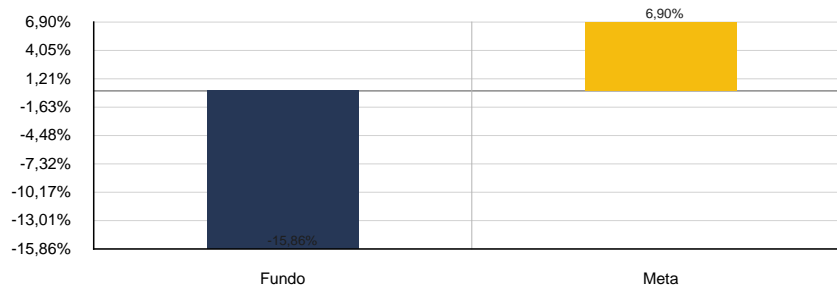
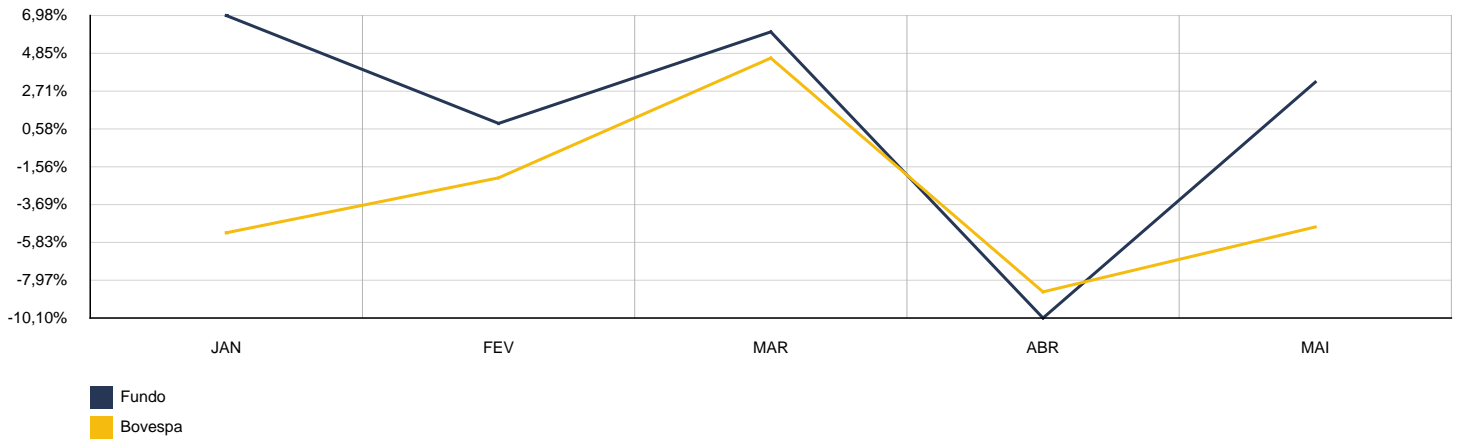


2022	ITAU PV MULTIM. SP500 BRL FICFI					CNPJ: 26.269.692/0001-61	
MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.	META (%)
Janeiro	1.477.538,14	0,00	0,00	1.399.424,05	-78.114,09	-5,29%	0,94%
Fevereiro	1.399.424,05	0,00	399.424,05	969.440,78	-30.559,22	-2,18%	1,41%
Março	969.440,78	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%

