

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2023

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	971.802,59	3,96%	977	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.143.975,71	4,66%	769	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	6.904,70	0,03%	1.116	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	262.240,62	1,07%	327	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.414.452,63	9,84%	801	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.207.028,20	4,92%	948	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	858.350,01	3,50%	928	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.394.463,51	5,68%	732	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.317.894,15	5,37%	1.182	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.228.829,62	5,01%	158	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	227.238,22	0,93%	219	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASILEIRA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.214.876,84	9,02%	125	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	858.136,82	3,50%	318	0,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITÁU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.148.027,94	4,68%	229	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITÁU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.647.109,30	6,71%	198	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	563.179,81	2,29%	64	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIX...	D+1	Não há	414.800,35	1,69%	211	0,02%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	259.735,97	1,06%	1.351	0,09%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	401.313,08	1,63%	25.055	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.331.303,06	5,42%	1.262	0,20%	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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	682.867,85	2,78%	193	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	376.854,81	1,54%	2.603	0,16%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	290.920,76	1,19%	3.577	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	347.513,58	1,42%	20.840	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	161.355,64	0,66%	9.205	0,05%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	136.347,51	0,56%	13.502	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	69.532,07	0,28%	71	0,06%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	204.727,78	0,83%	505	0,01%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3	Não há	191.088,34	0,78%	2.546	0,16%	Artigo 9º, Inciso III
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	D+1 du	Não há	332.846,63	1,36%	29.805	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	51.504,47	0,21%	630	0,03%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	231.833,82	0,94%	6.883	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	388.821,16	1,58%	8.463	0,02%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	238.491,84	0,97%	3.342	0,01%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	491.741,64	2,00%	6.884	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	481.338,36	1,96%	755	0,04%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			24.549.449,39				

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	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2023** não está cadastrada !!!

ⓘ 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 - Nível 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	14.701.322,96	59,88	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.660.343,59	10,84	-
ITAU UNIBANCO	2.480.891,64	10,11	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.682.712,79	6,85	0,00
ITAU ASSET MANAGEMENT	1.148.027,94	4,68	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	977.980,16	3,98	0,00
ITAU DTVM	347.513,58	1,42	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	290.920,76	1,19	0,02
SOMMA INVESTIMENTOS	259.735,97	1,06	-

Artigo 20º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR) - (Resolução 4963)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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
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%

IRF-M 1 (Benchmark)	1,10%	1,10%	3,25%	6,75%	12,54%	16,51%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	1,06%	3,16%	6,58%	12,22%	15,86%	0,26%	0,01%
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%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	1,38%	1,95%	4,36%	11,08%	15,87%	1,14%	0,03%
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%

IMA-B (Benchmark)	0,00%	0,00%	-0,99%	2,84%	7,15%	5,93%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,03%	-0,03%	-1,10%	2,78%	6,97%	5,46%	2,95%	0,04%

CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,10%	1,10%	3,24%	6,58%	12,55%	17,82%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,96%	0,96%	2,84%	5,78%	10,97%	15,22%	0,00%	0,00%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	-0,08%	-0,08%	2,19%	5,84%	12,52%	20,04%	1,23%	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%

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 (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,33%	1,33%	1,95%	4,86%	11,12%	14,00%	1,09%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,50%	0,50%	-0,90%	2,12%	7,81%	13,13%	2,23%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,28%	6,11%	11,10%	11,70%	0,39%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,93%	0,93%	2,05%	5,07%	9,94%	13,83%	0,69%	0,01%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	0,57%	0,95%	4,72%	9,11%	9,83%	1,76%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,98%	0,98%	1,99%	5,93%	10,96%	12,55%	0,58%	0,02%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,10%	0,10%	2,44%	6,37%	13,03%	21,17%	0,99%	0,01%

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 USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,95%	3,95%	2,07%	-3,32%	-15,33%	-1,85%	-	-
S&P 500 (Benchmark)	6,18%	6,18%	5,28%	-1,30%	-9,72%	9,76%	-	-
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	6,42%	6,42%	7,25%	2,91%	-1,85%	22,56%	7,53%	0,24%
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%	-	-
IDIV (Benchmark)	5,89%	5,89%	5,00%	11,84%	10,99%	17,61%	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,69%	5,69%	4,72%	11,13%	9,82%	13,80%	8,82%	0,17%
Ibovespa (Benchmark)	3,37%	3,37%	-2,25%	9,95%	1,15%	-1,42%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4,46%	4,46%	-2,30%	7,42%	-2,65%	2,26%	10,20%	0,20%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3,83%	3,83%	-6,87%	3,78%	2,02%	4,15%	8,29%	0,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,42%	2,42%	-4,62%	11,26%	6,28%	0,01%	10,29%	0,23%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,52%	3,52%	-8,11%	5,22%	-3,84%	-11,80%	9,75%	0,22%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,30%	3,30%	-3,17%	5,45%	4,39%	15,93%	9,08%	0,18%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	3,84%	3,84%	-9,37%	2,09%	-5,66%	-18,58%	10,90%	0,22%
CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-

