



# SUPSSP-FORTIM

 Maio/2023

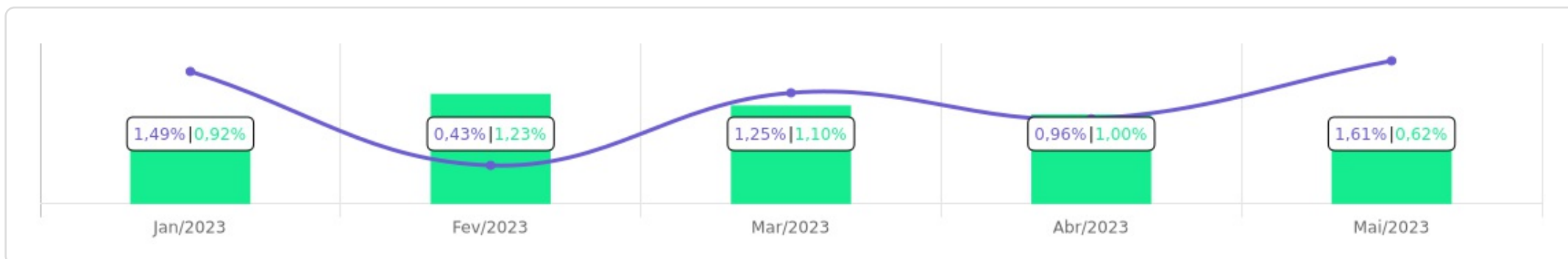


<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 26.792.281,07</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>1,61%</td> <td>5,85%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	1,61%	5,85%	<p>Meta</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,62%</td> <td>5,00%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,62%	5,00%	<p>Gap</p> <table border="1"> <tr> <th>Mês</th> <th>Acum.</th> </tr> <tr> <td>0,98%</td> <td>0,85%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,98%	0,85%	<p>VaR</p> <p>0,29%</p>
Mês	Acum.															
1,61%	5,85%															
Mês	Acum.															
0,62%	5,00%															
Mês	Acum.															
0,98%	0,85%															






Evolução do Patrimônio

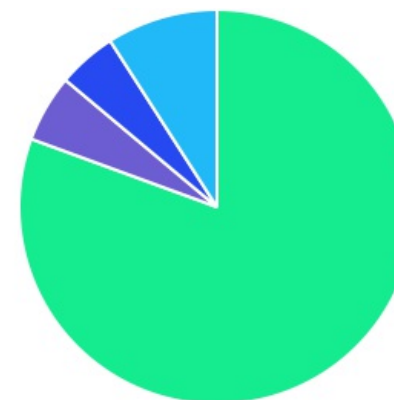








Comparativo (Rentabilidades | Metas)

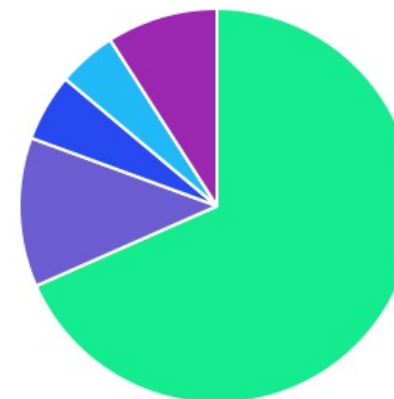




ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	4.963	RETORNO (R\$)	(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	R\$ 2.026.037,33	7.60%	D+0	7, I "b"	R\$ 22.497,05	1,12%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RF	R\$ 4.547.106,00	17.07%	D+0	7, I "b"	R\$ 80.622,42	1,81%
BB IMA-B 5 FIC RF PREVID...	R\$ 2.781.741,06	10.44%	D+1	7, I "b"	R\$ 16.891,46	0,61%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 1.773.892,64	6.66%	D+1	7, I "b"	R\$ 43.404,50	2,17%
BB IMA-B TP FI RF	R\$ 415.526,57	1.56%	D+1	7, I "b"	R\$ 10.435,26	2,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	R\$ 1.542.756,76	5.79%	D+3	7, I "b"	R\$ 28.530,83	1,88%
BB IDKA 2 TP FI RF...	R\$ 5.128.627,75	19.25%	D+1	7, I "b"	R\$ 19.863,19	0,39%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	R\$ 228.839,16	0.86%	D+0	7, III "a"	R\$ 2.603,84	1,15%
CAIXA BRASIL FI RF REF DI...	R\$ 3.030.085,14	11.37%	D+0	7, III "a"	R\$ 35.338,99	1,18%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	R\$ 666.454,21	2.50%	D+3	8, I	R\$ 4.528,75	0,68%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC...	R\$ 804.756,31	3.02%	D+15	8, I	R\$ 46.987,23	6,20%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	R\$ 1.281.246,76	4.81%	D+3	9, III	R\$ 70.294,93	5,80%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	R\$ 1.832.117,44	6.88%	D+3	10, I	R\$ 35.409,70	1,97%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	R\$ 3.940,88	0.01%	D+1	10, I	R\$ 47,18	1,21%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO...	R\$ 581.273,99	2.18%	D+0	10, I	R\$ 7.777,28	1,36%
<b>Total investimentos</b>	<b>R\$ 26.644.402,00</b>	<b>100.00%</b>			<b>R\$ 425.232,61</b>	<b>1,61%</b>
Disponibilidade	R\$ 147.879,07	-			-	-
<b>Total patrimônio</b>	<b>R\$ 26.792.281,07</b>	<b>100.00%</b>			<b>-</b>	<b>-</b>

