

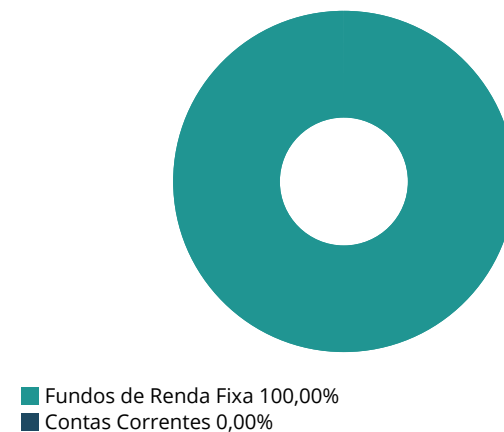
RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS 2023



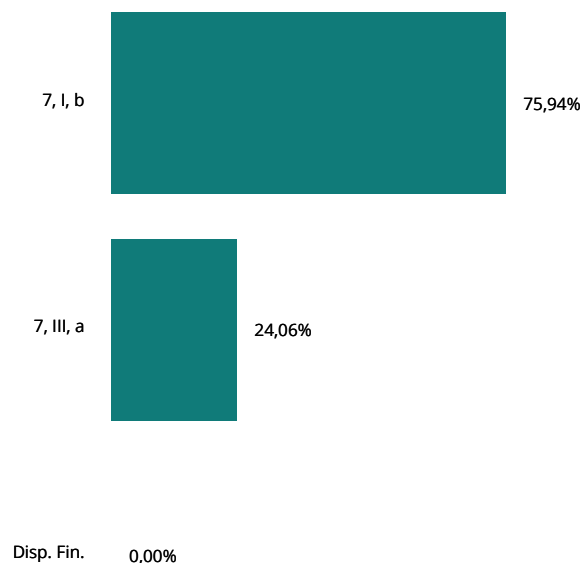
Distribuição da Carteira _____	3
Retorno da Carteira por Ativo _____	4
Rentabilidade da Carteira (em %) _____	8
Rentabilidade e Risco dos Ativos _____	9
Análise do Risco da Carteira _____	11
Liquidez e Custos das Aplicações _____	13
Movimentações _____	14
Enquadramento da Carteira _____	26
Comentários do Ano _____	29

ATIVOS	%	FECHAMENTO 2023
FUNDOS DE RENDA FIXA	100,0%	198.641.530,00
Banrisul Absoluto	5,7%	11.258.192,89 ▼
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	5,6%	11.084.939,32
Banrisul RPPS 2024	4,0%	8.013.478,37
Banrisul RPPS II 2027	2,9%	5.714.400,00
Banrisul RPPS III 2030	2,6%	5.106.820,32
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	2,8%	5.545.409,99
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	10,1%	20.122.126,06
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	2,5%	4.884.070,10
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	12,0%	23.762.587,37
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	9,3%	18.483.253,55
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	3,0%	6.014.939,16
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	0,3%	668.539,23
BB Previdenciário Títulos Públicos X	0,7%	1.384.181,82
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	0,8%	1.547.558,46
Caixa Brasil Referenciado	10,6%	21.148.596,43 ▼
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	9,8%	19.449.641,92
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	5,0%	10.016.650,96
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	7,7%	15.376.845,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	0,7%	1.459.786,43
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	2,5%	4.915.738,40
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	0,2%	420.874,16 ▲
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	0,6%	1.211.272,80
Sicredi Liquidez Empresarial Referenciado Renda Fixa	0,5%	1.051.627,26
CONTAS CORRENTES	0,0%	753,11
Banco do Brasil	0,0%	-
Banrisul	0,0%	753,11
Caixa Econômica Federal	0,0%	-
Itaú Unibanco	0,0%	-
Sicredi	0,0%	-
TOTAL DA CARTEIRA	100,0%	198.642.283,11

POR SEGMENTO



POR TIPO DE ATIVO



RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO (EM REAIS)

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO
FUNDOS DE RENDA FIXA	924.327,68	1.522.901,42	2.709.122,56	2.087.092,63	3.141.441,30	3.467.758,28
Banrisul Absoluto	110.336,96	96.820,98	118.958,40	91.142,73	121.743,82	116.767,22
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	(5.772,94)	154.295,41	324.177,80	251.700,94	325.752,25	314.468,78
Banrisul RPPS 2024	99.965,88	98.359,18	94.307,45	38.142,12	(558,86)	70.136,81
Banrisul RPPS II 2027	59.750,00	86.950,00	111.150,00	70.400,00	82.800,00	51.600,00
Banrisul RPPS III 2030	(6.671,07)	9.515,62	64.022,23	67.509,42	137.134,85	108.088,11
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	31.234,41	47.410,20	91.969,08	63.439,52	95.278,43	92.949,76
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	164.589,23	139.899,53	212.761,82	187.988,70	261.430,69	253.285,77
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	47.867,97	223.556,63	471.392,87	378.131,96	637.756,32	503.745,50
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	-	-	-	-	190.754,15	560.687,76
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA	109.179,57	67.556,34	88.249,79	71.687,95	48.507,12	-
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	8.815,45	8.601,32	8.080,23	3.300,20	(34,42)	6.011,84
BB Previdenciário Títulos Públicos X	18.262,27	17.825,18	16.731,16	6.811,86	(124,66)	12.443,40
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	41,69	10.050,40	18.728,49	7.636,90	(134,57)	13.936,65
Caixa Brasil Referenciado	214.298,07	167.685,53	255.299,69	219.165,65	293.939,83	282.557,92
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	43.017,85	202.687,08	441.439,00	326.719,14	521.930,88	412.404,31
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	-	-	-	-	29.045,58	282.243,14
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	(4.360,10)	166.821,29	355.934,31	277.881,91	356.556,24	339.486,87
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	-	-	-	-	3.912,55	13.859,94
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	12.742,18	7.118,25	10.484,19	7.763,39	7.820,49	7.601,88
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	10.637,58	9.013,19	14.529,80	9.223,59	16.733,35	14.749,45
Sicredi Liquidez Empresarial Referenciado Renda Fixa	10.392,68	8.735,29	10.906,25	8.446,65	11.197,26	10.733,17
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	770.561,47	(859.982,33)	(62.896,71)	304.753,16	115.223,50	
BB FIA Bolsa Americana	314.292,91	(92.586,81)	197.397,82	67.564,80	28.848,98	-
BB FIA Governança	31.192,85	-	-	-	-	-
BB FIC FIA Alocação	61.771,55	(123.036,90)	(57.307,63)	68.247,66	-	-
BB FIC FIA Seleção Fatorial	131.528,89	(262.154,68)	(104.543,06)	107.816,73	-	-
BB FIC FIA Setor Financeiro	13.974,14	-	-	-	-	-
BB FIC FIA Valor	49.649,82	(78.170,25)	-	-	-	-
Caixa FIA Brasil IBX-50	20.983,57	-	-	-	-	-
Caixa FIA Dividendos	11.531,68	-	-	-	-	-
Caixa FIA ETF Ibovespa	75.801,85	(181.714,73)	(64.823,18)	61.123,97	86.374,52	-
Caixa FIC FIA Multigestor	59.834,21	(122.318,96)	(33.620,66)	-	-	-

RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO (EM REAIS)

ATIVOS	JANEIRO	FEVEREIRO	MARÇO	ABRIL	MAIO	JUNHO
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	357.725,08	88.656,70	217.132,25	(78.185,75)	90.797,84	-
BB FIA Ações Alocação ETF IE	2.232,47	24.259,83	(59.019,13)	(19.618,43)	(912,67)	-
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	355.492,61	64.396,87	276.151,38	(58.567,32)	91.710,51	-
FUNDOS MULTIMERCADO	87.564,64	(1.530,07)	55.323,49	5.344,82	-	-
BB FIC Macro Multimercado	25.904,38	7.686,77	12.257,73	-	-	-
BB Previdenciário Multimercado Alocação	28.247,70	18.190,23	18.874,02	-	-	-
Caixa FIC Estratégia Livre Multimercado	33.412,56	(27.407,07)	24.191,74	5.344,82	-	-
TOTAL	2.140.178,87	750.045,72	2.918.681,59	2.319.004,86	3.347.462,64	3.467.758,28

RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO (R\$)

ATIVOS	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
FUNDOS DE RENDA FIXA	1.607.772,25	295.614,07	(794.556,65)	(304.967,17)	3.741.213,53	3.790.734,23	22.188.454,13
Banrisul Absoluto	112.730,47	124.719,99	107.643,89	105.225,92	99.662,21	100.901,35	1.306.653,94
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	103.650,77	(61.725,06)	(146.256,48)	(101.020,54)	279.677,83	298.809,52	1.737.758,28
Banrisul RPPS 2024	80.266,10	69.368,37	85.086,28	34.160,25	61.893,63	73.140,66	804.267,87
Banrisul RPPS II 2027	44.900,00	22.150,00	(22.300,00)	(58.600,00)	140.250,00	94.750,00	683.800,00
Banrisul RPPS III 2030	36.104,80	(12.824,38)	(61.587,88)	(41.293,38)	130.747,70	115.339,72	546.085,74
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	41.255,35	54.926,80	46.913,03	45.842,78	59.410,24	52.090,62	722.720,22
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	242.889,78	231.271,06	198.770,88	203.356,27	178.160,55	179.914,52	2.454.318,80
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	-	-	-	15.212,52	(66.530,99)	(64.611,43)	(115.929,90)
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	168.445,50	(59.753,73)	(281.520,28)	(192.224,70)	611.685,66	537.535,50	3.046.619,20
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	64.581,46	(123.517,91)	(290.738,83)	(142.638,96)	481.382,41	573.359,91	1.313.869,99
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	30.906,64	(82.713,37)	(112.778,34)	(55.870,17)	189.058,67	227.534,65	196.138,08
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA	-	-	-	-	-	-	385.180,77
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	6.889,71	5.887,86	7.086,36	2.845,86	5.152,09	6.095,36	68.731,86
BB Previdenciário Títulos Públicos X	14.260,35	12.181,02	14.671,46	5.865,41	10.656,68	12.615,22	142.199,35
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	15.972,65	13.657,80	16.457,12	6.604,73	11.966,72	14.155,72	129.074,30
Caixa Brasil Referenciado	281.492,73	263.343,58	222.161,46	226.051,04	206.169,00	196.188,76	2.828.353,26
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	137.580,59	(48.254,96)	(228.815,90)	(155.795,25)	499.584,99	439.300,28	2.591.798,01
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	36.967,12	(31.844,88)	(142.551,54)	(77.484,81)	254.645,32	292.078,65	643.098,58
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	118.337,87	(55.183,37)	(141.911,26)	(97.581,83)	380.497,32	408.135,31	2.104.614,56
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	13.275,77	8.409,31	1.585,57	(4.562,93)	25.267,09	20.701,69	82.448,99
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	26.307,29	(62.349,70)	(87.575,06)	(44.447,24)	154.171,53	185.967,78	172.074,60
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	9.101,15	8.636,81	6.165,81	3.280,04	4.046,02	3.824,27	88.584,48
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	11.361,00	7.608,91	4.891,60	8.247,30	14.408,56	13.523,60	134.927,93
Sicredi Liquidez Empresarial Referenciado Renda Fixa	10.495,15	11.619,92	10.045,46	9.860,52	9.250,30	9.382,57	121.065,22
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	-	-	-	-	-	-	267.659,09
BB FIA Bolsa Americana	-	-	-	-	-	-	515.517,70
BB FIA Governança	-	-	-	-	-	-	31.192,85
BB FIC FIA Alocação	-	-	-	-	-	-	(50.325,32)
BB FIC FIA Seleção Fatorial	-	-	-	-	-	-	(127.352,12)
BB FIC FIA Setor Financeiro	-	-	-	-	-	-	13.974,14
BB FIC FIA Valor	-	-	-	-	-	-	(28.520,43)
Caixa FIA Brasil IBX-50	-	-	-	-	-	-	20.983,57
Caixa FIA Dividendos	-	-	-	-	-	-	11.531,68
Caixa FIA ETF Ibovespa	-	-	-	-	-	-	(23.237,57)
Caixa FIC FIA Multigestor	-	-	-	-	-	-	(96.105,41)