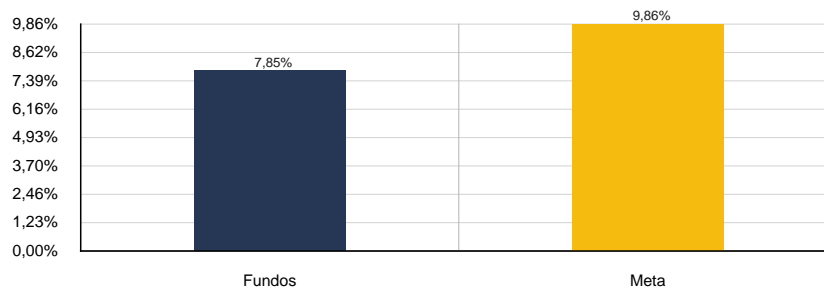
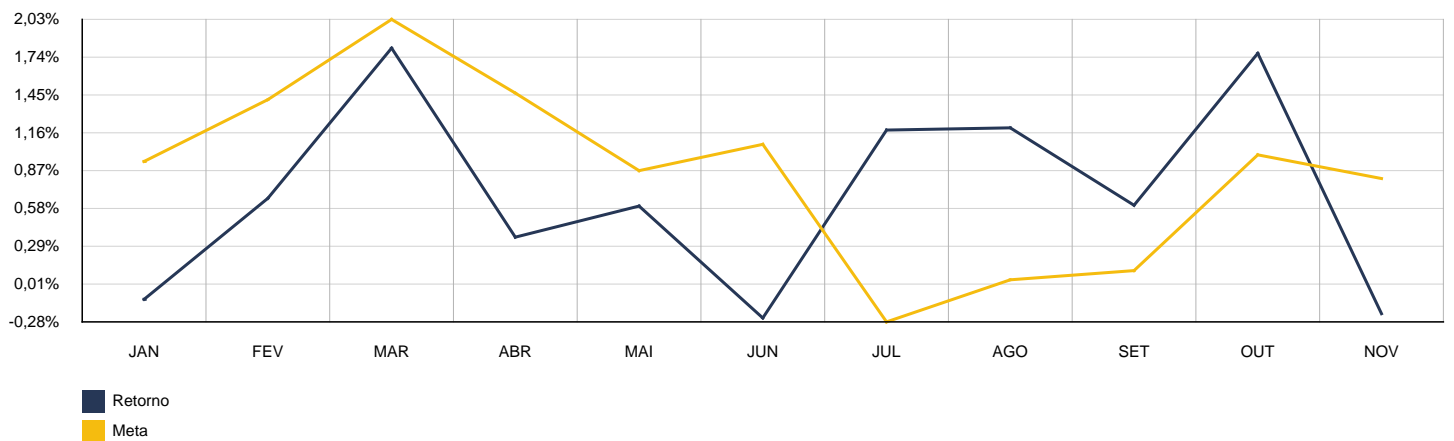
ITAU PV MULTIM. SP500 BRL FICFI



4. CONSOLIDADO

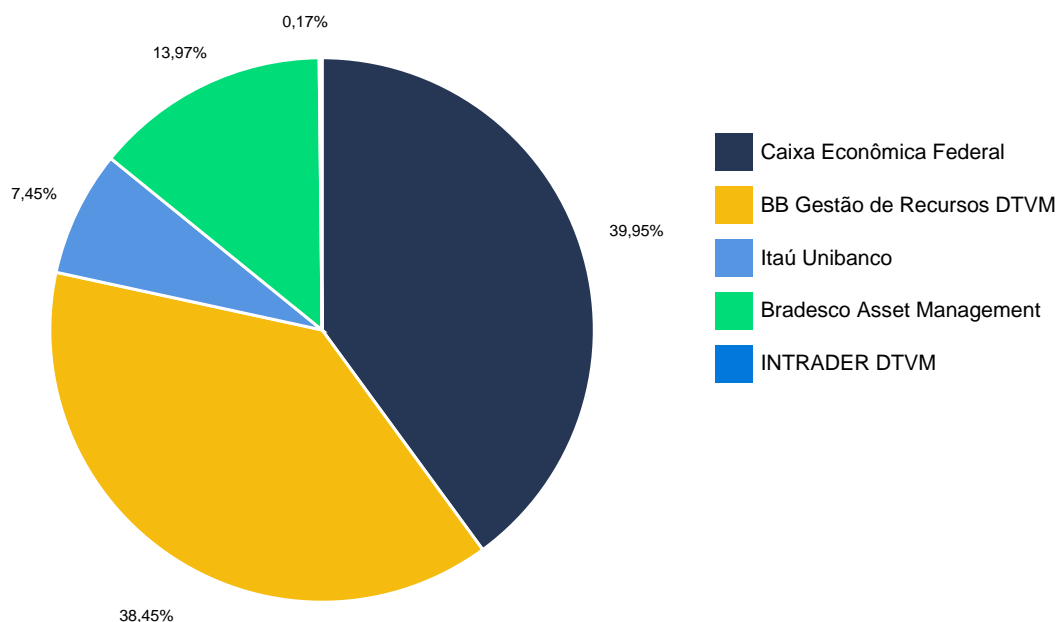
Como pode ser observado pela tabela abaixo a rentabilidade no acumulado do ano ficou em 7,85% enquanto que a meta atuarial acumulada foi de 9,86%, ou seja, o Instituto atingiu 79,64% da meta atuarial.