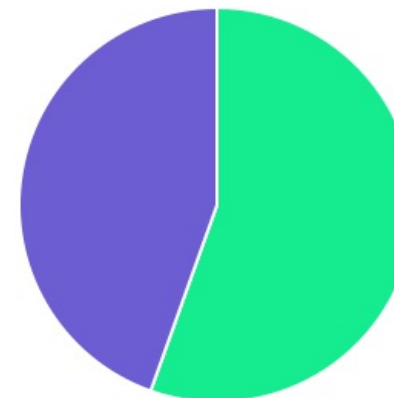
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	80,60%	R\$ 21.474.612,41	
Estruturados	9,07%	R\$ 2.417.332,31	
Renda Variável	5,52%	R\$ 1.471.210,52	
Exterior	4,81%	R\$ 1.281.246,76	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 26.644.402,00</b>	





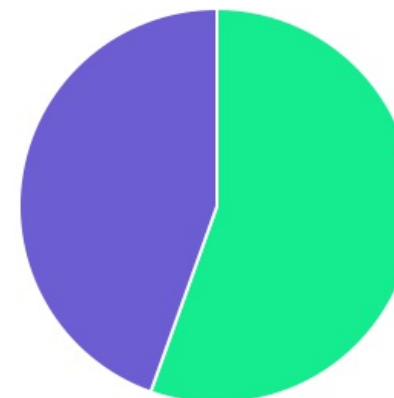
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	68,37%	R\$ 18.215.688,11	
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	12,23%	R\$ 3.258.924,30	
Artigo 10º, Inciso I	9,07%	R\$ 2.417.332,31	
Artigo 8º, Inciso I	5,52%	R\$ 1.471.210,52	
Artigo 9º, Inciso III	4,81%	R\$ 1.281.246,76	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 26.644.402,00</b>	















GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA DISTRIBUIDORA	55,45%	R\$ 14.773.018,06	
BB GESTAO	44,55%	R\$ 11.871.383,94	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 26.644.402,00</b>	



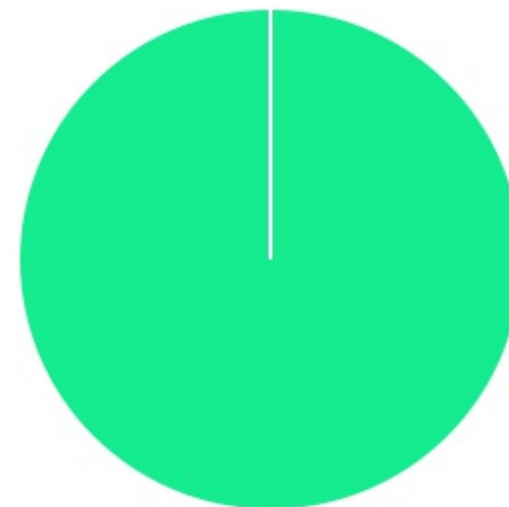
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
CAIXA ECONOMICA	55,45%	R\$ 14.773.018,06	
BB GESTAO	44,55%	R\$ 11.871.383,94	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 26.644.402,00</b>	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IMA Geral ex-C	22,86%	R\$ 6.089.862,76	
IDKA IPCA 2A	19,25%	R\$ 5.128.627,75	
CDI	12,23%	R\$ 3.258.924,30	
IMA-B 5	10,44%	R\$ 2.781.741,06	
125% do CDI	9,06%	R\$ 2.413.391,43	
IRF-M 1	7,60%	R\$ 2.026.037,33	
IRF-M	6,66%	R\$ 1.773.892,64	
GLOBAL BDRX	4,81%	R\$ 1.281.246,76	
IBOVESPA	3,02%	R\$ 804.756,31	
IDIV	2,50%	R\$ 666.454,21	
IMA-B	1,56%	R\$ 415.526,57	
S&P 500	0,01%	R\$ 3.940,88	
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 26.644.402,00</b>	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 26.644.402,00	<span style="color: green;">■</span>
<b>Total</b>	<b>100,00%</b>	<b>R\$ 26.644.402,00</b>	