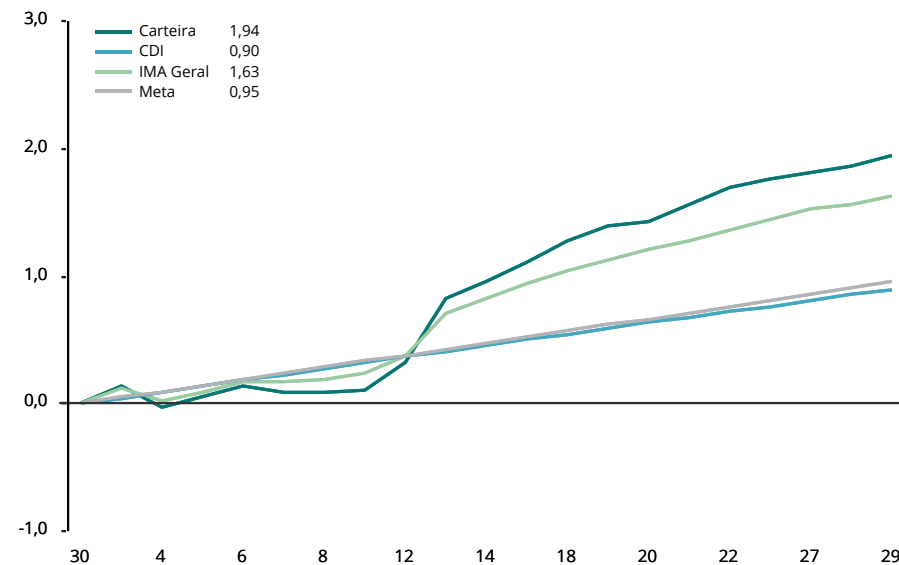
RETORNO DA CARTEIRA POR ATIVO (R\$)

ATIVOS	JULHO	AGOSTO	SETEMBRO	OUTUBRO	NOVEMBRO	DEZEMBRO	2023
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	-	-	-	-	-	-	676.126,12
BB FIA Ações Alocação ETF IE	-	-	-	-	-	-	(53.057,93)
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	-	-	-	-	-	-	729.184,05
FUNDOS MULTIMERCADO	-	-	-	-	-	-	146.702,88
BB FIC Macro Multimercado	-	-	-	-	-	-	45.848,88
BB Previdenciário Multimercado Alocação	-	-	-	-	-	-	65.311,95
Caixa FIC Estratégia Livre Multimercado	-	-	-	-	-	-	35.542,05
TOTAL	1.607.772,25	295.614,07	(794.556,65)	(304.967,17)	3.741.213,53	3.790.734,23	23.278.942,22

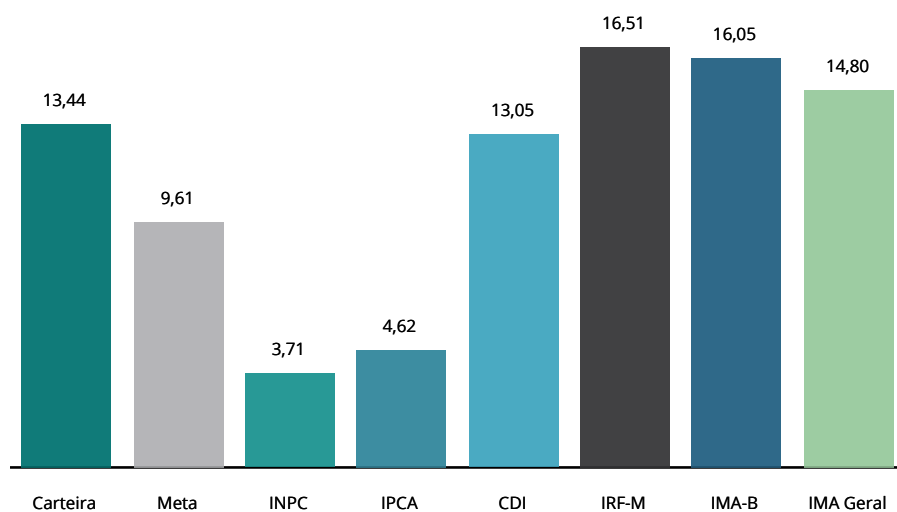
RENTABILIDADE DA CARTEIRA, INDICADORES E META ATUARIAL (IPCA + 4,77% A.A.)

MÊS	CARTEIRA	META	CDI	IMA-G	% META	% CDI	% IMA-G
Janeiro	1,28	0,92	1,12	0,70	139	114	183
Fevereiro	0,44	1,23	0,92	1,03	36	48	43
Março	1,67	1,10	1,17	1,86	152	142	90
Abril	1,30	1,00	0,92	1,25	130	141	104
Maió	1,84	0,62	1,12	1,77	297	164	104
Junho	1,85	0,31	1,07	1,74	600	173	107
Julho	0,84	0,51	1,07	0,98	165	78	86
Agosto	0,16	0,62	1,14	0,63	25	14	25
Setembro	(0,40)	0,65	0,97	0,18	-62	-41	-224
Outubro	(0,16)	0,63	1,00	0,30	-25	-16	-53
Novembro	1,95	0,67	0,92	1,84	291	212	106
Dezembro	1,94	0,95	0,90	1,63	204	217	119
TOTAL	13,44	9,61	13,05	14,80	140	103	91

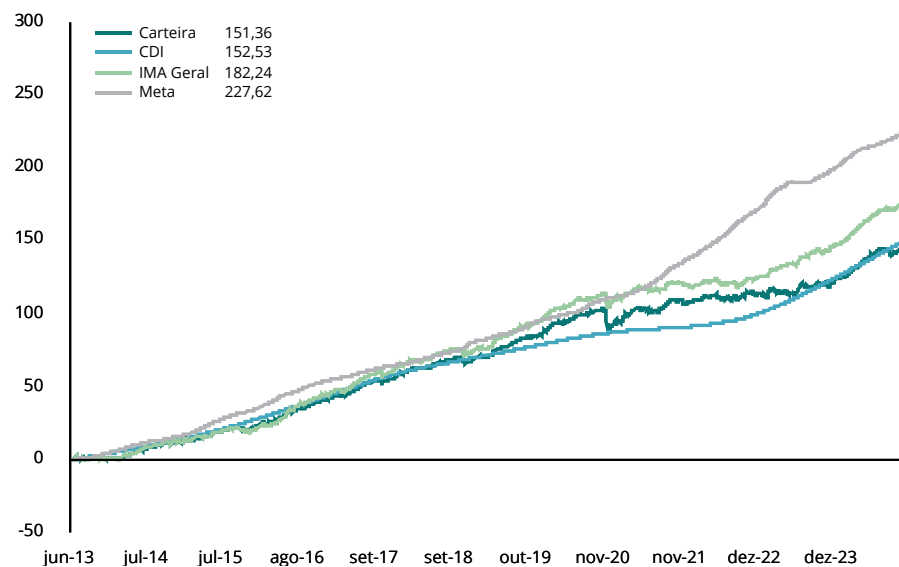
RENTABILIDADE ACUMULADA EM DEZEMBRO DE 2023



CARTEIRA x INDICADORES EM 2023



RENTABILIDADE ACUMULADA DESDE JUNHO/2013



RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO ANO	
FUNDOS DE RENDA FIXA	BENCH	RENT. %	% META
Banrisul Absoluto	CDI	13,00	135%
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	IMA-B	15,57	162%
Banrisul RPPS 2024	IPCA	11,16	116%
Banrisul RPPS II 2027	IPCA	13,59	141%
Banrisul RPPS III 2030	IPCA	-	-
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	IMA Geral	14,99	156%
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	CDI	12,98	135%
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	CDI	8,93	93%
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	IPCA	15,54	162%
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	IPCA	-	-
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	18,87	196%
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	IPCA	11,14	116%
BB Previdenciário Títulos Públicos X	IPCA	11,13	116%
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	IPCA	11,17	116%
Caixa Brasil Referenciado	CDI	13,32	139%
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	IPCA	15,60	162%
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	IPCA	6,43	67%
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	IMA-B	15,86	165%
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	IMA-B 5	11,96	124%
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	IMA-B 5+	18,90	197%
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	CDI	11,58	121%
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	CDI	12,69	132%
Sicredi Liquidez Empresarial Referenciado Renda Fixa	CDI	13,01	135%
INDICADORES		RENT. %	% META
Carteira		13,44	140%
IPCA		4,62	48%
INPC		3,71	39%
CDI		13,05	136%
IRF-M		16,51	172%
IRF-M 1		13,25	138%

VOL. ANUALIZADA	VAR (95%)	SHARPE	DRAW DOWN
12M %	12M %	12M %	12M %
0,06	0,09	-15,78	0,00
4,56	7,50	3,10	-3,79
1,38	2,27	-8,23	-0,42
3,25	5,35	0,85	-2,19
-	-	-	-
1,58	2,59	6,52	-0,65
0,08	0,14	-12,45	-0,02
2,56	4,21	-9,40	-2,89
4,76	7,83	2,93	-3,69
-	-	-	-
6,98	11,48	4,72	-6,19
1,37	2,25	-8,36	-0,42
1,37	2,26	-8,38	-0,42
1,38	2,27	-8,18	-0,42
0,07	0,11	13,29	0,00
6,20	10,20	-3,42	-6,05
-	-	-	-
4,46	7,33	3,51	-3,55
1,96	3,22	-3,40	-0,92
6,91	11,37	4,78	-6,01
0,03	0,05	-312,44	0,00
0,83	1,37	-3,20	-0,30
0,05	0,09	-15,97	0,00
12M %	12M %	12M %	12M %
2,77	4,56	0,88	-1,86
-	-	-	-
-	-	-	-
0,03	-	-	-
2,62	4,32	7,58	-0,92
0,35	0,58	3,29	-0,04

RENTABILIDADE POR INVESTIMENTO		NO ANO	
INDICADORES	RENT. %	% META	
IRF-M 1+	18,52	193%	
IMA-B	16,05	167%	
IMA-B 5	12,13	126%	
IMA-B 5+	19,28	201%	
IMA Geral	14,80	154%	
IDkA 2A	12,13	126%	
IDkA 20A	27,13	282%	
IGCT	22,24	231%	
IBrX 50	20,06	209%	
Ibovespa	22,28	232%	
META ATUARIAL - IPCA + 4,77% A.A.	9,61		

São apresentadas apenas as informações dos fundos que possuem histórico completo no período.