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%
Acumulado no Ano					3.234.147,50	7,85%	9,86%	79,64%
Disponibilidade Financeira					R\$ 352.405,26			
Patrimônio Líquido					R\$ 45.541.762,41			



5. CONSOLIDADO POR GESTOR

GESTÃO	VALOR	% S/ CARTEIRA	% S/ PL GESTÃO
Caixa Econômica Federal	18.053.341,82	39,95%	0,04%
BB Gestão de Recursos DTVM	17.375.283,84	38,45%	0,03%
Itaú Unibanco	3.368.268,82	7,45%	0,07%
Bradesco Asset Management	6.314.672,45	13,97%	0,05%
INTRADER DTVM	77.790,22	0,17%	0,74%
Total da Carteira	45.189.357,15	100,00%	



6. RETORNO POR SEGMENTO

SEGMENTO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
Renda Fixa	39.236.254,13	0,00	98.363,62	39.250.849,80	112.959,29	0,29%
Renda Variável	3.423.787,63	0,00	0,00	3.189.376,88	-234.410,75	-6,85%
Estruturado	2.727.285,08	0,00	0,00	2.749.130,47	21.845,39	0,80%

ATIVOS RENDA FIXA	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB IRF-M 1 TP FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.154.749,23	0,00	0,00	1.165.305,60	10.556,37	0,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.414.399,54	0,00	0,00	1.428.857,15	14.457,61	1,02%
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	9.403.565,24	0,00	0,00	9.355.252,72	-48.312,52	-0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.422.139,57	0,00	98.363,62	3.348.689,64	24.913,69	0,73%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	3.412.055,02	0,00	0,00	3.399.714,80	-12.340,22	-0,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.302.206,76	0,00	0,00	1.290.696,46	-11.510,30	-0,88%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.404.288,59	0,00	0,00	1.399.793,52	-4.495,07	-0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI RENDA FIXA	5.955.594,99	0,00	0,00	6.010.484,76	54.889,77	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RENDA FIXA LP	1.517.535,89	0,00	0,00	1.508.136,48	-9.399,41	-0,62%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	9.043.276,54	0,00	0,00	9.134.927,06	91.650,52	1,01%
FI RECUPERACAO BRASIL RF LONGO PRAZO	80.649,19	0,00	0,00	77.790,22	-2.858,97	-3,54%
ITAU INST. GLOBAL DINAMICO RF LP FIC	1.125.793,57	0,00	0,00	1.131.201,39	5.407,82	0,48%

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

BB AÇÕES AGRO FIC FI	1.005.013,46	0,00	0,00	952.309,45	-52.704,01	-5,24%
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	967.754,23	0,00	0,00	956.825,78	-10.928,45	-1,13%
ITAÚ AÇÕES MOMENTO 30 II FIC FI	1.451.019,94	0,00	0,00	1.280.241,65	-170.778,29	-11,77%

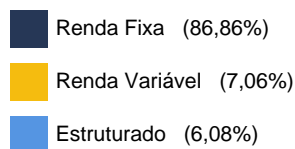
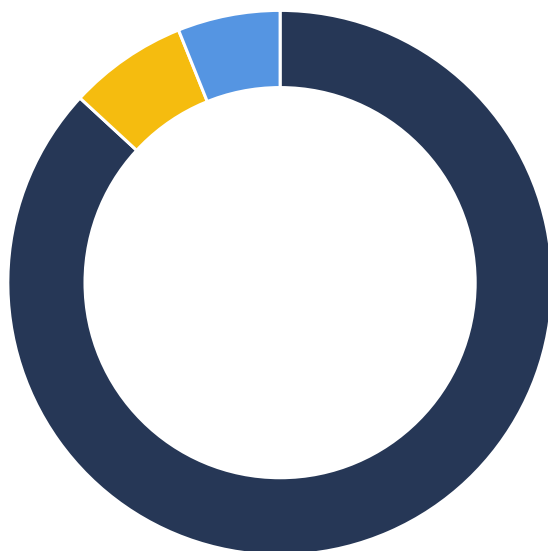
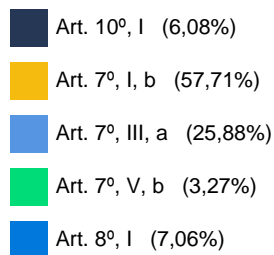
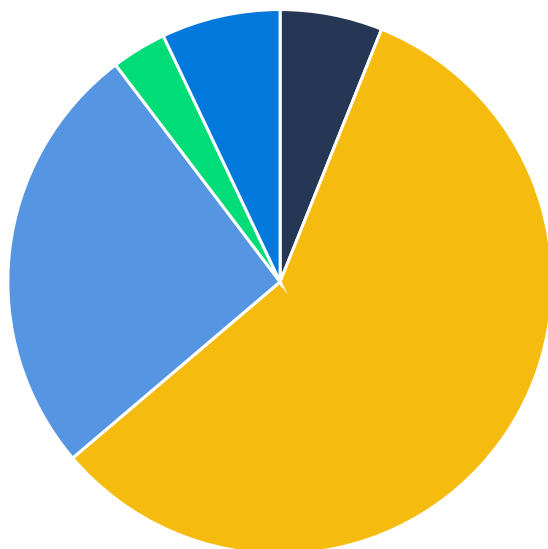
ATIVOS ESTRUTURADO	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO	RENTAB.
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.119.972,62	0,00	0,00	1.124.869,28	4.896,66	0,44%
BRADESCO FC DE FI MULTIMERCADO MACRO INST	1.607.312,46	0,00	0,00	1.624.261,19	16.948,73	1,05%

