

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

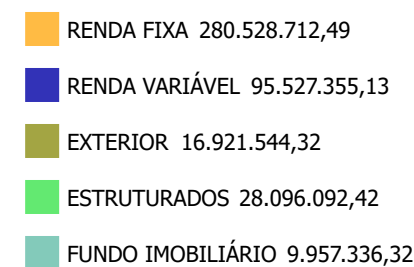
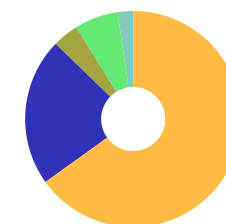
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			37.343.016,94	8,66%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	23.495.684,10	5,45%	977	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	19.294.009,05	4,48%	769	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	14.304.728,80	3,32%	358	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	6.041.874,71	1,40%	801	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	21.508.757,77	4,99%	948	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	158.198,84	0,04%	1.182	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	30.874.738,94	7,16%	294	3,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.005.831,60	12,30%	655	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	10.389.396,62	2,41%	2.552	6,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	11.826.563,96	2,74%	158	1,64%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.877.706,72	1,13%	603	4,99%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	27.875.273,67	6,47%	65	3,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	10.521.634,35	2,44%	198	0,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.553.246,48	0,36%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.315.295,04	0,31%	31	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	3.531.657,92	0,82%	8	18,34%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	2.611.096,98	0,61%	70	3,52%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.730.307,79	1,10%	529	2,29%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	7.120.586,34	1,65%	3.577	0,58%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	9.601.103,61	2,23%	523	6,20%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	14.180.420,16	3,29%	262	5,76%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	14.128.930,89	3,28%	160	5,98%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	10.059.455,89	2,33%	169	17,46%	Artigo 8º, Inciso I
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.401.831,51	1,25%	1.497	0,39%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	11.882.221,75	2,76%	20	2,35%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	16.531.870,19	3,84%	32	1,71%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC...	D+5 du	Não há	7.720.113,12	1,79%	120	1,92%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.479.121,95	0,58%	158	0,19%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	6.722.309,25	1,56%	505	0,34%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	9.490.170,53	2,20%	8.463	0,54%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.603.932,95	1,53%	755	0,56%	Artigo 10º, Inciso I
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.034.190,96	0,47%		0,00%	Artigo 10º, Inciso II
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	9.967.797,98	2,31%	28	8,00%	Artigo 10º, Inciso II
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.216.467,38	1,67%		4,91%	Artigo 11º
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.638.708,94	0,38%		1,80%	Artigo 11º
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.102.160,00	0,26%		0,06%	Artigo 11º
MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11	Não se ...	Não se aplica	1.890.627,00	0,44%		1,43%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			431.031.040,68				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2023)

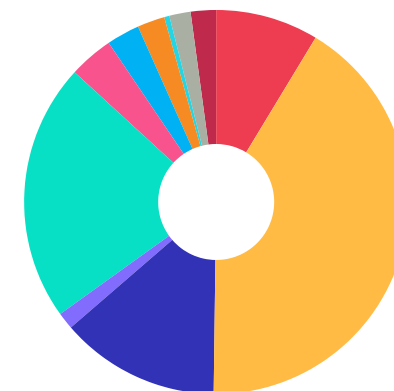
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	37.343.016,94	8,66%	3,85%	11,98%	81,95%	315.886.920,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	179.073.220,43	41,55%	16,55%	18,56%	81,95%	174.156.717,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	57.969.720,22	13,45%	10,00%	20,00%	60,00%	200.648.904,19
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	86.206.208,14
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	6.142.754,90	1,43%	0,00%	0,00%	1,50%	322.710,71
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	21.551.552,03
Total Renda Fixa	100,00%	280.528.712,49	65,08%	30,40%	60,54%	250,40%	