VOL. ANUALIZADA	VAR (95%)	SHARPE	DRAW DOWN
12M %	12M %	12M %	12M %
3,88	6,39	8,04	-1,55
4,45	7,32	3,89	-3,56
1,96	3,22	-2,53	-0,91
6,97	11,48	5,09	-6,14
1,96	3,22	5,12	-0,67
2,11	3,47	-2,18	-0,99
12,51	20,58	6,43	-11,12
17,09	28,13	3,21	-14,72
17,09	28,12	2,54	-14,93
17,08	28,11	3,24	-14,30

NOTAS METODOLÓGICAS E EXPLICATIVAS

Introdução

O risco está associado ao grau de incerteza sobre um investimento no futuro, havendo diversas formas de mensurá-lo. A tabela "Medidas de Risco da Carteira" traz algumas das métricas mais tradicionais de análise de risco, que serão brevemente explicadas a seguir.

Volatilidade Anualizada

Volatilidade é o nome que se dá ao Desvio Padrão dos retornos de um ativo. Dessa forma, a Volatilidade mede o quanto os retornos diários se afastam do retorno médio do período analisado. Assim sendo, uma Volatilidade alta representa maior risco, visto que os preços do ativo tendem a se afastar mais de seu valor médio.

Estima-se que os retornos diários da Carteira, em média, se afastam em 2,7689% do retorno diário médio dos últimos 12 meses. Como base para comparação, o IRF-M, que tende a ser menos volátil, apresentou um coeficiente de 2,62% no mesmo período. Já o IMA-B, que habitualmente manifesta alta volatilidade, ficou com 4,45% em 12 meses.

Value at Risk - VaR (95%)

Sintetiza a maior perda esperada para a Carteira no intervalo de um dia. Seu cálculo baseia-se na média e no desvio padrão dos retornos diários da Carteira, e supõe que estes seguem uma distribuição normal.

Dado o desempenho da Carteira nos últimos 12 meses, estima-se com 95% de confiança que, se houver uma perda de um dia para o outro, o prejuízo máximo será de 4,5559%. No mesmo período, o IRF-M detém um VaR de 4,32%, e o IMA-B de 7,32%.

Draw-Down

Auxilia a determinar o risco de um investimento ao medir seu declínio desde o valor máximo alcançado pelo ativo, até o valor mínimo atingido em determinado período de tempo. Para determinar o percentual de queda, o Draw-Down é medido desde que a desvalorização começa até se atingir um novo ponto de máximo, garantindo, dessa forma, que a mínima da série representa a maior queda ocorrida no período.

Quanto mais negativo o número, maior a perda ocorrida e, consequentemente, maior o risco do ativo. Já um Draw-Down igual a zero, indica que não houve desvalorização do ativo ao longo do período avaliado.

Analisando os últimos 12 meses, percebe-se que a maior queda ocorrida na Carteira foi de 1,8577%. Já os índices IRF-M e IMA-B sofreram quedas de 0,92% e 3,56%, respectivamente.

Beta

Avalia a sensibilidade da Carteira em relação ao risco do mercado como um todo, representado pelo Índice Ibovespa. Dessa forma, assume-se que o Ibovespa possui um Beta igual a 100%. Calculando o Beta da Carteira, tem-se uma estimativa da sua exposição ao total desse risco.

Ou seja, nos últimos 12 meses, estima-se que a carteira está exposta a 9,4620% do risco experimentado pelo mercado.

Tracking Error

Mensura o quão aderente a Carteira é ao seu Benchmark, nesse caso, representado pela Meta do Instituto. Vistos os retornos dos últimos 12 meses, pode-se afirmar que há 66% de chance de que o retorno diário da Carteira fique entre 0,1745% e -0,1745% da Meta.

Sharpe

Quantifica a relação entre a Volatilidade da Carteira e seu retorno excedente a um ativo livre de risco, nesse caso, o CDI. Assim, esse indicador aponta o percentual de rentabilidade que a Carteira teve acima do CDI devido à sua maior exposição ao risco. Logo, quanto maior o Sharpe, melhor o desempenho da Carteira, enquanto valores negativos significam que o CDI superou a rentabilidade da Carteira no período.

Em 12 meses, o indicador apontou que para cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs, houve um prêmio de 0,8812% de rentabilidade acima daquela alcançada pelo CDI.

Treynor

Similar ao Sharpe, porém, utiliza o risco do mercado (Beta) no cálculo em vez da Volatilidade da Carteira. Valores negativos indicam que a Carteira teve rentabilidade menor do que a alcançada pelo mercado.

Em 12 meses, cada 100 pontos de risco a que a Carteira se expôs foram convertidos em um prêmio de 0,0162% de rentabilidade acima do retorno do mercado.

Alfa de Jensen

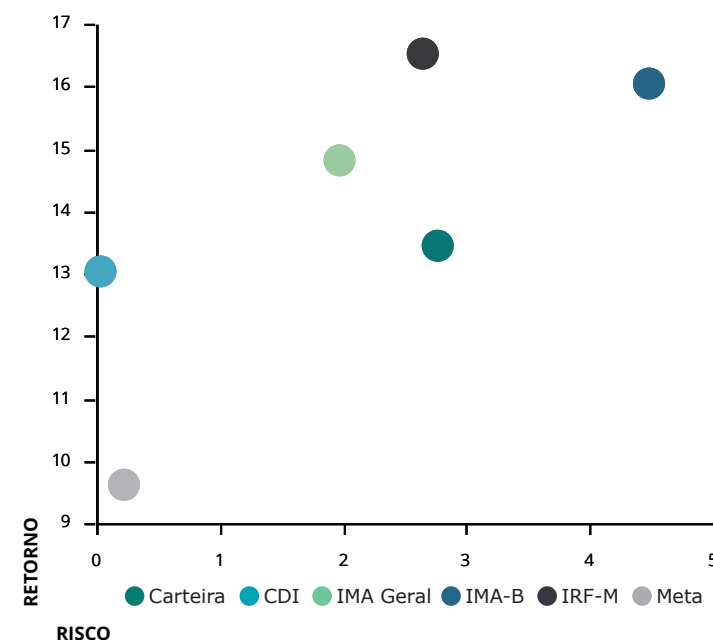
É uma medida do desempenho da Carteira, indicando uma boa performance caso o coeficiente seja significativamente positivo. Valores próximos de zero (tanto positivos quanto negativos) são neutros, devendo ser desconsiderados. Um coeficiente significativamente negativo aponta que o risco da Carteira não tem se convertido em maiores retornos.

MEDIDAS DE RISCO E DESEMPENHO DA CARTEIRA (%)

MEDIDA	NO MÊS	3 MESES	12 MESES
Volatilidade Anualizada	1,9658	3,1641	2,7689
VaR (95%)	3,2353	5,2063	4,5559
Draw-Down	-0,1711	-1,8577	-1,8577
Beta	9,8621	14,4633	9,4620
Tracking Error	0,1238	0,1983	0,1745
Sharpe	41,7379	7,5019	0,8812
Treynor	0,5241	0,1034	0,0162
Alfa de Jensen	0,0299	-0,0124	-0,0020

RELAÇÃO RISCO X RETORNO EM 12 MESES (%)

Em geral, há uma forte relação entre o risco e o retorno de um ativo: quanto maior o risco, maior a probabilidade de um retorno (ou perda) mais elevado. O gráfico representa as métricas dessa correlação para a Carteira e para os principais índices. Pontos mais acima no gráfico representam um retorno mais elevado, enquanto pontos mais à direita indicam maior risco.



METODOLOGIA DO STRESS TEST

O Stress Test é comumente utilizado para mensurar como situações de estresse no mercado podem vir a impactar uma Carteira de Investimentos. Por se tratar de uma medida de risco não estatística, esse teste é indicado como um complemento às métricas de risco mais usuais, como Volatilidade e VaR, por exemplo.

Em geral, o teste é formulado em duas etapas. A primeira consiste na elaboração de um cenário de estresse em que são aplicados choques exógenos aos fatores de risco que influenciam a Carteira. Na segunda etapa, analisa-se o impacto do cenário de estresse sobre os investimentos, como é apresentado na tabela "Stress Test" ao lado.

Contabilizamos os retornos mensais, dos últimos 24 meses, de todos os ativos presentes na Carteira. Dadas essas estatísticas, selecionamos a pior rentabilidade de cada ativo e, então, construímos um cenário hipotético no qual todos os ativos entregariam, juntos, as suas respectivas piores rentabilidades experimentadas ao longo do período.

Visando uma apresentação mais concisa, agrupamos os resultados por fatores de risco, que são os índices aos quais os ativos estão vinculados. A coluna Exposição denota o percentual do Patrimônio da Carteira que está atrelado a cada um desses fatores.

As duas colunas mais à direita mostram o impacto do cenário de estresse, em reais e em percentual do patrimônio, estimados para um intervalo de um mês a partir do período atual. Valores positivos indicam que, mesmo frente ao cenário projetado, os ativos atrelados ao respectivo fator de risco incorreriam em ganhos ao Instituto.

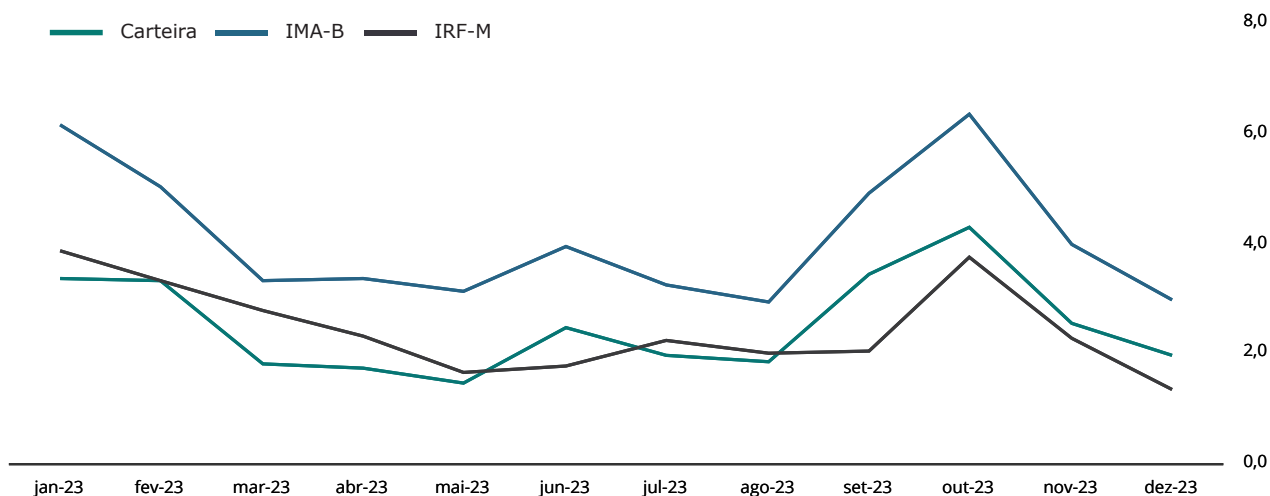
No mês atual, a maior exposição da Carteira é em IMA-B, com 66,95% de participação. Dado o cenário de estresse, haveria uma perda de R\$1.626.554,30 nos ativos atrelados a este índice.

