

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.



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.162.848,58	1,17%	692	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	14.240.811,18	14,32%	977	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	741.483,35	0,75%	1.116	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	10.278.038,50	10,34%	287	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.198.497,18	7,24%	272	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	2027-05-16	5.166.052,57	5,20%	71	1,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.414.328,88	3,43%	327	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	7.989.436,66	8,04%	801	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	14.783.694,73	14,87%	948	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.124.893,29	7,17%	1.182	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.199.335,30	6,24%	655	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	70.336,19	0,07%	907	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.180.523,72	1,19%	1.070	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.354.256,41	2,37%	158	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	186.328,32	0,19%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	157.783,53	0,16%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	Não pos...	Não há	1.141.826,89	1,15%	8	5,93%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	959.032,47	0,96%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	754.028,16	0,76%	70	1,02%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	349.009,13	0,35%	642	0,09%	Artigo 8º, Inciso I



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

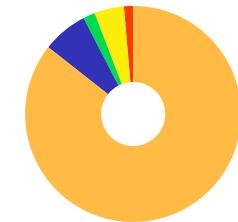
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.626.925,02	1,64%	193	0,26%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.569.849,47	2,58%	42.981	0,64%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	2.220.807,07	2,23%	32	0,23%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	887.115,10	0,89%	13.502	0,13%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	871.889,29	0,88%	505	0,04%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA alocação MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.225.030,10	1,23%	6.883	0,07%	Artigo 10º, Inciso I
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	16.603,66	0,02%	12	1,16%	Artigo 10º, Inciso I
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	923.232,05	0,93%	14	0,62%	Artigo 10º, Inciso I
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.251.777,76	2,26%	28	1,81%	Artigo 10º, Inciso II
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	262.191,50	0,26%		0,29%	Artigo 11º
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.110.795,06	1,12%		1,48%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		0,01	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			99.418.761,12				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			0,01				Artigo 6º
			PL Total	99.418.761,13			



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	19.883.752,22
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	78.299.420,22	78,76%	15,00%	69,00%	90,00%	11.177.464,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.941.876,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	3.949.228,17	3,97%	4,00%	7,00%	60,00%	55.702.028,50
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	19.883.752,22
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	2.854.887,52	2,87%	0,00%	3,00%	5,00%	2.116.050,54
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	4.970.938,06
Total Renda Fixa	100,00%	85.103.535,91	85,60%	19,00%	82,50%	210,00%	



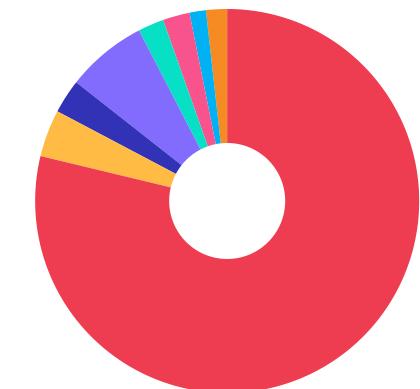
- █ RENDA FIXA 85.103.535,91
- █ RENDA VARIÁVEL 6.766.590,69
- █ EXTERIOR 1.759.004,39
- █ ESTRUTURADOS 4.416.643,57
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 1.372.986,56



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	6.766.590,69	6,81%	0,00%	9,00%	30,00%	23.059.037,65
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	2.164.865,81	2,18%	0,00%	3,00%	10,00%	7.777.010,30
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	2.251.777,76	2,26%	0,00%	2,50%	5,00%	2.719.160,30
Artigo 11º	5,00%	1.372.986,56	1,38%	0,00%	1,50%	5,00%	3.597.951,50
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	12.556.220,82	12,63%	0,00%	16,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.759.004,39	1,77%	0,00%	1,50%	10,00%	8.182.871,72
Total Exterior	10,00%	1.759.004,39	1,77%	0,00%	1,50%	10,00%	





**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	65.878.121,52	66,26	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.632.127,25	18,74	-
TRÍGONO CAPITAL	4.790.656,54	4,82	0,10
GRAPHEN INVESTIMENTOS	3.982.286,24	4,01	0,84
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.354.256,41	2,37	0,00
KPTL	2.251.777,76	2,26	0,64
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	923.232,05	0,93	-
ZION INVEST	262.191,50	0,26	-
RJI CORRETORA DE VALORES	186.328,32	0,19	0,03
PLURAL	157.783,53	0,16	-