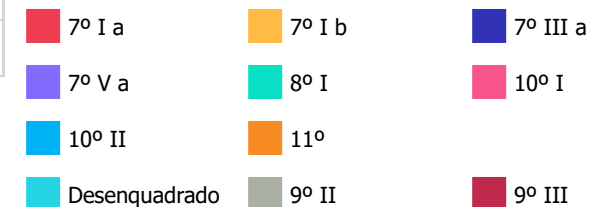
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	35,00%	93.636.728,13	21,72%	10,00%	21,00%	25,00%	14.121.032,04
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	16.094.103,48	3,73%	3,50%	5,00%	10,00%	27.009.000,59
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	12.001.988,94	2,78%	2,29%	3,05%	5,00%	9.549.563,09
Artigo 11º	5,00%	9.957.336,32	2,31%	1,98%	2,64%	5,00%	11.594.215,71
Desenquadrado - RV	0,00%	1.890.627,00	0,44%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.890.627,00
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	133.580.783,87	30,99%	17,77%	31,69%	45,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	7.720.113,12	1,79%	0,00%	1,77%	10,00%	35.382.990,95
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	9.201.431,20	2,13%	0,00%	5,00%	10,00%	33.901.672,87
Total Exterior	10,00%	16.921.544,32	3,93%	0,00%	6,77%	20,00%	





Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	127.801.881,64	29,65	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	59.573.543,90	13,82	-
ITAÚ UNIBANCO	52.720.954,09	12,23	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	37.343.016,94	8,66	-
TRÍGONO CAPITAL	28.414.091,94	6,59	0,60
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	19.990.500,23	4,64	0,18
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	14.180.420,16	3,29	-
META ASSET MANAGEMENT	14.128.930,89	3,28	5,90
GRAPHEN INVESTIMENTOS	13.359.222,28	3,10	2,83
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	11.826.563,96	2,74	0,00
MULTINVEST CAPITAL	10.059.455,89	2,33	1,31
KPTL	9.967.797,98	2,31	2,82
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	7.120.586,34	1,65	0,41
NAVI CAPITAL	5.401.831,51	1,25	0,37
INFINITY ASSET MANAGEMENT	4.877.706,72	1,13	0,71
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	4.730.307,79	1,10	0,16
KINEA INVESTIMENTOS	2.034.190,96	0,47	0,00
CAPITÂNIA INVESTIMENTOS	1.890.627,00	0,44	-
ZION INVEST	1.638.708,94	0,38	-
RJI CORRETORA DE VALORES	1.553.246,48	0,36	0,28
PLURAL	1.315.295,04	0,31	-
HEDGE INVESTMENTS	1.102.160,00	0,26	0,11