No cenário como um todo, o Instituto perderia R\$1.287.061,66, equivalente a uma queda de 0,65% no patrimônio investido.

Já o gráfico abaixo ilustra a trajetória da Volatilidade Mensal Anualizada da Carteira, em comparação com dois índices do mercado: o IRF-M, mais conservador, e o IMA-B, que apresenta volatilidade mais elevada.

Devido à relação intrínseca entre o risco e o retorno dos ativos, ao mesmo tempo que estar exposto a uma maior volatilidade traz a possibilidade de retornos mais elevados, aumenta-se também a exposição ao risco. Daí a importância de se manter uma Carteira diversificada, conforme a conjuntura do mercado.

VOLATILIDADE MENSAL ANUALIZADA (%)



STRESS TEST (24 MESES)

FATORES DE RISCO	EXPOSIÇÃO	RESULTADOS DO CENÁRIO	
IRF-M	0,00%	0,00	0,00%
IRF-M	0,00%	0,00	0,00%
IRF-M 1	0,00%	0,00	0,00%
IRF-M 1+	0,00%	0,00	0,00%
Carência Pré	0,00%	0,00	0,00%
IMA-B	66,95%	-1.626.554,30	-0,82%
IMA-B	13,32%	-265.043,55	-0,13%
IMA-B 5	0,73%	-5.090,67	-0,00%
IMA-B 5+	5,50%	-211.301,98	-0,11%
Carência Pós	47,40%	-1.145.118,09	-0,58%
IMA GERAL	2,79%	-6.377,22	-0,00%
IDKA	0,00%	0,00	0,00%
IDkA 2 IPCA	0,00%	0,00	0,00%
IDkA 20 IPCA	0,00%	0,00	0,00%
Outros IDkA	0,00%	0,00	0,00%
FIDC	0,00%	0,00	0,00%
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	0,00%	0,00	0,00%
FUNDOS PARTICIPAÇÕES	0,00%	0,00	0,00%
FUNDOS DI	30,25%	345.869,86	0,17%
F. Crédito Privado	0,00%	0,00	0,00%
Fundos RF e Ref. DI	30,25%	345.869,86	0,17%
Multimercado	0,00%	0,00	0,00%
OUTROS RF	0,00%	0,00	0,00%
RENDA VARIÁVEL	0,00%	0,00	0,00%
Ibov., IBrX e IBrX-50	0,00%	0,00	0,00%
Governança Corp. (IGC)	0,00%	0,00	0,00%
Dividendos	0,00%	0,00	0,00%
Small Caps	0,00%	0,00	0,00%
Setorial	0,00%	0,00	0,00%
Outros RV	0,00%	0,00	0,00%
TOTAL	100,00%	-1.287.061,66	-0,65%

FUNDO	CNPJ	INVESTIDOR	RESGATE		OUTROS DADOS		
FUNDOS DE RENDA FIXA			Conversão	Liquidez	Taxa Adm	Carência	Taxa Performance
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	16.844.890/0001-58	Geral	D+1	D+1	0,35	Não há	Não há
Banrisul RPPS 2024	46.521.007/0001-50	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2024	Não há
Banrisul RPPS II 2027	46.655.127/0001-40	Geral	D+0	D+0	0,20	15/05/2027	Não há
Banrisul RPPS III 2030	49.034.567/0001-78	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2030	Não há
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	35.292.588/0001-89	Geral	D+3	D+3	0,30	Não há	Não há
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	44.345.473/0001-04	Geral	D+1	D+1	0,90	Não há	20% exc CDI
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2030	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	Geral	D+0	D+0	0,10	15/05/2035	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	Geral	D+2	D+2	0,20	Não há	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2024	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos X	20.734.931/0001-20	Geral	D+1	D+1	0,20	15/08/2024	Não há
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	44.345.590/0001-60	Geral	D+0	D+0	0,20	15/08/2024	Não há
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	Geral	D+0	D+0	0,20	16/08/2030	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	50.569.054/0001-40	Geral	D+0	D+0	0,15	15/05/2033	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	10.740.658/0001-93	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	11.060.913/0001-10	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	Geral	D+0	D+0	0,20	Não há	Não há
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	Geral	D+0	D+0	0,80	Não há	Não há
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	Geral	D+0	D+1	0,50	Não há	20% exc CDI
Sicredi Liquidez Empresarial Referenciado Renda Fixa	24.634.187/0001-43	Geral	D+0	D+0	0,15	Não há	Não há

Considerando o patrimônio total do Instituto, seu prazo de resgate está dividido da seguinte maneira: 52,60% até 90 dias; 47,40% superior a 180 dias.

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	05/01/2023	05/01/2023	Resgate	4.192507.0-6	17.149,70
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/01/2023	05/01/2023	Resgate	2052-7	354,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/01/2023	05/01/2023	Resgate	2051-9	564,82
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	09/01/2023	09/01/2023	Aplicação	2051-9	2.116,93
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/01/2023	10/01/2023	Resgate	2052-7	3.674,95
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/01/2023	10/01/2023	Resgate	2051-9	176.046,19
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	13/01/2023	13/01/2023	Aplicação	2051-9	473.530,69
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	13/01/2023	13/01/2023	Aplicação	2052-7	46.857,13
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/01/2023	13/01/2023	Resgate	2052-7	46.857,13
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/01/2023	13/01/2023	Resgate	2051-9	473.530,69
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/01/2023	18/01/2023	Aplicação	2051-9	4.448.995,39
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	20/01/2023	20/01/2023	Resgate	2052-7	32.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/01/2023	20/01/2023	Aplicação	2052-7	689,35
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/01/2023	20/01/2023	Aplicação	2051-9	49.513,66
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	23/01/2023	23/01/2023	Aplicação	4.192507.0-6	500.000,00
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	23/01/2023	23/01/2023	Aplicação	37664-7	500.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	23/01/2023	23/01/2023	Aplicação	2051-9	26.469,31
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	23/01/2023	23/01/2023	Aplicação	2052-7	33.142,87
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	23/01/2023	23/01/2023	Aplicação	2052-7	239.854,55
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	23/01/2023	23/01/2023	Resgate	2051-9	1.300.475,37
BB FIC FIA Setor Financeiro	08.973.948/0001-35	24/01/2023	27/01/2023	Resgate	37664-7	771.839,49
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	24/01/2023	24/01/2023	Aplicação	37664-7	400.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	24/01/2023	24/01/2023	Aplicação	2051-9	400.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	24/01/2023	24/01/2023	Aplicação	2052-7	180.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/01/2023	24/01/2023	Resgate	2052-7	180.102,60
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/01/2023	24/01/2023	Resgate	2051-9	1.763.707,23
Banrisul RPPS III 2030	49.034.567/0001-78	25/01/2023	25/01/2023	Aplicação	4.192507.0-6	1.000.000,00
BB FIA Governança	10.418.335/0001-88	25/01/2023	30/01/2023	Resgate	37664-7	732.180,38
Caixa FIA Brasil IBX-50	03.737.217/0001-77	25/01/2023	30/01/2023	Rg. Total	2051-9	373.698,46
Caixa FIA Dividendos	05.900.798/0001-41	25/01/2023	30/01/2023	Rg. Total	2051-9	194.347,42
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	27/01/2023	27/01/2023	Aplicação	37664-7	752.009,93
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	27/01/2023	27/01/2023	Aplicação	37664-7	752.009,94
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/01/2023	27/01/2023	Resgate	2052-7	14.811,46
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/01/2023	27/01/2023	Resgate	2051-9	1.065.127,84
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	30/01/2023	30/01/2023	Resgate	37664-7	752.009,94
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	44.345.590/0001-60	30/01/2023	30/01/2023	Aplicação	37664-7	752.009,94

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/01/2023	30/01/2023	Aplicação	2051-9	578.651,20
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	31/01/2023	31/01/2023	Aplicação	2051-9	284.022,94
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	31/01/2023	31/01/2023	Aplicação	2051-9	284.022,94
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	31/01/2023	31/01/2023	Resgate	2051-9	284.022,94
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	31/01/2023	31/01/2023	Resgate	2051-9	283.350,71
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	03/02/2023	03/02/2023	Resgate	4.192507.0-6	16.619,29
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	03/02/2023	03/02/2023	Resgate	2051-9	564,82
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	07/02/2023	07/02/2023	Aplicação	2051-9	2.888,12
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	08/02/2023	08/02/2023	Aplicação	2051-9	2.116,93
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	09/02/2023	09/02/2023	Resgate	2051-9	181.469,99
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	09/02/2023	09/02/2023	Resgate	2052-7	2.002,01
BB Previdenciário Títulos Públicos X	20.734.931/0001-20	14/02/2023	15/02/2023	Resgate	37664-7	38.664,03
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/02/2023	14/02/2023	Aplicação	2051-9	1.334.643,81
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	15/02/2023	15/02/2023	Resgate	37664-7	480.544,31
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	15/02/2023	15/02/2023	Resgate	37664-7	18.621,36
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	44.345.590/0001-60	15/02/2023	15/02/2023	Resgate	37664-7	21.286,72
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	16/02/2023	16/02/2023	Aplicação	37664-7	559.116,42
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/02/2023	16/02/2023	Pagamento	2051-9	190.782,67
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/02/2023	16/02/2023	Pagamento	2051-9	8.722,48
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/02/2023	16/02/2023	Pagamento	2051-9	233.091,13
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/02/2023	16/02/2023	Pagamento	2051-9	20.663,32
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/02/2023	16/02/2023	Pagamento	2051-9	15.571,27
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/02/2023	16/02/2023	Pagamento	2051-9	6.559,98
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/02/2023	16/02/2023	Pagamento	2051-9	8.837,95
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	16/02/2023	16/02/2023	Aplicação	2051-9	484.228,80
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	17/02/2023	17/02/2023	Aplicação	2051-9	484.228,80
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	17/02/2023	17/02/2023	Aplicação	2052-7	120.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/02/2023	17/02/2023	Aplicação	2051-9	573.041,91
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/02/2023	17/02/2023	Resgate	2052-7	34.651,06
Banrisul RPPS III 2030	49.034.567/0001-78	23/02/2023	23/02/2023	Aplicação	4.192507.0-6	1.200.000,00
BB FIC FIA Valor	29.258.294/0001-38	23/02/2023	23/02/2023	Rg. Total	37664-7	1.459.362,98
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	23/02/2023	23/02/2023	Resgate	2051-9	1.200.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	24/02/2023	24/02/2023	Resgate	2052-7	11.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/02/2023	24/02/2023	Resgate	2051-9	1.188.051,97
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/02/2023	24/02/2023	Resgate	2052-7	9.104,33
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	27/02/2023	27/02/2023	Aplicação	37664-7	729.681,49

