



SUPSSP-FORTIM

 Janeiro/2023



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 26.126.762,58</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>1,49%</td> <td>1,49%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	1,49%	1,49%	<p>Meta</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,92%</td> <td>0,93%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,92%	0,93%	<p>Gap</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,56%</td> <td>0,56%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,56%	0,56%	<p>VaR</p> <p>0,32%</p>
Mês	Acum.															
1,49%	1,49%															
Mês	Acum.															
0,92%	0,93%															
Mês	Acum.															
0,56%	0,56%															






Evolução do Patrimônio

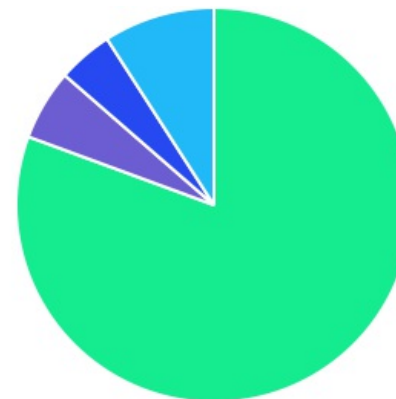








Comparativo (Rentabilidades | Metas)

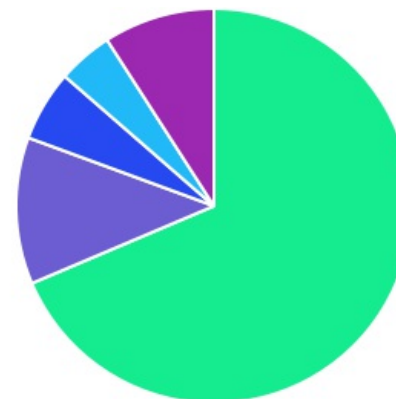




ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 1.930.532,97	7.41%	D+0	7, I "b"	R\$ 21.405,53	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 4.332.976,79	16.64%	D+0	7, I "b"	R\$ 44.422,88	1,04%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 2.662.927,44	10.23%	D+1	7, I "b"	R\$ 36.111,71	1,37%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 2.166.638,25	8.32%	D+1	7, I "b"	R\$ 14.792,00	0,64%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 382.224,15	1.47%	D+1	7, I "b"	R\$ -40,18	-0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 1.453.492,47	5.58%	D+3	7, I "b"	R\$ 9.353,04	0,65%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 4.931.699,39	18.94%	D+1	7, I "b"	R\$ 69.827,58	1,44%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 219.792,30	0.84%	D+0	7, III "a"	R\$ 2.442,53	1,12%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 2.910.472,36	11.18%	D+0	7, III "a"	R\$ 31.502,16	1,09%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	R\$ 704.899,11	2.71%	D+3	8, I	R\$ 37.920,57	5,69%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC...	R\$ 802.507,30	3.08%	D+15	8, I	R\$ 25.666,83	3,30%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	R\$ 1.172.461,33	4.50%	D+3	9, III	R\$ 48.524,88	4,32%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.804.285,88	6.93%	D+3	10, I	R\$ 30.488,54	1,72%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	R\$ 3.738,07	0.01%	D+1	10, I	R\$ 228,99	6,53%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO...	R\$ 558.197,58	2.14%	D+0	10, I	R\$ 6.053,53	1,10%
Total investimentos	R\$ 26.036.845,39	100.00%			R\$ 378.700,59	1,49%
Disponibilidade	R\$ 89.917,19	-			-	-
Total patrimônio	R\$ 26.126.762,58	100.00%			-	-

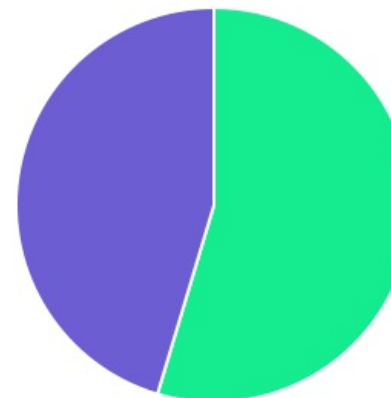
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	80,62%	R\$ 20.990.756,12	
Estruturados	9,09%	R\$ 2.366.221,53	
Renda Variável	5,79%	R\$ 1.507.406,41	
Exterior	4,50%	R\$ 1.172.461,33	
Total	100,00%	R\$ 26.036.845,39	





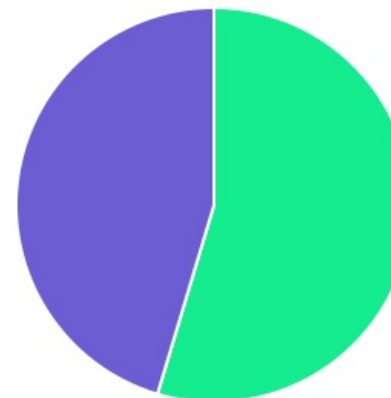
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	68,60%	R\$ 17.860.491,46	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	12,02%	R\$ 3.130.264,66	
Artigo 10º, Inciso I	9,09%	R\$ 2.366.221,53	
Artigo 8º, Inciso I	5,79%	R\$ 1.507.406,41	
Artigo 9º, Inciso III	4,50%	R\$ 1.172.461,33	
Total	100,00%	R\$ 26.036.845,39	















GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	54,62%	R\$ 14.220.071,39	
BB GESTAO	45,38%	R\$ 11.816.774,00	
Total	100,00%	R\$ 26.036.845,39	



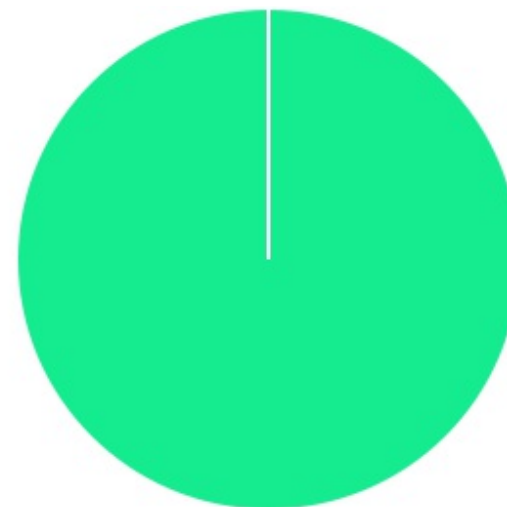
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	54,62%	R\$ 14.220.071,39	
BB GESTAO	45,38%	R\$ 11.816.774,00	
Total	100,00%	R\$ 26.036.845,39	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	22,22%	R\$ 5.786.469,26	
IDKA IPCA 2A	18,94%	R\$ 4.931.699,39	
CDI	12,02%	R\$ 3.130.264,66	
IMA-B 5	10,23%	R\$ 2.662.927,44	
125% do CDI	9,07%	R\$ 2.362.483,46	
IRF-M	8,32%	R\$ 2.166.638,25	
IRF-M 1	7,41%	R\$ 1.930.532,97	
GLOBAL BDRX	4,50%	R\$ 1.172.461,33	
IBOVESPA	3,08%	R\$ 802.507,30	
IDIV	2,71%	R\$ 704.899,11	
IMA-B	1,47%	R\$ 382.224,15	
S&P 500	0,01%	R\$ 3.738,07	
Total	100,00%	R\$ 26.036.845,39	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 26.036.845,39	■
Total	100,00%	R\$ 26.036.845,39	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 17.860.491,46	68.60%	30,00%	50,00%	80,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa - 7, III "a"	60%	R\$ 3.130.264,66	12.02%	10,00%	25,00%	50,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Ativos Bancários - 7, IV	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	3,00%	10,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, V "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, V "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	2,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, V "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa		R\$ 20.990.756,12	80,62%			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 1.507.406,41	5.79%	0,00%	6,00%	20,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável		R\$ 1.507.406,41	5,79%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Renda Fixa - Dívida Externa - 9, I	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Investimento no Exterior - 9, II	10%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Ações - BDR Nível I - 9, III	10%	R\$ 1.172.461,33	4.50%	0,00%	5,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		R\$ 1.172.461,33	4,50%			

FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 2.366.221,53	9,09%	0,00%	9,00%	10,00%
FI em Participações - 10, II	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI "Ações - Mercado de Acesso" - 10, III	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Estruturados		R\$ 2.366.221,53	9,09%			
FUNDOS IMOBILIÁRIOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Imobiliário - 11	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Fundos Imobiliários		R\$ 0,00	0,00%			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Total Empréstimos Consignados		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 26.036.845,39	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2023			IPCA + 4.83% a.a.			
Janeiro	R\$ 25.939.371,27	R\$ 26.126.762,58	0,92%	R\$ 378.700,59	1,49%	0,56%
Total	R\$ 25.939.371,27	R\$ 26.126.762,58	0,93%	R\$ 378.700,59	1,49%	0,56%
2022			IPCA + 4.83% a.a.			
Janeiro	R\$ 24.145.746,30	R\$ 24.306.167,11	0,93%	R\$ 97.618,78	0,38%	-0,56%
Fevereiro	R\$ 24.306.167,11	R\$ 24.300.933,81	1,40%	R\$ 39.041,24	0,16%	-1,24%
Março	R\$ 24.300.933,81	R\$ 24.783.623,21	2,01%	R\$ 410.327,08	1,90%	-0,12%
Abril	R\$ 24.783.623,21	R\$ 24.768.926,16	1,45%	R\$ 7.302,29	0,03%	-1,42%
Maio	R\$ 24.768.926,16	R\$ 24.929.365,83	0,86%	R\$ 204.043,10	0,83%	-0,03%
Junho	R\$ 24.929.365,83	R\$ 24.850.906,88	1,06%	R\$ -80.376,26	-0,32%	-1,39%
Julho	R\$ 24.850.906,88	R\$ 25.010.687,08	-0,29%	R\$ 252.647,68	1,02%	1,31%
Agosto	R\$ 25.010.687,08	R\$ 25.172.606,99	0,03%	R\$ 271.028,61	1,08%	1,05%
Setembro	R\$ 25.172.606,99	R\$ 25.199.733,44	0,10%	R\$ 96.011,79	0,38%	0,28%
Outubro	R\$ 25.199.733,44	R\$ 25.538.491,24	0,98%	R\$ 399.616,12	1,59%	0,61%
Novembro	R\$ 25.538.491,24	R\$ 25.512.576,75	0,80%	R\$ 29.245,69	0,12%	-0,69%
Dezembro	R\$ 25.512.576,75	R\$ 25.939.371,27	1,01%	R\$ 141.581,53	0,57%	-0,45%
Total	R\$ 25.512.576,75	R\$ 25.939.371,27	10,89%	R\$ 1.868.087,65	7,99%	-2,90%
2021			IPCA + 5.14% a.a.			
Janeiro	R\$ 22.560.987,97	R\$ 22.457.105,93	0,67%	R\$ -181.336,95	-0,81%	-1,48%
Fevereiro	R\$ 22.457.105,93	R\$ 22.212.634,32	1,28%	R\$ -269.596,61	-1,20%	-2,48%
Março	R\$ 22.212.634,32	R\$ 22.462.625,90	1,35%	R\$ 232.541,01	0,93%	-0,42%
Abril	R\$ 22.462.625,90	R\$ 22.656.154,88	0,73%	R\$ 171.205,08	0,76%	0,04%

Maio	R\$ 22.656.154,88	R\$ 22.907.442,85	1,25%	R\$ 226.599,39	1,01%	-0,24%
Junho	R\$ 22.907.442,85	R\$ 22.930.491,33	0,95%	R\$ -14.190,82	-0,06%	-1,01%
Julho	R\$ 22.930.491,33	R\$ 22.869.846,04	1,38%	R\$ -73.874,11	-0,32%	-1,70%
Agosto	R\$ 22.869.846,04	R\$ 22.813.849,72	1,29%	R\$ -84.528,29	-0,37%	-1,66%
Setembro	R\$ 22.813.849,72	R\$ 22.743.396,24	1,58%	R\$ -103.367,43	-0,46%	-2,03%
Outubro	R\$ 22.743.396,24	R\$ 22.551.379,09	1,67%	R\$ -186.997,94	-0,82%	-2,49%
Novembro	R\$ 22.551.379,09	R\$ 22.851.632,06	1,37%	R\$ 269.076,88	1,20%	-0,17%
Dezembro	R\$ 22.851.632,06	R\$ 24.145.746,30	1,15%	R\$ 257.551,61	1,13%	-0,01%
Total	R\$ 22.851.632,06	R\$ 24.145.746,30	15,72%	R\$ 243.081,82	0,96%	-14,76%

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE				
		Mês (%)	Ano (%)	12 meses (%)	24 meses (%)	Início (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP FI...	10.577.519/0001-90	-	-	-	-	-4,79%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	-	-	6,60%	-	7,16%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	03.737.206/0001-97	1,09%	1,09%	-	-	11,21%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	1,12%	1,12%	12,97%	-	13,52%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	1,44%	1,44%	10,51%	-	10,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RF PREVID	25.078.994/0001-90	-	-	3,54%	-	1,60%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	23.215.097/0001-55	1,04%	1,04%	11,10%	11,70%	11,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	1,12%	1,12%	12,31%	16,00%	16,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP FI...	11.060.913/0001-10	-	-	-	-	-0,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TP FI RF	10.740.658/0001-93	-	-	-	-	-2,86%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	03.543.447/0001-03	1,37%	1,37%	10,76%	-	15,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-	-	-0,03%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	17.502.937/0001-68	4,32%	4,32%	-15,85%	-	-10,07%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	0,64%	0,64%	9,41%	-	9,68%
BB IMA-B TP FI RF	07.442.078/0001-05	-0,01%	-0,01%	6,90%	-	7,74%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO...	14.120.520/0001-42	1,10%	1,10%	-	-	11,64%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	5,69%	5,69%	9,82%	13,80%	6,75%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	1,72%	1,72%	10,99%	13,67%	13,01%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	6,53%	6,53%	-0,98%	-	16,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	0,65%	0,65%	9,80%	-	12,61%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC...	30.068.169/0001-44	3,30%	3,30%	-	-	0,31%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U.		MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
				COMPRA	ATUAL				
							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)