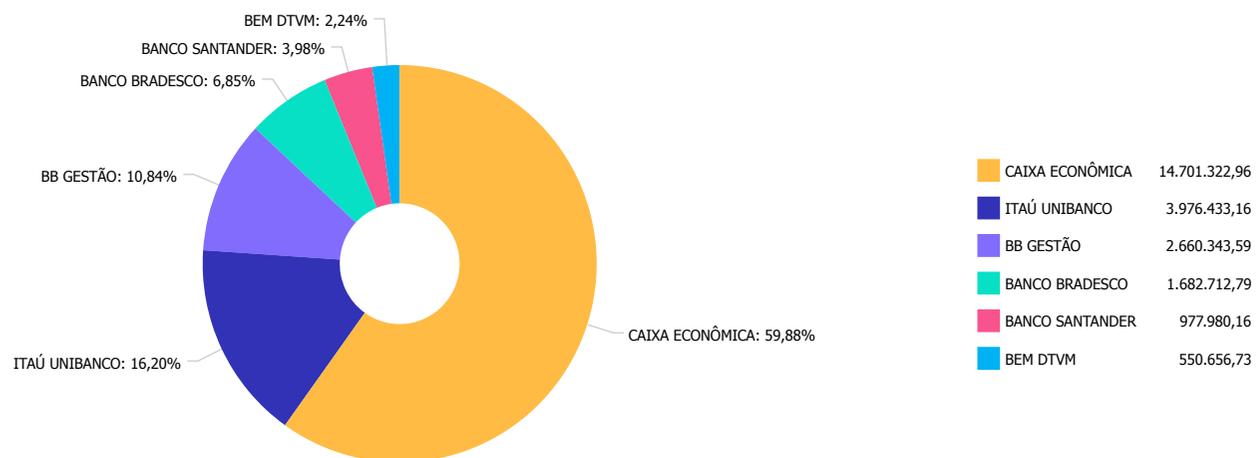
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1,10%	1,10%	3,03%	6,80%	13,52%	19,21%	0,40%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,72%	1,72%	0,97%	8,54%	10,99%	13,67%	3,09%	0,06%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,21%	1,21%	1,01%	6,67%	10,87%	14,01%	2,93%	0,04%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	6,45%	6,45%	7,32%	3,07%	-1,55%	23,33%	7,53%	0,24%
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%

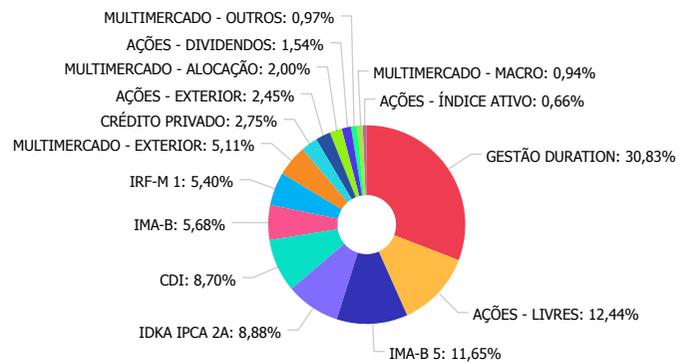
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,95%	3,95%	2,07%	-3,32%	-15,33%	-1,85%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	4,32%	6,18%	-	-17,40%	-	8,80%	19,22%
Global BDRX (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,06%	-3,63%	-16,72%	-5,42%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	1,79%	2,08%	-	-15,19%	-	8,22%	17,17%

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



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



■ GESTÃO DURATION	7.569.366,84	■ AÇÕES - LIVRES	3.053.918,33	■ IMA-B 5	2.860.462,54	■ IDKA IPCA 2A	2.178.830,79
■ CDI	2.136.588,14	■ IMA-B	1.394.463,51	■ IRF-M 1	1.324.798,85	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.254.510,62
■ CRÉDITO PRIVADO	674.536,32	■ AÇÕES - EXTERIOR	601.695,70	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	491.741,64	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	376.854,81
■ MULTIMERCADO - OUTROS	238.491,84	■ MULTIMERCADO - MACRO	231.833,82	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	161.355,64		

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
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ ATENÇÃO! Meta de Rentabilidade de **2023** não está cadastrada !!!