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	37.343.016,94	8,66	3,85	81,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	179.073.220,43	41,55	16,55	81,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	57.969.720,22	13,45	10,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	93.636.728,13	21,72	10,00	25,00
Artigo 9º, Inciso II	7.720.113,12	1,79	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	9.201.431,20	2,13	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	16.094.103,48	3,73	3,50	10,00
Artigo 10º, Inciso II	12.001.988,94	2,78	2,29	5,00
Artigo 11º	9.957.336,32	2,31	1,98	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,21%	1,21%	3,57%	5,55%	14,24%	36,18%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	-0,33%	-0,33%	-1,17%	-1,87%	-0,39%	-30,16%	-	0,02%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,44%	1,44%	1,90%	3,99%	10,86%	16,26%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,44%	1,44%	2,00%	4,40%	10,88%	15,84%	1,15%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,41%	1,41%	1,94%	4,22%	10,56%	15,58%	1,19%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,13%	1,13%	3,33%	5,05%	13,18%	33,67%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,44%	0,44%	0,94%	0,91%	3,33%	2,97%	0,79%	0,01%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,10%	1,10%	3,25%	6,75%	12,54%	16,51%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	1,12%	3,23%	6,66%	12,31%	16,01%	0,24%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,40%	1,40%	2,01%	4,40%	11,19%	16,27%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,60%	-4,60%	-4,12%	-19,64%	-23,37%	-39,28%	6,38%	0,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,38%	1,38%	1,93%	4,27%	10,93%	15,65%	1,15%	0,03%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,30%	1,30%	1,87%	4,26%	10,53%	14,50%	1,13%	0,03%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,58%	0,58%	1,27%	2,13%	4,78%	3,38%	0,33%	0,01%
IRF-M (Benchmark)	0,84%	0,84%	1,65%	6,17%	9,82%	8,42%	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	0,88%	1,70%	6,18%	9,76%	8,12%	1,83%	0,02%
CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,12%	3,22%	6,65%	12,79%	18,38%	0,02%	0,00%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,80%	1,80%	4,93%	10,94%	23,69%	39,48%	0,41%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,59%	0,59%	1,91%	4,43%	10,56%	18,86%	1,12%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,03%	1,03%	2,68%	5,77%	12,46%	19,88%	0,23%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	1,50%	3,22%	5,48%	12,98%	18,07%	0,59%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,28%	6,11%	11,10%	11,70%	0,39%	0,01%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	0,57%	0,95%	4,72%	9,11%	9,83%	1,76%	0,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,41%	1,41%	4,18%	6,78%	16,88%	42,56%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,15%	-0,15%	-0,45%	-7,75%	-8,71%	-9,99%	-	0,07%
S&P 500 (Benchmark)	6,18%	6,18%	5,28%	-1,30%	-9,72%	9,76%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	6,49%	6,49%	7,50%	3,38%	-0,97%	24,72%	7,50%	0,24%
Global BDRX (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,06%	-3,63%	-16,72%	-5,42%	-	-
IBX (Benchmark)	3,51%	3,51%	-2,34%	9,39%	0,75%	-1,38%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	4,90%	4,90%	-6,65%	11,74%	-6,11%	-16,49%	13,12%	0,26%
Ibovespa (Benchmark)	3,37%	3,37%	-2,25%	9,95%	1,15%	-1,42%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,94%	3,94%	-3,74%	7,30%	3,49%	8,97%	9,12%	0,17%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	3,82%	3,82%	-2,93%	12,18%	3,03%	-7,67%	9,66%	0,22%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3,41%	3,41%	-2,32%	9,05%	0,67%	10,59%	8,25%	0,18%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,83%	3,83%	-6,87%	3,78%	2,02%	4,15%	8,29%	0,20%
MULTINVEST FI AÇÕES	3,75%	3,75%	-6,15%	0,40%	-8,96%	-18,06%	10,52%	0,21%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,94%	1,94%	-6,92%	8,01%	1,86%	8,00%	9,30%	0,17%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,37%	3,37%	-0,28%	12,21%	12,43%	52,08%	8,41%	0,22%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,23%	5,23%	1,24%	16,73%	22,51%	-	8,80%	0,25%

