRF-M 1	1,18%	0,94%	6,70%	12,02%	12,02%
IRF-M 1+	1,62%	-1,42%	6,63%	7,41%	7,41%
Selic	1,12%	1,02%	7,70%	12,39%	13,26%
Meta Atuarial	1,02%	0,81%	2,71%	10,98%	10,98%

SÃO PAULO/SP, 19/01/2023

Thiago Matheus da Costa

THIAGO MATHEUS DA COSTA

Sócio Proprietário

Certificação CEA pela ANBIMA

Consultor de Valores Mobiliários

Atuário MIBA 2178

Certificação
de Especialista
em Investimentos
ANBIMA
CEA