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	958.042,91	0,00	0,00	971.802,59	13.759,68	1,44%	1,44%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.190.259,01	0,00	0,00	1.207.028,20	16.769,19	1,41%	1,41%	1,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	846.709,50	0,00	0,00	858.350,01	11.640,51	1,37%	1,37%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.128.462,36	0,00	0,00	1.143.975,71	15.513,35	1,37%	1,37%	1,15%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	846.887,57	0,00	0,00	858.136,82	11.249,25	1,33%	1,33%	1,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.303.281,49	0,00	0,00	1.317.894,15	14.612,66	1,12%	1,12%	0,24%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	224.758,88	0,00	0,00	227.238,22	2.479,34	1,10%	1,10%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	6.832,49	0,00	0,00	6.904,70	72,21	1,06%	1,06%	0,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.389.698,98	0,00	0,00	2.414.452,63	24.753,65	1,04%	1,04%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.630.262,50	0,00	0,00	1.647.109,30	16.846,80	1,03%	1,03%	0,23%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	2.193.301,04	0,00	0,00	2.214.876,84	21.575,80	0,98%	0,98%	0,58%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	557.965,98	0,00	0,00	563.179,81	5.213,83	0,93%	0,93%	0,69%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	236.496,73	34.281,56	10.807,71	262.240,62	2.270,04	0,84%	0,96%	0,00%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.221.887,57	0,00	0,00	1.228.829,62	6.942,05	0,57%	0,57%	1,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.142.294,59	0,00	0,00	1.148.027,94	5.733,35	0,50%	0,50%	2,23%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	259.476,34	0,00	0,00	259.735,97	259,63	0,10%	0,10%	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.394.921,76	0,00	0,00	1.394.463,51	-458,25	-0,03%	-0,03%	2,95%
SANTANDER CRESCIMENTO INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA ...	415.135,99	0,00	0,00	414.800,35	-335,64	-0,08%	-0,08%	1,23%
Total Renda Fixa	17.946.675,69	34.281,56	10.807,71	18.139.046,99	168.897,45	0,94%		1,03%

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	365.001,56	0,00	0,00	388.821,16	23.819,60	6,53%	6,53%	7,51%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	452.016,47	0,00	0,00	481.338,36	29.321,89	6,49%	6,49%	7,50%
BRADESCO BOLSA FIC MULTIMERCADO	312.677,83	0,00	0,00	332.846,63	20.168,80	6,45%	6,45%	7,53%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	48.395,69	0,00	0,00	51.504,47	3.108,78	6,42%	6,42%	7,53%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	356.581,63	0,00	0,00	376.854,81	20.273,18	5,69%	5,69%	8,82%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	384.187,72	0,00	0,00	401.313,08	17.125,36	4,46%	4,46%	10,20%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	155.388,62	0,00	0,00	161.355,64	5.967,02	3,84%	3,84%	10,90%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	280.190,38	0,00	0,00	290.920,76	10.730,38	3,83%	3,83%	8,29%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.286.101,40	0,00	0,00	1.331.303,06	45.201,66	3,51%	3,51%	9,75%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	661.027,49	0,00	0,00	682.867,85	21.840,36	3,30%	3,30%	9,08%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	339.310,64	0,00	0,00	347.513,58	8.202,94	2,42%	2,42%	10,29%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	483.432,27	0,00	0,00	491.741,64	8.309,37	1,72%	1,72%	3,09%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	229.073,48	0,00	0,00	231.833,82	2.760,34	1,21%	1,21%	2,93%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	159.431,52	76.936,18	0,00	238.491,84	2.124,14	0,90%	1,10%	0,40%
Total Renda Variável	5.512.816,70	76.936,18	0,00	5.808.706,70	218.953,82	3,92%		7,93%

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	196.254,68	0,00	0,00	204.727,78	8.473,10	4,32%	4,32%	8,80%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	133.828,92	0,00	0,00	136.347,51	2.518,59	1,88%	1,88%	8,14%
BRADESCO INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	68.311,83	0,00	0,00	69.532,07	1.220,24	1,79%	1,79%	8,22%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	190.975,66	0,00	0,00	191.088,34	112,68	0,06%	0,06%	7,27%
Total Exterior	589.371,09	0,00	0,00	601.695,70	12.324,61	2,09%		8,10%

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.