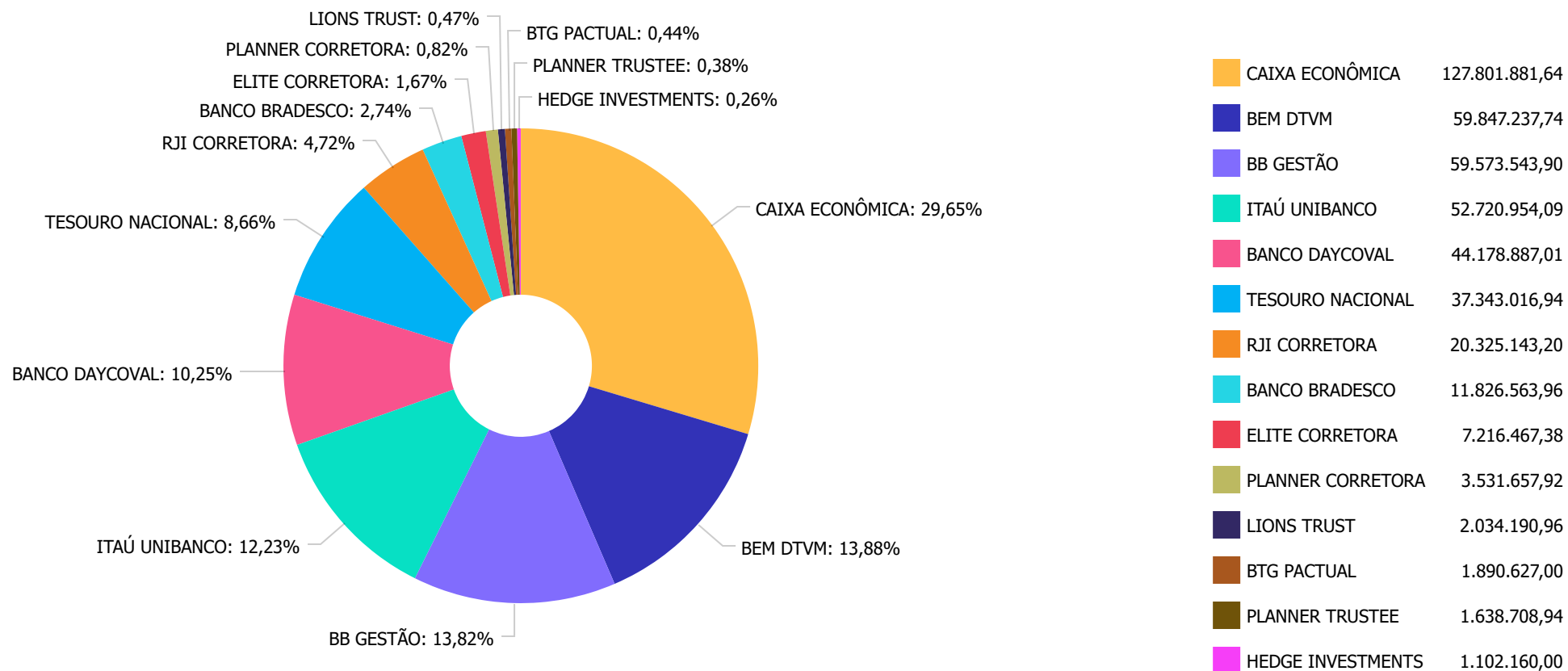
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI ACWI (Benchmark)	4,67%	4,67%	7,25%	-0,08%	-13,97%	-6,09%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,53%	6,53%	7,43%	3,32%	-0,98%	24,62%	7,51%	0,24%
IFIX (Benchmark)	-1,60%	-1,60%	-5,69%	0,25%	1,59%	-2,03%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-5,21%	-5,21%	-0,12%	-0,19%	-0,34%	-3,86%	0,00%	0,00%
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-3,23%	-3,23%	-11,74%	0,93%	10,51%	-14,95%	10,15%	0,24%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-9,93%	-9,93%	-32,98%	-44,66%	22,12%	268,12%	19,96%	0,67%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11	-	-	-	-	-	-	7,29%	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	1,12%	1,12%	-3,85%	-1,09%	-59,13%	-59,32%	-	-

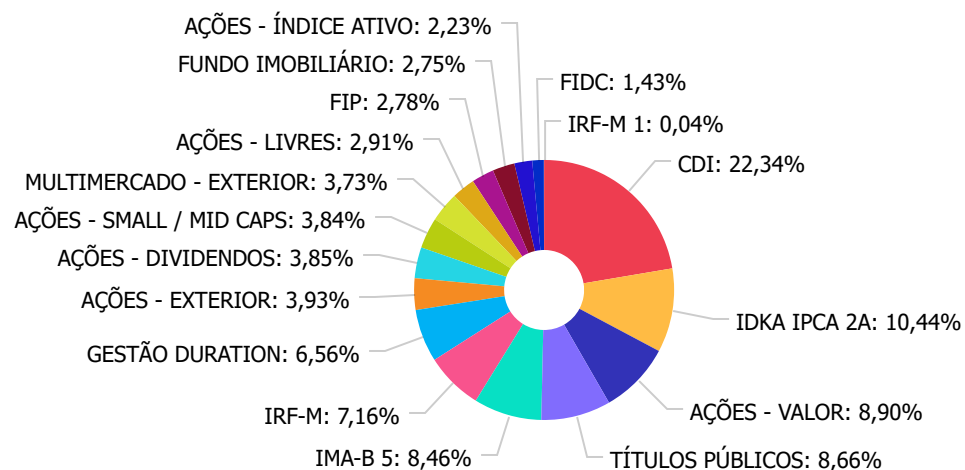
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,06%	-3,63%	-16,72%	-5,42%	-	-
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	1,97%	3,31%	-	-14,68%	-	8,14%	17,82%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	4,32%	6,18%	-	-17,40%	-	8,80%	19,22%
MSCI WORLD (Benchmark)	4,58%	4,58%	6,03%	-0,33%	-13,34%	-2,56%	-	-
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-	2,51%	7,24%	-	-11,05%	-	10,73%	14,81%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2023)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2023)