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	27/02/2023	27/02/2023	Resgate	2052-7	450,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/02/2023	27/02/2023	Aplicação	2051-9	64.495,14
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/02/2023	27/02/2023	Resgate	2052-7	380,66
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	44.345.590/0001-60	28/02/2023	28/02/2023	Aplicação	37664-7	729.681,49
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	01/03/2023	01/03/2023	Aplicação	2051-9	672,23
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	03/03/2023	03/03/2023	Resgate	2052-7	65,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	03/03/2023	03/03/2023	Resgate	2051-9	564,82
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	03/03/2023	03/03/2023	Resgate	2052-7	3,30
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	06/03/2023	06/03/2023	Resgate	4.192507.0-6	16.122,97
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	06/03/2023	06/03/2023	Aplicação	2051-9	1.606.328,64
Caixa FIC FIA Multigestor	30.068.224/0001-04	06/03/2023	06/03/2023	Rg. Total	2051-9	1.606.328,64
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	08/03/2023	08/03/2023	Aplicação	2051-9	803.164,32
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	08/03/2023	08/03/2023	Aplicação	2051-9	803.164,32
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	08/03/2023	08/03/2023	Resgate	2051-9	801.437,76
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	08/03/2023	08/03/2023	Resgate	2051-9	803.164,32
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	10/03/2023	10/03/2023	Resgate	2052-7	5.200,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/03/2023	10/03/2023	Resgate	2051-9	189.582,34
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/03/2023	10/03/2023	Aplicação	2052-7	3.197,99
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/03/2023	13/03/2023	Aplicação	2051-9	47.167,38
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/03/2023	13/03/2023	Aplicação	2052-7	3.012,57
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/03/2023	14/03/2023	Aplicação	2051-9	1.081.147,59
BB FIC Macro Multimercado	05.962.491/0001-75	17/03/2023	20/03/2023	Rg. Total	37664-7	2.472.911,02
BB Previdenciário Multimercado Alocação	35.292.597/0001-70	17/03/2023	24/03/2023	Rg. Total	37664-7	2.405.115,06
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	17/03/2023	17/03/2023	Aplicação	2052-7	80.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/03/2023	17/03/2023	Aplicação	2051-9	1.336.654,15
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/03/2023	17/03/2023	Aplicação	2052-7	9.927,02
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	20/03/2023	20/03/2023	Aplicação	37664-7	1.173.957,70
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	20/03/2023	20/03/2023	Aplicação	37664-7	1.173.957,70
Banrisul RPPS III 2030	49.034.567/0001-78	21/03/2023	21/03/2023	Aplicação	4.192507.0-6	1.200.000,00
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	21/03/2023	21/03/2023	Aplicação	37664-7	124.995,62
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/03/2023	21/03/2023	Resgate	2051-9	1.200.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	22/03/2023	22/03/2023	Aplicação	2051-9	65.320,67
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	24/03/2023	24/03/2023	Aplicação	37664-7	1.140.059,72
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	24/03/2023	24/03/2023	Aplicação	37664-7	1.265.055,34
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	29/03/2023	29/03/2023	Resgate	2052-7	3.100,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/03/2023	29/03/2023	Resgate	2051-9	1.137.517,06

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/03/2023	29/03/2023	Resgate	2052-7	16.122,32
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	29/03/2023	29/03/2023	Aplicação	66838-8	46.947,74
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	30/03/2023	30/03/2023	Resgate	2052-7	2.800,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/03/2023	30/03/2023	Aplicação	2051-9	2.355,52
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/03/2023	30/03/2023	Aplicação	2052-7	2.800,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	31/03/2023	31/03/2023	Resgate	2052-7	500,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	31/03/2023	31/03/2023	Aplicação	2051-9	672,23
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	31/03/2023	31/03/2023	Resgate	2052-7	2.883,95
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	04/04/2023	04/04/2023	Resgate	2051-9	252,41
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	05/04/2023	05/04/2023	Resgate	4.192507.0-6	16.748,80
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	10/04/2023	10/04/2023	Resgate	2052-7	6.700,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/04/2023	10/04/2023	Aplicação	2051-9	3.008.117,31
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/04/2023	10/04/2023	Resgate	2051-9	265.171,38
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/04/2023	10/04/2023	Aplicação	2052-7	788,70
Caixa FIC Estratégia Livre Multimercado	34.660.276/0001-18	10/04/2023	10/04/2023	Resgate	2051-9	3.008.117,31
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	11/04/2023	11/04/2023	Aplicação	2051-9	1.504.058,65
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	11/04/2023	11/04/2023	Aplicação	2051-9	1.504.058,65
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	11/04/2023	11/04/2023	Resgate	2051-9	1.502.556,92
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	11/04/2023	11/04/2023	Resgate	2051-9	1.504.058,65
BB FIC FIA Seleção Fatorial	07.882.792/0001-14	12/04/2023	17/04/2023	Rg. Total	37664-7	2.823.347,95
Caixa FIA ETF Ibovespa	15.154.236/0001-50	12/04/2023	17/04/2023	Resgate	2052-7	400.000,00
BB FIC FIA Alocação	18.270.783/0001-99	13/04/2023	18/04/2023	Rg. Total	37664-7	1.806.719,85
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/04/2023	13/04/2023	Aplicação	2051-9	2.695.465,26
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/04/2023	13/04/2023	Aplicação	2052-7	2.870,73
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	14/04/2023	14/04/2023	Aplicação	2052-7	80.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/04/2023	14/04/2023	Resgate	2051-9	1.447.643,34
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/04/2023	14/04/2023	Aplicação	2052-7	69.692,13
Banrisul RPPS III 2030	49.034.567/0001-78	17/04/2023	17/04/2023	Aplicação	4.192507.0-6	1.300.000,00
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	17/04/2023	17/04/2023	Aplicação	37664-7	1.411.673,97
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	17/04/2023	17/04/2023	Aplicação	37664-7	1.411.673,97
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/04/2023	17/04/2023	Aplicação	2051-9	18.868,98
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/04/2023	17/04/2023	Aplicação	2052-7	400.000,00
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	18/04/2023	18/04/2023	Aplicação	37664-7	903.359,93
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	18/04/2023	18/04/2023	Aplicação	37664-7	903.359,93
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	18/04/2023	18/04/2023	Aplicação	2052-7	400.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/04/2023	18/04/2023	Resgate	2052-7	400.000,00

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/04/2023	19/04/2023	Resgate	2052-7	56.024,05
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/04/2023	20/04/2023	Resgate	2052-7	1.741,99
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/04/2023	24/04/2023	Aplicação	2052-7	897,10
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	25/04/2023	25/04/2023	Aplicação	2051-9	66.070,60
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	25/04/2023	25/04/2023	Resgate	2052-7	1.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	26/04/2023	26/04/2023	Resgate	2051-9	1.202.506,15
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	26/04/2023	26/04/2023	Resgate	2052-7	13.247,15
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	05/05/2023	05/05/2023	Resgate	4.192507.0-6	16.748,80
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/05/2023	05/05/2023	Resgate	2051-9	475,38
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/05/2023	05/05/2023	Resgate	2052-7	1.960,51
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	09/05/2023	09/05/2023	Resgate	2051-9	89.995,81
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	09/05/2023	09/05/2023	Aplicação	2052-7	1.980,62
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/05/2023	10/05/2023	Resgate	2051-9	56.737,20
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	15/05/2023	15/05/2023	Aplicação	2051-9	890,63
BB FIA Bolsa Americana	36.178.569/0001-99	16/05/2023	19/05/2023	Rg. Total	37664-7	5.821.536,67
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	16/05/2023	16/05/2023	Aplicação	37664-7	7.426.743,37
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA	15.486.093/0001-83	16/05/2023	16/05/2023	Rg. Total	37664-7	7.660.271,59
Caixa FIA ETF Ibovespa	15.154.236/0001-50	16/05/2023	19/05/2023	Rg. Total	2051-9	1.480.387,19
Caixa FIA ETF Ibovespa	15.154.236/0001-50	16/05/2023	19/05/2023	Rg. Total	2052-7	496.628,87
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	17.502.937/0001-68	16/05/2023	19/05/2023	Rg. Total	2052-7	800.708,57
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	16/05/2023	16/05/2023	Aplicação	2051-9	1.158,16
BB FIA Ações Alocação ETF IE	28.578.897/0001-54	17/05/2023	25/05/2023	Rg. Total	37664-7	2.896.196,01
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	17/05/2023	17/05/2023	Aplicação	37664-7	233.528,22
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/05/2023	18/05/2023	Aplicação	2051-9	504,60
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	37664-7	5.821.536,67
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	37664-7	1.300.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	2052-7	80.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	2052-7	55.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/05/2023	19/05/2023	Resgate	2052-7	55.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	50.569.054/0001-40	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	2051-9	1.480.387,19
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	11.060.913/0001-10	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	2052-7	496.628,87
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	2051-9	2.630.098,80
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/05/2023	19/05/2023	Resgate	2051-9	1.480.387,19
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	2052-7	12.478,13
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/05/2023	19/05/2023	Aplicação	2052-7	800.708,57
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	11.060.913/0001-10	22/05/2023	22/05/2023	Aplicação	2052-7	800.708,57

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa FIA Institucional BDR Nível 1	17.502.937/0001-68	22/05/2023	25/05/2023	Rg. Total	2051-9	8.162.418,68
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	22/05/2023	22/05/2023	Resgate	2052-7	802.701,07
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	25/05/2023	25/05/2023	Aplicação	2051-9	66.765,40
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	25/05/2023	25/05/2023	Aplicação	2051-9	8.162.418,68
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	26/05/2023	26/05/2023	Aplicação	37664-7	2.896.196,01
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	50.569.054/0001-40	26/05/2023	26/05/2023	Aplicação	2051-9	8.162.418,68
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	26/05/2023	26/05/2023	Resgate	2051-9	8.162.418,68
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	29/05/2023	29/05/2023	Resgate	2052-7	1.500,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/05/2023	29/05/2023	Resgate	2051-9	1.226.778,22
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/05/2023	29/05/2023	Resgate	2052-7	13.429,69
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	31/05/2023	31/05/2023	Aplicação	2051-9	672,23
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	02/06/2023	02/06/2023	Aplicação	2051-9	504,60
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	05/06/2023	05/06/2023	Resgate	4.192507.0-6	17.905,80
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	05/06/2023	05/06/2023	Resgate	2052-7	230,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/06/2023	05/06/2023	Resgate	2051-9	507,15
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/06/2023	05/06/2023	Resgate	2052-7	20,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	06/06/2023	06/06/2023	Aplicação	2051-9	2.048,79
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	07/06/2023	07/06/2023	Resgate	2052-7	190,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	07/06/2023	07/06/2023	Resgate	2051-9	160.500,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	07/06/2023	07/06/2023	Resgate	2051-9	32.534,92
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	12/06/2023	12/06/2023	Resgate	2052-7	4.300,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	12/06/2023	12/06/2023	Aplicação	2051-9	38.652,18
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	12/06/2023	12/06/2023	Aplicação	2052-7	33,95
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	15/06/2023	15/06/2023	Aplicação	2052-7	2.252,88
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	16/06/2023	16/06/2023	Aplicação	2051-9	2.648.764,85
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	20/06/2023	20/06/2023	Aplicação	37664-7	550.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	20/06/2023	20/06/2023	Aplicação	2051-9	550.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	11.060.913/0001-10	20/06/2023	20/06/2023	Aplicação	2052-7	80.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/06/2023	20/06/2023	Resgate	2051-9	1.248.421,61
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/06/2023	20/06/2023	Aplicação	2052-7	38.313,46
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	23/06/2023	23/06/2023	Resgate	2051-9	32.338,07
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	29/06/2023	29/06/2023	Resgate	2052-7	33.500,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/06/2023	29/06/2023	Resgate	2051-9	1.228.173,62
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/06/2023	29/06/2023	Resgate	2052-7	38.457,84
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/06/2023	30/06/2023	Aplicação	2051-9	53.269,87
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	03/07/2023	03/07/2023	Aplicação	2051-9	13.934,55