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\$ 18.215.688,11	68.37%	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\$ 3.258.924,30	12.23%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>R\$ 21.474.612,41</b>	<b>80,60%</b>			
RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
FI Ações - 8, I	30%	R\$ 1.471.210,52	5.52%	0,00%	6,00%	20,00%
FI de Índices Ações - 8, II	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>R\$ 1.471.210,52</b>	<b>5,52%</b>			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
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\$ 1.281.246,76	4.81%	0,00%	5,00%	10,00%
<b>Total Investimentos no Exterior</b>		<b>R\$ 1.281.246,76</b>	<b>4,81%</b>			





FUNDOS ESTRUTURADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Multimercado - aberto - 10, I	10%	R\$ 2.417.332,31	9,07%	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%
<b>Total Fundos Estruturados</b>		<b>R\$ 2.417.332,31</b>	<b>9,07%</b>			
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%
<b>Total Fundos Imobiliários</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
EMPRÉSTIMOS CONSIGNADOS	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Empréstimos Consignados - 12	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total Empréstimos Consignados</b>		<b>R\$ 0,00</b>	<b>0,00%</b>			
<b>Total Global</b>		<b>R\$ 26.644.402,00</b>	<b>100,00%</b>			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
<b>2023</b>			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%
Fevereiro	R\$ 26.126.762,58	R\$ 26.128.144,35	1,23%	R\$ 112.464,73	0,43%	-0,80%
Março	R\$ 26.128.144,35	R\$ 26.347.246,43	1,10%	R\$ 324.457,44	1,25%	0,14%
Abril	R\$ 26.347.246,43	R\$ 26.520.915,07	1,00%	R\$ 251.109,97	0,96%	-0,05%
Maio	R\$ 26.520.915,07	R\$ 26.792.281,07	0,62%	R\$ 425.232,61	1,61%	0,98%
<b>Total</b>	<b>R\$ 26.520.915,07</b>	<b>R\$ 26.792.281,07</b>	<b>5,00%</b>	<b>R\$ 1.491.965,34</b>	<b>5,85%</b>	<b>0,85%</b>
<b>2022</b>			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%
<b>Total</b>	<b>R\$ 25.512.576,75</b>	<b>R\$ 25.939.371,27</b>	<b>10,89%</b>	<b>R\$ 1.868.087,65</b>	<b>7,99%</b>	<b>-2,90%</b>
<b>2021</b>			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%
<b>Total</b>	<b>R\$ 22.851.632,06</b>	<b>R\$ 24.145.746,30</b>	<b>15,72%</b>	<b>R\$ 243.081,82</b>	<b>0,96%</b>	<b>-14,76%</b>

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	1,18%	5,25%	13,49%	-	15,79%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	1,15%	5,29%	13,47%	-	18,19%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	0,39%	5,49%	8,61%	-	15,25%
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	1,81%	6,03%	12,48%	16,41%	17,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP FI...	10.740.670/0001-06	1,12%	5,36%	13,30%	20,29%	20,89%
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	0,61%	5,90%	9,27%	19,12%	21,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP...	14.386.926/0001-71	-	-	-	-	-0,03%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI...	17.502.937/0001-68	5,80%	14,00%	13,81%	-1,23%	-1,72%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	2,17%	7,01%	14,18%	15,70%	16,62%
BB IMA-B TP FI RF	07.442.078/0001-05	2,58%	8,70%	10,27%	14,95%	17,12%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO...	14.120.520/0001-42	1,36%	5,28%	13,45%	-	16,25%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	05.900.798/0001-41	0,68%	-0,08%	-1,88%	-2,84%	0,93%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	03.737.188/0001-43	1,97%	3,29%	9,35%	12,63%	14,76%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	30.036.235/0001-02	1,21%	12,31%	10,60%	16,11%	23,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC...	35.292.588/0001-89	1,88%	6,83%	12,47%	17,91%	19,53%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC...	30.068.169/0001-44	6,20%	3,59%	-1,44%	-	0,59%

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