■ CDI	96.280.446,34	■ IDKA IPCA 2A	45.004.441,87	■ AÇÕES - VALOR	38.368.806,94	■ TÍTULOS PÚBLICOS	37.343.016,94
■ IMA-B 5	36.467.279,37	■ IRF-M	30.874.738,94	■ GESTÃO DURATION	28.257.835,29	■ AÇÕES - EXTERIOR	16.921.544,32
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	16.612.529,54	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	16.531.870,19	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	16.094.103,48	■ AÇÕES - LIVRES	12.522.417,85
■ FIP	12.001.988,94	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	11.847.963,32	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	9.601.103,61	■ FIDC	6.142.754,90
■ IRF-M 1	158.198,84						



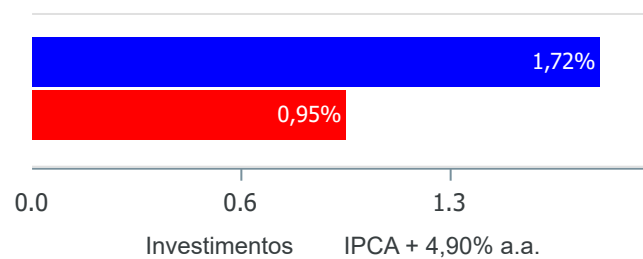
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2023)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	16/12/2022	2.493	4.010,609178	4.109,957865	9.998.448,68	10.246.124,96	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	20/09/2022	2.241	4.014,6620030	4.049,922116	8.996.857,55	9.075.875,46	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/12/2022	2.519	3969,777044	4.049,922116	9.999.868,37	10.201.753,81	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	20/09/2022	1.117	4.028,4691720	3.952,242895	4.499.800,07	4.414.655,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	20/09/2022	872	4.009,3250770	3.904,366285	3.496.131,47	3.404.607,40	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2023

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	425.261.125,84	4.823.416,27	6.359.480,19	431.031.040,68	7.305.978,76	7.305.978,76	1,72%	1,72%	0,95%	0,95%	180,71%	3,86%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	4.791.357,77	0,00	0,00	4.877.706,72	86.348,95	1,80%	1,80%	0,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	14.093.227,30	0,00	0,00	14.304.728,80	211.501,50	1,50%	1,50%	0,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	23.163.010,36	0,00	0,00	23.495.684,10	332.673,74	1,44%	1,44%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	21.209.937,50	0,00	0,00	21.508.757,77	298.820,27	1,41%	1,41%	1,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.032.364,83	0,00	0,00	19.294.009,05	261.644,22	1,37%	1,37%	1,15%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	10.256.135,38	0,00	0,00	10.389.396,62	133.261,24	1,30%	1,30%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	156.444,75	0,00	0,00	158.198,84	1.754,09	1,12%	1,12%	0,24%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	53.841.336,73	4.818.657,66	6.296.872,58	53.005.831,60	642.709,79	1,10%	1,12%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	5.975.185,62	4.758,61	0,00	6.041.874,71	61.930,48	1,04%	1,04%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	10.414.017,99	0,00	0,00	10.521.634,35	107.616,36	1,03%	1,03%	0,23%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	30.605.424,80	0,00	0,00	30.874.738,94	269.314,14	0,88%	0,88%	1,83%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	27.711.823,52	0,00	0,00	27.875.273,67	163.450,15	0,59%	0,59%	1,12%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.544.257,62	0,00	0,00	1.553.246,48	8.988,86	0,58%	0,58%	0,33%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.759.752,00	0,00	0,00	11.826.563,96	66.811,96	0,57%	0,57%	1,76%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	2.599.492,66	0,00	0,00	2.611.096,98	11.604,32	0,45%	-0,35%	0,79%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.370.994,08	0,00	54.221,61	1.315.295,04	-1.477,43	-0,11%	-4,60%	6,38%
TÍTULOS PÚBLICOS	37.404.621,34	0,00	0,00	37.343.016,94	-61.604,40	-0,16%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	3.543.484,91	0,00	0,00	3.531.657,92	-11.826,99	-0,33%	-	-
Total Renda Fixa	279.472.869,16	4.823.416,27	6.351.094,19	280.528.712,49	2.583.521,25	0,92%		0,93%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2023