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/07/2023	05/07/2023	Resgate	2051-9	3.894,43
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/07/2023	05/07/2023	Resgate	2052-7	2.000,00
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	06/07/2023	06/07/2023	Resgate	4.192507.0-6	17.972,52
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/07/2023	10/07/2023	Resgate	2051-9	104.828,40
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/07/2023	10/07/2023	Aplicação	2052-7	2.895,89
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	11/07/2023	11/07/2023	Resgate	2052-7	1.800,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	11/07/2023	11/07/2023	Aplicação	2051-9	975,98
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	11/07/2023	11/07/2023	Resgate	2052-7	3.145,80
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/07/2023	13/07/2023	Aplicação	2051-9	1.511.858,28
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	14/07/2023	14/07/2023	Resgate	2052-7	270,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/07/2023	14/07/2023	Aplicação	2051-9	1.059.488,14
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/07/2023	14/07/2023	Resgate	2052-7	37,11
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/07/2023	19/07/2023	Resgate	2052-7	1.080.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/07/2023	19/07/2023	Resgate	2051-9	776.922,25
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/07/2023	20/07/2023	Resgate	2051-9	144.002,04
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/07/2023	20/07/2023	Aplicação	2052-7	90.147,79
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	24/07/2023	24/07/2023	Resgate	37664-7	4.000.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	24/07/2023	24/07/2023	Resgate	2051-9	2.000.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	24/07/2023	24/07/2023	Resgate	2052-7	1.000.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	24/07/2023	24/07/2023	Aplicação	2051-9	600.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	24/07/2023	24/07/2023	Aplicação	2051-9	2.000.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	24/07/2023	24/07/2023	Aplicação	2052-7	80.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	24/07/2023	24/07/2023	Aplicação	2052-7	1.000.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/07/2023	24/07/2023	Resgate	2051-9	1.200.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/07/2023	24/07/2023	Resgate	2052-7	79.564,90
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	25/07/2023	25/07/2023	Aplicação	37664-7	4.600.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	26/07/2023	26/07/2023	Aplicação	2051-9	67.438,61
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	27/07/2023	27/07/2023	Resgate	2051-9	556.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	27/07/2023	27/07/2023	Resgate	2052-7	19.700,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	27/07/2023	27/07/2023	Resgate	2052-7	940,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/07/2023	27/07/2023	Resgate	2051-9	670.832,11
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/07/2023	27/07/2023	Resgate	2052-7	10.673,54
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	28/07/2023	28/07/2023	Resgate	2051-9	4.525,44
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	31/07/2023	31/07/2023	Resgate	2051-9	910,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	31/07/2023	31/07/2023	Resgate	2051-9	391,31
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	04/08/2023	04/08/2023	Resgate	2052-7	1.447,00

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	04/08/2023	04/08/2023	Resgate	2051-9	9.464,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	04/08/2023	04/08/2023	Resgate	2051-9	0,40
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	07/08/2023	07/08/2023	Resgate	4.192507.0-6	18.474,46
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	10/08/2023	10/08/2023	Resgate	2052-7	1.365,24
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	10/08/2023	10/08/2023	Resgate	2051-9	201.251,91
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/08/2023	10/08/2023	Resgate	2052-7	14,77
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/08/2023	10/08/2023	Aplicação	2051-9	9.932,97
BB Previdenciário Títulos Públicos X	20.734.931/0001-20	14/08/2023	15/08/2023	Resgate	37664-7	39.611,80
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	14/08/2023	14/08/2023	Resgate	2052-7	277,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	14/08/2023	14/08/2023	Resgate	2051-9	152.576,37
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/08/2023	14/08/2023	Aplicação	2051-9	1.568,85
Banrisul RPPS III 2030	49.034.567/0001-78	15/08/2023	15/08/2023	Resgate	4.192507.0-6	139.265,42
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	15/08/2023	15/08/2023	Resgate	37664-7	618.190,96
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	15/08/2023	15/08/2023	Resgate	37664-7	19.077,77
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	44.345.590/0001-60	15/08/2023	15/08/2023	Resgate	37664-7	41.920,55
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	15/08/2023	15/08/2023	Aplicação	2052-7	2.980,33
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	15/08/2023	15/08/2023	Aplicação	2051-9	44.344,94
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	16.844.890/0001-58	16/08/2023	16/08/2023	Aplicação	4.192507.0-6	139.265,42
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	16/08/2023	16/08/2023	Aplicação	37664-7	718.801,08
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	16/08/2023	16/08/2023	Pagamento	2051-9	483.663,80
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	16/08/2023	16/08/2023	Aplicação	2051-9	3.114.033,95
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	18/08/2023	18/08/2023	Aplicação	2051-9	483.663,80
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/08/2023	18/08/2023	Resgate	2051-9	631.105,95
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/08/2023	18/08/2023	Aplicação	2052-7	89.439,67
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	21/08/2023	21/08/2023	Aplicação	37664-7	500.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	21/08/2023	21/08/2023	Aplicação	2051-9	500.000,00
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	21/08/2023	21/08/2023	Aplicação	2052-7	80.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/08/2023	21/08/2023	Resgate	2051-9	998.168,92
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/08/2023	21/08/2023	Resgate	2052-7	80.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	25/08/2023	25/08/2023	Resgate	2052-7	153,55
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	29/08/2023	29/08/2023	Resgate	2052-7	1.250,44
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/08/2023	29/08/2023	Resgate	2051-9	1.240.982,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/08/2023	29/08/2023	Resgate	2052-7	12.340,45
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/08/2023	30/08/2023	Aplicação	2051-9	69.180,87
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	01/09/2023	01/09/2023	Resgate	2052-7	557,52
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	01/09/2023	01/09/2023	Resgate	2051-9	4.919,15

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	01/09/2023	01/09/2023	Resgate	2052-7	5,61
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	04/09/2023	04/09/2023	Aplicação	2051-9	1.831,08
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	05/09/2023	05/09/2023	Resgate	4.192507.0-6	19.467,94
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/09/2023	05/09/2023	Resgate	2051-9	442,52
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	06/09/2023	06/09/2023	Resgate	2051-9	6.003,62
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	08/09/2023	08/09/2023	Resgate	2052-7	222,08
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	08/09/2023	08/09/2023	Resgate	2051-9	199.567,14
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	11/09/2023	11/09/2023	Aplicação	2051-9	4.579,81
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	12/09/2023	12/09/2023	Aplicação	2051-9	45.824,67
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	12/09/2023	12/09/2023	Aplicação	2052-7	2.980,33
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/09/2023	14/09/2023	Aplicação	2051-9	397.175,67
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	15/09/2023	15/09/2023	Resgate	2052-7	50.615,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	15/09/2023	15/09/2023	Resgate	2052-7	820,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	15/09/2023	15/09/2023	Aplicação	2051-9	53.281,72
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	15/09/2023	15/09/2023	Resgate	2052-7	2.981,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/09/2023	18/09/2023	Aplicação	2051-9	426.619,47
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	19/09/2023	19/09/2023	Aplicação	37664-7	600.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/09/2023	19/09/2023	Aplicação	2051-9	600.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/09/2023	19/09/2023	Aplicação	2052-7	75.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/09/2023	19/09/2023	Resgate	2052-7	272,54
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/09/2023	19/09/2023	Aplicação	2051-9	245.771,76
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/09/2023	19/09/2023	Aplicação	2052-7	72.558,56
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/09/2023	21/09/2023	Aplicação	2051-9	2.429,48
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	22/09/2023	22/09/2023	Aplicação	2051-9	1.653,34
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/09/2023	27/09/2023	Resgate	2051-9	1.253.151,90
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/09/2023	27/09/2023	Resgate	2052-7	13.863,76
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	28/09/2023	28/09/2023	Resgate	2051-9	1.106,99
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	29/09/2023	29/09/2023	Aplicação	2051-9	68.255,75
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	02/10/2023	02/10/2023	Resgate	2051-9	4.354,20
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	02/10/2023	02/10/2023	Aplicação	2052-7	3.432,35
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	03/10/2023	03/10/2023	Aplicação	2051-9	1.831,08
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	05/10/2023	05/10/2023	Resgate	4.192507.0-6	20.014,75
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/10/2023	05/10/2023	Aplicação	2051-9	2.099,81
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/10/2023	05/10/2023	Resgate	2052-7	92,65
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/10/2023	10/10/2023	Resgate	2051-9	151.492,62
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/10/2023	10/10/2023	Aplicação	2052-7	2.736,33

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	13/10/2023	13/10/2023	Resgate	2052-7	399,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	16/10/2023	16/10/2023	Aplicação	2051-9	1.829,53
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/10/2023	19/10/2023	Resgate	2052-7	54.616,35
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/10/2023	20/10/2023	Aplicação	2051-9	1.056.962,67
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	16.844.890/0001-58	24/10/2023	25/10/2023	Resgate	4.192507.0-6	3.000.000,00
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	24/10/2023	24/10/2023	Resgate	37664-7	2.000.000,00
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	44.345.473/0001-04	24/10/2023	24/10/2023	Aplicação	37664-7	2.000.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/10/2023	24/10/2023	Resgate	2051-9	148.774,78
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	24/10/2023	24/10/2023	Aplicação	2052-7	150.731,40
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	44.345.473/0001-04	25/10/2023	25/10/2023	Aplicação	37664-7	1.000.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	25/10/2023	25/10/2023	Aplicação	2052-7	75.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	25/10/2023	25/10/2023	Resgate	2052-7	78.432,35
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	26/10/2023	26/10/2023	Resgate	2051-9	753,11
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	26/10/2023	26/10/2023	Resgate	2052-7	1.000,00
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	44.345.473/0001-04	27/10/2023	27/10/2023	Aplicação	37664-7	1.000.000,00
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	44.345.473/0001-04	27/10/2023	27/10/2023	Aplicação	37664-7	1.000.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	27/10/2023	27/10/2023	Resgate	2051-9	362.600,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/10/2023	27/10/2023	Resgate	2052-7	13.863,76
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/10/2023	27/10/2023	Resgate	2051-9	925.040,27
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/10/2023	30/10/2023	Aplicação	2051-9	64.328,27
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/10/2023	30/10/2023	Resgate	2052-7	150,47
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	31/10/2023	31/10/2023	Resgate	2051-9	18.169,59
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	01/11/2023	01/11/2023	Resgate	2051-9	753.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	01/11/2023	01/11/2023	Resgate	2051-9	663,88
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	01/11/2023	01/11/2023	Resgate	2051-9	46.688,68
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	01/11/2023	01/11/2023	Resgate	2052-7	9.057,65
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	03/11/2023	03/11/2023	Resgate	2051-9	148.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	03/11/2023	03/11/2023	Aplicação	2051-9	135,27
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	03/11/2023	03/11/2023	Resgate	2052-7	248,27
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	06/11/2023	06/11/2023	Resgate	4.192507.0-6	20.458,16
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	07/11/2023	07/11/2023	Resgate	2051-9	62.037,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	07/11/2023	07/11/2023	Aplicação	2051-9	62.037,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/11/2023	10/11/2023	Resgate	2051-9	53.863,57
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	10/11/2023	10/11/2023	Resgate	2052-7	27,07
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/11/2023	14/11/2023	Aplicação	2051-9	46.560,32
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/11/2023	14/11/2023	Aplicação	2052-7	2.990,18