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 %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	78.299.420,22	78,76	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	3.949.228,17	3,97	4,00	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	2.854.887,52	2,87	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	6.766.590,69	6,81	5,00	30,00
Artigo 9º, Inciso III	1.759.004,39	1,77	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	2.164.865,81	2,18	1,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	2.251.777,76	2,26	0,00	5,00
Artigo 11º	1.372.986,56	1,38	0,00	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

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%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,19%	-0,19%	-0,21%	-6,55%	-7,36%	-20,53%	0,08%	0,03%
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%	-	-
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 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,39%	1,39%	2,20%	1,37%	4,62%	2,47%	0,93%	0,05%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,19%	1,19%	-1,85%	0,58%	-	-	2,04%	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,58%	0,58%	1,27%	2,13%	4,78%	3,38%	0,33%	0,01%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,60%	-4,60%	-4,12%	-19,64%	-23,37%	-39,28%	6,38%	0,15%



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI - SISPREV

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2023

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
CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,03%	1,03%	3,03%	6,18%	11,68%	15,99%	0,01%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12%	1,12%	3,30%	6,77%	12,97%	18,92%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,12%	3,22%	6,65%	12,79%	18,38%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,96%	0,96%	2,84%	5,78%	10,97%	15,22%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,30%	4,80%	9,80%	11,12%	1,44%	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 GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,28%	6,11%	11,10%	11,70%	0,39%	0,01%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,50%	1,50%	0,10%	2,28%	-	-	0,59%	-



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,21%	1,21%	1,01%	6,67%	10,87%	14,01%	2,93%	0,04%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,36%	-0,36%	-3,27%	-4,26%	-7,22%	-11,73%	0,00%	0,02%
Global BDRX (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,06%	-3,63%	-16,72%	-5,42%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	3,37%	3,37%	-2,25%	9,95%	1,15%	-1,42%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,33%	3,33%	-1,67%	7,27%	0,34%	-3,51%	9,58%	0,20%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	3,30%	3,30%	-3,17%	5,45%	4,39%	15,93%	9,08%	0,18%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,37%	3,37%	-0,28%	12,21%	12,43%	52,08%	8,41%	0,22%
IDIV (Benchmark)	5,89%	5,89%	5,00%	11,84%	10,99%	17,61%	-	-
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	5,21%	5,21%	1,18%	15,88%	21,04%	74,36%	8,82%	0,24%
IFIX (Benchmark)	-1,60%	-1,60%	-5,69%	0,25%	1,59%	-2,03%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-9,93%	-9,93%	-32,98%	-44,66%	22,12%	268,12%	19,96%	0,67%
HAZ FII - ATCR11	-0,14%	-0,14%	0,16%	0,13%	3,31%	4,44%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-14,20%	-14,20%	-14,65%	-15,38%	-15,19%	-18,42%	22,49%	0,14%



CRÉDITO
& MERCADO

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%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,95%	3,95%	2,07%	-3,32%	-15,33%	-1,85%	-	-