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	8.908.792,67	0,00	0,00	9.490.170,53	581.377,86	6,53%	6,53%	7,51%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	6.201.638,42	0,00	0,00	6.603.932,95	402.294,53	6,49%	6,49%	7,50%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.291.492,22	0,00	0,00	11.882.221,75	590.729,53	5,23%	5,23%	8,80%
META VALOR FI AÇÕES	13.468.958,56	0,00	0,00	14.128.930,89	659.972,33	4,90%	4,90%	13,12%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.550.814,16	0,00	0,00	4.730.307,79	179.493,63	3,94%	3,94%	9,12%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6.857.949,28	0,00	0,00	7.120.586,34	262.637,06	3,83%	3,83%	8,29%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	9.247.494,10	0,00	0,00	9.601.103,61	353.609,51	3,82%	3,82%	9,66%
MULTINVEST FI AÇÕES	9.696.340,64	0,00	0,00	10.059.455,89	363.115,25	3,74%	3,74%	10,52%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	13.713.020,37	0,00	0,00	14.180.420,16	467.399,79	3,41%	3,41%	8,25%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	15.993.183,93	0,00	0,00	16.531.870,19	538.686,26	3,37%	3,37%	8,41%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.298.916,91	0,00	0,00	5.401.831,51	102.914,60	1,94%	1,94%	9,30%
KINEA PRIVATE EQUITY II FIP MULTIESTRATÉGIA	2.011.592,36	0,00	0,00	2.034.190,96	22.598,60	1,12%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.219.914,96	0,00	0,00	7.216.467,38	-3.447,58	-0,05%	-5,21%	0,00%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	9.983.153,62	0,00	0,00	9.967.797,98	-15.355,64	-0,15%	-	-
HEDGE BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.138.938,60	0,00	8.386,00	1.102.160,00	-28.392,60	-2,49%	-3,23%	10,15%
MULTI SHOPPINGS FII - SHOP11	1.980.697,32	0,00	0,00	1.890.627,00	-90.070,32	-4,55%	-97,39%	7,29%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.819.354,02	0,00	0,00	1.638.708,94	-180.645,08	-9,93%	-8,96%	19,96%
Total Renda Variável	129.382.252,14	0,00	8.386,00	133.580.783,87	4.206.917,73	3,25%		8,84%



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Janeiro / 2023)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.444.091,76	0,00	0,00	6.722.309,25	278.217,49	4,32%	4,32%	8,80%
ITAÚ WORLD EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC A...	7.530.721,07	0,00	0,00	7.720.113,12	189.392,05	2,51%	2,51%	10,73%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.431.191,71	0,00	0,00	2.479.121,95	47.930,24	1,97%	1,97%	8,14%
Total Exterior	16.406.004,54	0,00	0,00	16.921.544,32	515.539,78	3,14%		9,58%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