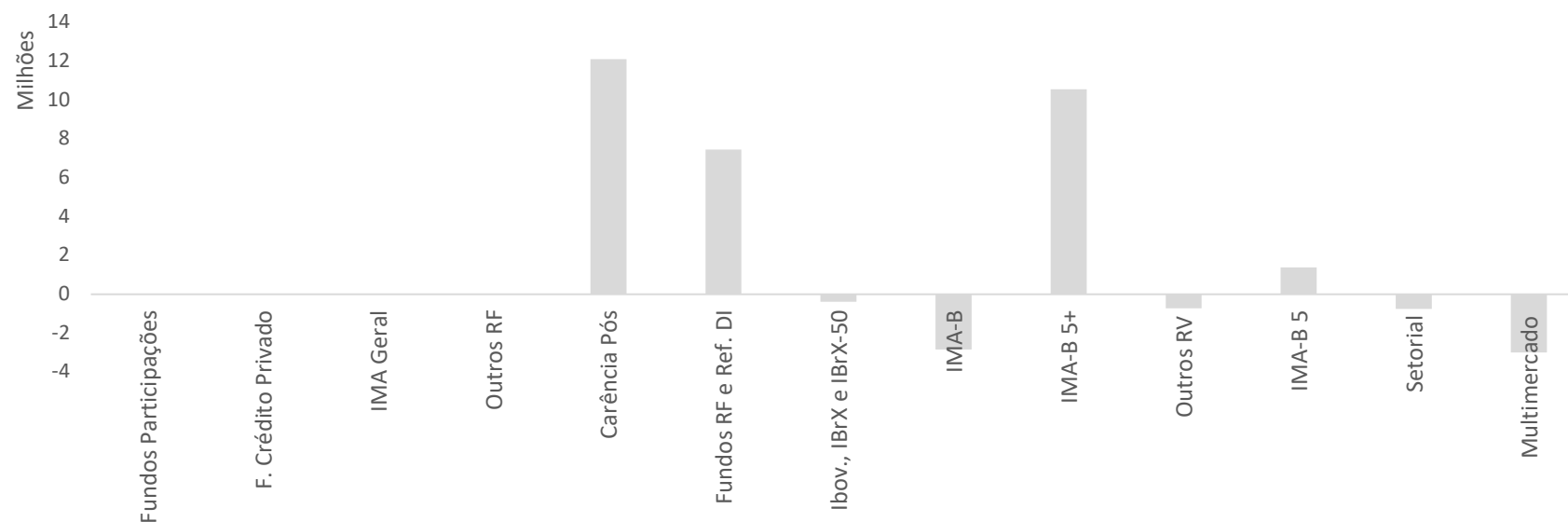
APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	16/11/2023	16/11/2023	Resgate	37664-7	508.620,71
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	17/11/2023	17/11/2023	Aplicação	37664-7	508.620,71
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	50.569.054/0001-40	17/11/2023	17/11/2023	Pagamento	2051-9	269.253,49
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/11/2023	17/11/2023	Aplicação	2051-9	419.898,68
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/11/2023	17/11/2023	Aplicação	2051-9	269.253,49
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	17/11/2023	17/11/2023	Resgate	2052-7	54.104,64
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/11/2023	20/11/2023	Aplicação	2051-9	641.453,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	21/11/2023	21/11/2023	Aplicação	2052-7	100.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/11/2023	21/11/2023	Resgate	2051-9	149.884,02
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/11/2023	21/11/2023	Aplicação	2052-7	49.884,02
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	28/11/2023	28/11/2023	Resgate	2051-9	64.430,90
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	28/11/2023	28/11/2023	Resgate	2051-9	1.238.685,08
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	28/11/2023	28/11/2023	Resgate	2052-7	18.105,55
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	30/11/2023	30/11/2023	Resgate	2051-9	238,79
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	30/11/2023	30/11/2023	Aplicação	2051-9	68.661,97
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	05/12/2023	05/12/2023	Resgate	4.192507-0-6	20.458,01
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/12/2023	05/12/2023	Aplicação	2051-9	1.277,22
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	05/12/2023	05/12/2023	Resgate	2052-7	23.873,13
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	06/12/2023	06/12/2023	Aplicação	2051-9	1.053,84
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	07/12/2023	07/12/2023	Aplicação	2051-9	678,39
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	07/12/2023	07/12/2023	Resgate	2052-7	2.755,90
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	08/12/2023	08/12/2023	Resgate	2051-9	138.853,93
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	08/12/2023	08/12/2023	Resgate	2051-9	72.275,49
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	08/12/2023	08/12/2023	Resgate	2052-7	248,27
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	11/12/2023	11/12/2023	Aplicação	2051-9	41.078,64
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	11/12/2023	11/12/2023	Aplicação	2052-7	2.693,03
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	12/12/2023	12/12/2023	Aplicação	2051-9	4.581,39
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/12/2023	14/12/2023	Resgate	2051-9	773,66
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	14/12/2023	14/12/2023	Resgate	2052-7	80,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	15/12/2023	15/12/2023	Aplicação	2051-9	6.404,12
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	18/12/2023	18/12/2023	Resgate	2052-7	39.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	18/12/2023	18/12/2023	Resgate	2052-7	6.500,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/12/2023	18/12/2023	Aplicação	2051-9	2.099,53
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	18/12/2023	18/12/2023	Resgate	2052-7	15.212,11
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/12/2023	19/12/2023	Resgate	2052-7	20.000,00
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/12/2023	19/12/2023	Resgate	2052-7	10.200,00

APLICAÇÕES E RESGATES

FUNDO	CNPJ	OPERAÇÃO	LIQUIDAÇÃO	TIPO	CONTA	VALOR
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	19/12/2023	19/12/2023	Resgate	2051-9	528.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/12/2023	19/12/2023	Resgate	2051-9	53.469,48
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	19/12/2023	19/12/2023	Resgate	2052-7	225,64
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	20/12/2023	20/12/2023	Aplicação	2052-7	80.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/12/2023	20/12/2023	Aplicação	2051-9	1.823.643,21
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	20/12/2023	20/12/2023	Aplicação	2052-7	216.392,74
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	21/12/2023	21/12/2023	Aplicação	2052-7	150.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/12/2023	21/12/2023	Aplicação	2051-9	2.758,01
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	21/12/2023	21/12/2023	Resgate	2052-7	150.000,00
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	26/12/2023	26/12/2023	Resgate	2052-7	1.670,64
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/12/2023	27/12/2023	Resgate	2051-9	1.367.151,64
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	27/12/2023	27/12/2023	Resgate	2052-7	20.842,35
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	28/12/2023	28/12/2023	Resgate	4.192507.0-6	20.458,01
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	28/12/2023	28/12/2023	Resgate	2051-9	83.625,37
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	28/12/2023	28/12/2023	Resgate	2052-7	2.208,27

MOVIMENTAÇÕES DE RECURSOS POR ÍNDICES - CONSOLIDADO DO ANO EM R\$ MILHÕES



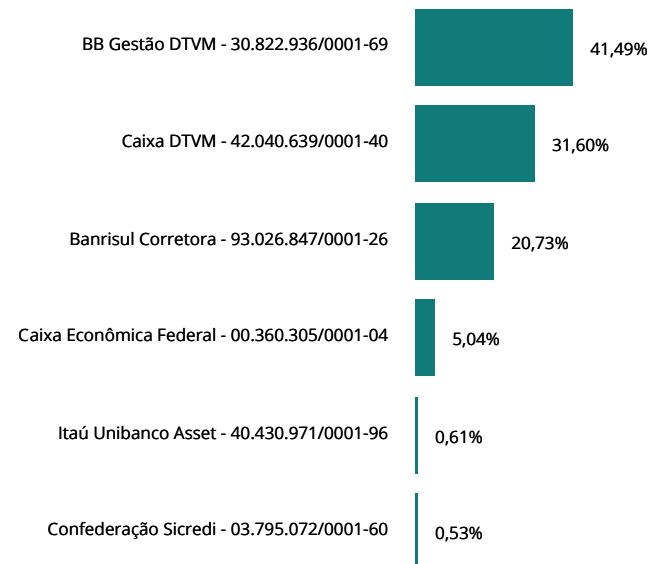
PATRIMÔNIO DOS GESTORES DE RECURSOS

GESTOR	CNPJ	ART. 21	PATRIMÔNIO SOB GESTÃO	% PARTICIPAÇÃO	
Banrisul Corretora	93.026.847/0001-26	Sim	15.580.151.639,98	0,26	✓
BB Gestão DTVM	30.822.936/0001-69	Sim	1.527.440.526.850,00	0,01	✓
Caixa DTVM	42.040.639/0001-40	Não	500.848.247.751,43	0,01	✓
Caixa Econômica Federal	00.360.305/0001-04	Sim	26.925.362.179,78	0,04	✓
Confederação Sicredi	03.795.072/0001-60	Não	109.116.763.795,86	0,00	✓
Itaú Unibanco Asset	40.430.971/0001-96	Não	868.537.342.541,52	0,00	✓

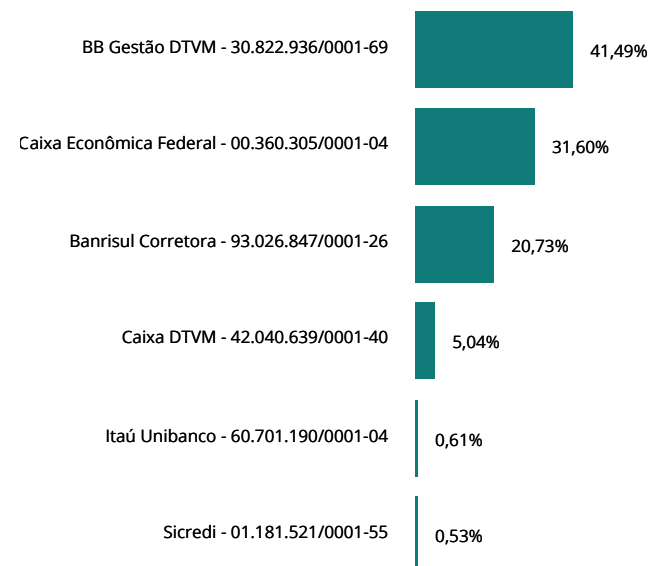
Obs.: Patrimônio em 11/2023, o mais recente divulgado pela Anbima na data de publicação desse relatório.

O % Participação denota o quanto o RPPS detém do PL do Gestor, sendo limitado a 5% pelo Art. 20. O Art. 21 indica se a instituição atende ao disposto no inciso I do parágrafo 2º, sendo necessário que ou o gestor ou o administrador do fundo respeite a regra.