**CRÉDITO
& MERCADO**

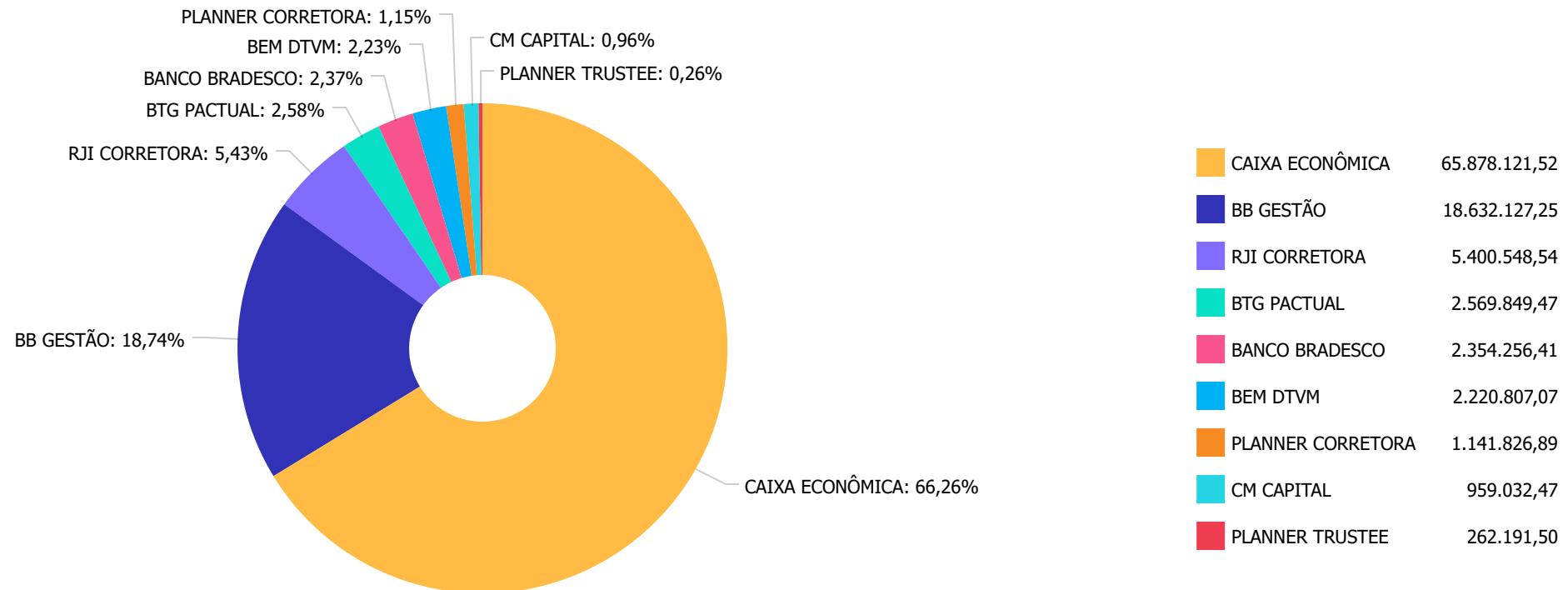
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-	1,88%	3,05%	-	-15,53%	-	8,14%	0,18%
Global BDRX (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,06%	-3,63%	-16,72%	-5,42%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	4,32%	6,18%	-	-17,40%	-	8,80%	0,19%



CRÉDITO
& MERCADO

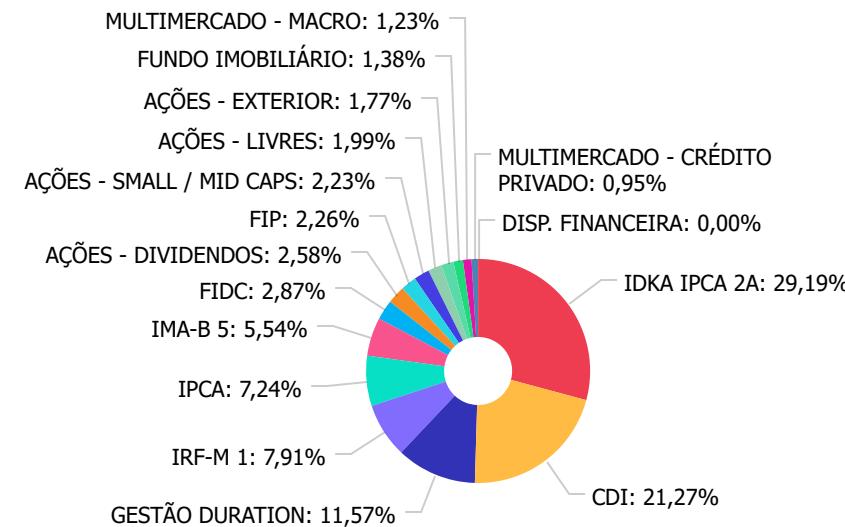
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2023)





**CRÉDITO
& MERCADO**

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



IDKA IPCA 2A	29.024.505,91	CDI	21.142.562,59	GESTÃO DURATION	11.506.541,65
IRF-M 1	7.866.376,64	IPCA	7.198.497,18	IMA-B 5	5.510.164,42
FIDC	2.854.887,52	AÇÕES - DIVIDENDOS	2.569.849,47	FIP	2.251.777,76
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	2.220.807,07	AÇÕES - LIVRES	1.975.934,15	AÇÕES - EXTERIOR	1.759.004,39
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.372.986,56	MULTIMERCADO - MACRO	1.225.030,10	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	939.835,71
DISP. FINANCEIRA	0,01				