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.

ALOCÇÃO ESTRATÉGICA PARA O EXERCÍCIO DE 2022					
SEGMENTO	ATIVO	Alocação dos Recursos			
		Limite da Resolução	Limite Inferior %	%	Limite Superior %
RENDA FIXA	Títulos TN SELIC - Art.7º, I, "a"	100%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI 100% Títulos TN - Art. 7º, I, "b"		0,00%	57,71%	100,00%
	FI Ref em Índices de RF 100 TP - Art.7º, I, "c"		0,00%	0,00%	0,00%
	Oper. Compromissadas em TP TN - Art. 7º, II	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI referenciados RF - Art. 7º, III, "a"	60%	0,00%	25,88%	60,00%
	FI de Índices Referenciado RF - Art. 7º, III, "b"		0,00%	0,00%	0,00%
	Renda Fixa de emissão Bancária - Art. 7º, IV	20%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI em Direito Creditório - Sênior - Art. 7º, V, "a"	5%	0,00%	0,00%	0,00%
	FI Renda Fixa "Credito Privado" - Art. 7º, V, "b"		0,00%	3,27%	5,00%
FI de Debêntures de infraestrutura - Art. 7º, V, "c"	0,00%		0,00%	0,00%	
Renda Variável e Investimentos Estruturados					
FI de Ações - Art. 8, I	30%	0,00%	R\$ 3.189.376,88	7,06%	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\$ 2.749.130,47	6,08%	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\$ 45.189.357,15	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%	0,11	0,00
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,02	0,00%	0,12	0,02
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP XXI FI	0,00	0,00%	0,10	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	0,02	0,00%	0,12	0,02
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	0,01%	0,11	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%	0,11	0,00
CAIXA BRASIL IRF-M TP FI RENDA FIXA LP	0,00	0,01%	0,11	0,00
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RF	0,02	0,00%	0,12	0,02
FI RECUPERACAO BRASIL RF LONGO PRAZO	0,00	0,01%	0,09	0,00
ITAÚ AÇÕES DIVIDENDOS FI	0,00	0,04%	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	-3,06%	5,45%	1,02%	7,31%	10,37%
CDI	1,02%	1,02%	7,60%	11,14%	12,65%
IMA-B	-0,79%	1,23%	1,77%	6,58%	6,82%
IMA-B 5	-0,33%	1,91%	2,36%	8,76%	9,62%
IMA-B 5+	-1,18%	0,65%	1,33%	4,54%	4,19%
IMA-Geral	-0,06%	1,01%	4,60%	8,82%	9,76%
IMA-Geral ex-C	0,00%	1,09%	4,80%	8,83%	9,85%
IMA-S	1,01%	1,08%	6,67%	11,51%	12,38%
INPC	0,38%	0,47%	0,23%	5,21%	5,97%
IPCA	0,41%	0,59%	0,33%	5,13%	5,90%
IRF-M	-0,66%	0,93%	5,33%	7,24%	9,26%
IRF-M 1	0,94%	1,00%	6,43%	10,71%	11,68%
IRF-M 1+	-1,42%	0,92%	5,02%	5,70%	8,12%
Selic	1,02%	1,02%	7,60%	11,14%	12,65%
Meta Atuarial	0,81%	0,99%	2,77%	9,86%	11,10%

SÃO PAULO/SP, 20/01/2023

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



CVM
Comissão de Valores Mobiliários