INVESTIMENTOS POR GESTOR DE RECURSOS



INVESTIMENTOS POR ADMINISTRADOR DE RECURSOS



FUNDOS	CNPJ	ENQ.	PATRIMÔNIO LÍQUIDO	ART. 18	ART. 19	ART. 21	GESTOR	ADMINISTRADOR	STATUS
FUNDOS DE RENDA FIXA									
Banrisul Absoluto	21.743.480/0001-50	7, I, b	3.621.394.647,54	5,67	0,31	Sim	93.026.847/0001-26	93.026.847/0001-26	✓
Banrisul Foco Referenciado IMA-B	16.844.890/0001-58	7, I, b	419.603.754,20	5,58	2,64	Sim	93.026.847/0001-26	93.026.847/0001-26	✓
Banrisul RPPS 2024	46.521.007/0001-50	7, I, b	416.905.172,41	4,03	1,92	Sim	93.026.847/0001-26	93.026.847/0001-26	✓
Banrisul RPPS II 2027	46.655.127/0001-40	7, I, b	153.386.630,87	2,88	3,73	Sim	93.026.847/0001-26	93.026.847/0001-26	✓
Banrisul RPPS III 2030	49.034.567/0001-78	7, I, b	40.797.160,98	2,57	12,52	Sim	93.026.847/0001-26	93.026.847/0001-26	✓
BB FIC Prev. Alocação Ativa Retorno Total RF	35.292.588/0001-89	7, I, b	6.297.472.287,75	2,79	0,09	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Prev. Perfil Renda Fixa	13.077.418/0001-49	7, III, a	16.475.113.370,57	10,13	0,12	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB FIC Renda Fixa Ativa Plus	44.345.473/0001-04	7, III, a	5.309.211.734,43	2,46	0,09	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos 2030	46.134.117/0001-69	7, I, b	955.783.734,64	11,96	2,49	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos 2035	49.963.829/0001-89	7, I, b	632.768.120,74	9,30	2,92	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IMA-B 5+	13.327.340/0001-73	7, I, b	1.649.727.443,32	3,03	0,36	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos IPCA III	19.303.795/0001-35	7, I, b	192.522.932,52	0,34	0,35	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos X	20.734.931/0001-20	7, I, b	215.228.460,08	0,70	0,64	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
BB Previdenciário Títulos Públicos XXI	44.345.590/0001-60	7, I, b	3.596.758.160,15	0,78	0,04	Sim	30.822.936/0001-69	30.822.936/0001-69	✓
Caixa Brasil Referenciado	03.737.206/0001-97	7, III, a	13.988.008.512,08	10,65	0,15	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos 2030 II	19.769.046/0001-06	7, I, b	1.007.372.677,67	9,79	1,93	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos 2033	50.569.054/0001-40	7, I, b	619.381.246,15	5,04	1,62	Sim	00.360.305/0001-04	42.040.639/0001-40	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B	10.740.658/0001-93	7, I, b	5.157.397.073,53	7,74	0,30	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5	11.060.913/0001-10	7, I, b	7.603.591.100,02	0,73	0,02	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa Brasil Títulos Públicos IMA-B 5+	10.577.503/0001-88	7, I, b	1.451.468.758,30	2,47	0,34	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Caixa FIC Brasil Disponibilidades	14.508.643/0001-55	7, III, a	959.626.212,50	0,21	0,04	Sim	42.040.639/0001-40	00.360.305/0001-04	✓
Itaú FIC Global Dinâmico Institucional	32.972.942/0001-28	7, III, a	2.357.597.914,23	0,61	0,05	Sim	40.430.971/0001-96	60.701.190/0001-04	✓
Sicredi Liquidez Empresarial Referenciado Renda Fixa	24.634.187/0001-43	7, I, b	2.215.883.112,99	0,53	0,05	Sim	03.795.072/0001-60	01.181.521/0001-55	✓

Art. 18 retrata o percentual do PL do RPPS que está aplicado no fundo, cujo limite é de 20%. Art. 19 denota o percentual do PL do fundo que o RPPS detém, sendo limitado a 5% em fundos enquadrados no Art. 7 V, e de 15% para os demais. Ambos os Art. 18 e 19 não se aplicam aos fundos enquadrados no Art. 7 I. Art. 21 aponta se o administrador ou o gestor atende às exigências, estando destacado o CNPJ da instituição caso ela não atenda.

POR SEGMENTO

ENQUADRAMENTO	SALDO EM R\$	% CARTEIRA	% LIMITE RESOLUÇÃO	% LIMITE PI 2023
7, I	150.854.590,45	75,94	100,0	✓
7, I, a	-	0,00	100,0	✓
7, I, b	150.854.590,45	75,94	100,0	✓
7, I, c	-	0,00	100,0	✓
7, II	-	0,00	5,0	✓
7, III	47.786.939,55	24,06	60,0	✓
7, III, a	47.786.939,55	24,06	60,0	✓
7, III, b	-	0,00	60,0	✓
7, IV	-	0,00	20,0	✓
7, V	-	0,00	15,0	✓
7, V, a	-	0,00	5,0	✓
7, V, b	-	0,00	5,0	✓
7, V, c	-	0,00	5,0	✓
ART. 7	198.641.530,00	100,00	100,0	✓
8, I	-	0,00	30,0	✓
8, II	-	0,00	30,0	✓
ART. 8	-	0,00	30,0	✓
9, I	-	0,00	10,0	✓
9, II	-	0,00	10,0	✓
9, III	-	0,00	10,0	✓
ART. 9	-	0,00	10,0	✓
10, I	-	0,00	10,0	✓
10, II	-	0,00	5,0	✓
10, III	-	0,00	5,0	✓
ART. 10	-	0,00	15,0	✓
ART. 11	-	0,00	5,0	✓
ART. 12	-	0,00	5,0	✓
ART. 8, 10 E 11	-	0,00	30,0	✓
PATRIMÔNIO INVESTIDO	198.641.530,00			

Obs.: Para fins de enquadramento, são desconsideradas as disponibilidades financeiras mantidas em conta corrente e poupança.

PRÓ GESTÃO

O PREV-ESTEIO não possui certificado de implementação do Pró-Gestão RPPS, da Secretaria de Previdência, conforme os níveis crescentes de aderência na forma por ela estabelecidos.

PARECER SOBRE ENQUADRAMENTO DA CARTEIRA

- ✓ Enquadrada em relação à Resolução CMN 4.963/2021.
- ✓ Enquadrada em relação à Política de Investimento vigente.

Em 2023, o cenário econômico mundial ainda continha os desafios relacionados ao controle da inflação. Apesar dos juros restritivos por um longo período, a inflação permanecia em ritmo lento de desaceleração. Ademais, a volatilidade observada no mercado ocorreu devido a fatores exógenos das projeções e que eclodiram ao longo do ano.

Nos Estados Unidos, observava-se uma resiliência no desempenho econômico e no mercado de trabalho. O índice de preços ainda estava longe da meta de inflação e haveria a necessidade de continuar elevando a taxa de juros. O alerta somou à possível crise de bancos regionais e o mercado de crédito, além da preocupação com os gastos fiscais e paralisação do governo.

A suspensão do teto da dívida aliado a piores perspectivas para os juros resultou na elevação do prêmio dos títulos públicos americanos em agosto. O dinheiro do mundo estava sendo convertido em dólar, o que desvalorizou as moedas e agravou o mercado financeiro dos países, principalmente os emergentes. Por outro lado, as empresas de tecnologia, que representam 25% da composição do S&P500, apresentaram forte valorização devido as perspectivas de evolução da inteligência artificial.

Na Zona do Euro, o fator de preocupação era o processo desinflacionário, movimento registrado principalmente com a correção dos preços de energia. Por essa razão, o Banco Central Europeu compreendia a necessidade de manter juros contracionistas por mais tempo. Ao contrário dos Estados Unidos, o bloco europeu experienciava um enfraquecimento gradual de sua economia, com a perda do poder de compra da população, além de uma redução da demanda interna e de investimentos.

Sobre a China, devido a implementação da política zero Covid, a economia enfrentou uma contração de demanda doméstica, um choque de oferta de produtos e serviços. Com o fim da restrição em janeiro, o governo almejava proporcionar uma recuperação econômica em 2023. A reabertura ganhou um ritmo nos primeiros meses, mas perdeu forças. A proposta de recuperação da economia chinesa apresentou muita fragilidade com problemas financeiros no setor imobiliário, riscos deflacionários, demanda local fraca, redução da confiança e aumento do endividamento do governo.

O Brasil iniciou o ano com um novo governo rodeado de pessimismo, dadas as características do presidente Lula e a aprovação da PEC de Transição que permitiria a elevação dos gastos. Além disso, ocorreu maior tensão a partir do conflito de ideias entre o Banco Central e o novo presidente da república a respeito da definição da meta de inflação.

No entanto, a surpresa do primeiro semestre veio com o expressivo resultado do Produto Interno Bruto (PIB). Em um cenário base caracterizado pelo arrefecimento da atividade econômica, o destaque seria explicado pelo ótimo desempenho do setor agropecuário no primeiro trimestre e serviços financeiros no segundo trimestre. Outro imprevisto foi o melhor relacionamento do Ministro da Fazenda com o mercado, momento em que reduzia a incerteza referente a condução orçamentária do governo e possibilitaria uma melhora na ancoragem das expectativas da inflação com a introdução de um novo arcabouço fiscal, reformas tributárias e uma resolução do debate sobre as metas de inflação. Por efeito de maior otimismo, o desempenho da economia brasileira era revisado positivamente, devido a fatores externos e internos. Inicialmente, a possibilidade de reabertura chinesa e a resiliência econômica mundial de forma geral, elevava a demanda externa por commodities brasileiras. A demanda interna era influenciada por duas forças contrárias, ou seja, os efeitos defasados da política monetária contracionista e pela política fiscal expansionista.

Apesar do marco do processo de queda na taxa Selic e da sinalização de quedas consecutivas de 0,50% até o final do ano, os riscos monetários e fiscais dos Estados Unidos promoveram uma abertura da curva de juros americana e deteriorou os mercados financeiros no segundo semestre. Do ponto de vista interno, havia novamente uma perspectiva mais pessimista sobre a capacidade do governo cumprir com a meta fiscal de déficit zero em 2024. A consequência desse cenário foi a elevação de prêmio de risco e da inflação implícita.

O ponto de inflexão ocorreu no fim do ano, quando o Federal Reserve (Fed) identificou a possibilidade de a economia americana obter uma direção de pouso suave. Esse cenário ocorre quando os custos para o controle da inflação são baixos para a economia real, isto é, a desinflação seguia bem-comportada e a economia continuava aquecida. Naquela situação, a orientação do Fed alterou de preocupação com a inflação para evitar riscos de uma forte desaceleração econômica. No mercado local, a aprovação de algumas medidas que iriam aumentar a arrecadação em 2024 pelo Congresso, também foi responsável pela propensão ao risco, e, portanto, uma expressiva valorização dos investimentos. Por outro lado, a China permanecia deteriorada, com uma demanda fraca, deflação nos preços e elevação da dívida do governo, resultando em uma fuga de capital do país.

Em resumo, a economia permaneceu direcionada ao controle da inflação e na dinâmica dos juros pelos Bancos Centrais em 2023. O Brasil deve crescer próximo dos 3,0% no ano, mas incentivado pelo maior consumo das famílias em detrimento de menores investimentos, o que proporciona dúvidas à cerca da sustentabilidade do crescimento econômico no longo prazo. Ademais, a falta de disciplina fiscal, no que diz respeito à gestão orçamentária, interferiu nas expectativas de inflação que continuam acima da meta definida pela Conselho Monetário Nacional (CMN).