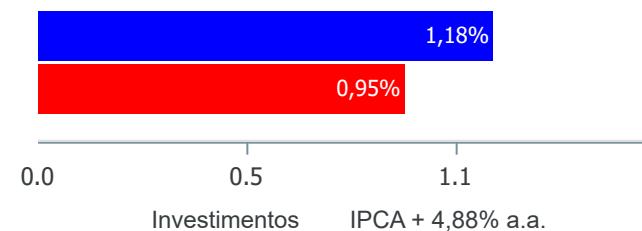


CRÉDITO
& MERCADO

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	97.086.530,51	2.605.686,61	1.434.352,47	99.418.761,12	1.160.896,47	1.160.896,47	1,18%	1,18%	0,95%	0,95%	124,49%	1,83%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





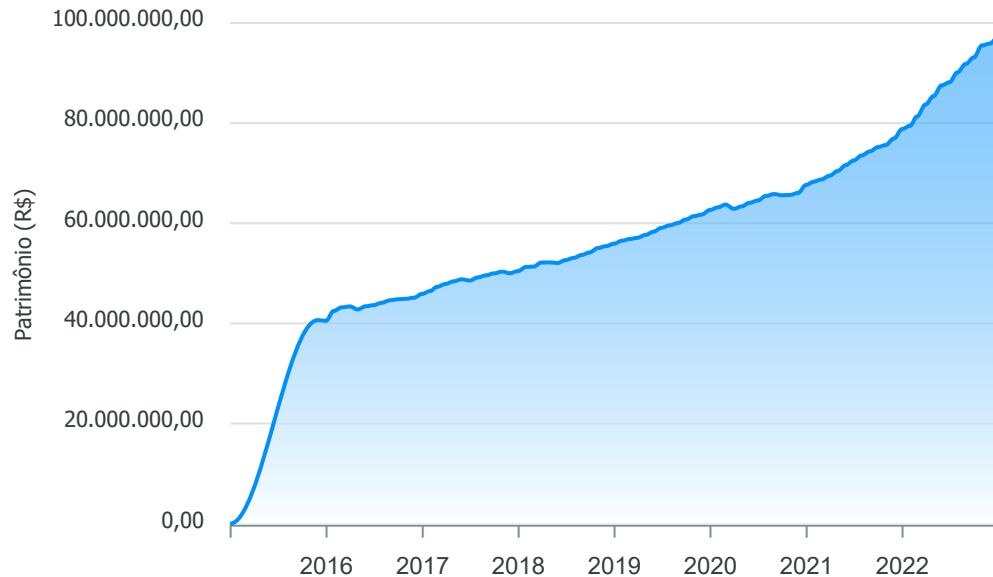
CRÉDITO
& MERCADO

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



**CRÉDITO
& MERCADO**

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE BRODOWSKI - SISPREV

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/01/2023

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
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.126.461,13	0,00	0,00	10.278.038,50	151.577,37	1,50%	1,50%	0,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.039.176,54	0,00	0,00	14.240.811,18	201.634,64	1,44%	1,44%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	14.083.713,63	497.436,37	0,00	14.783.694,73	202.544,73	1,39%	1,41%	1,19%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.100.004,69	0,00	0,00	7.198.497,18	98.492,49	1,39%	1,39%	0,93%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.105.280,95	0,00	0,00	5.166.052,57	60.771,62	1,19%	1,19%	2,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.167.404,65	0,00	0,00	1.180.523,72	13.119,07	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.045.893,33	0,00	0,00	7.124.893,29	78.999,96	1,12%	1,12%	0,24%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.130.878,14	0,00	0,00	6.199.335,30	68.457,16	1,12%	1,12%	0,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	733.728,07	0,00	0,00	741.483,35	7.755,28	1,06%	1,06%	0,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.907.526,75	0,00	0,00	7.989.436,66	81.909,91	1,04%	1,04%	0,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	64.604,26	5.023,92	0,00	70.336,19	708,01	1,02%	1,03%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.155.365,79	0,00	0,00	1.162.848,58	7.482,79	0,65%	0,65%	1,44%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	2.706.473,74	2.103.226,32	1.424.727,69	3.414.328,88	29.356,51	0,61%	0,96%	0,00%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	185.250,01	0,00	0,00	186.328,32	1.078,31	0,58%	0,58%	0,33%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.340.956,48	0,00	0,00	2.354.256,41	13.299,93	0,57%	0,57%	1,76%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	750.722,69	0,00	0,00	754.028,16	3.305,47	0,44%	-0,35%	0,79%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	164.465,22	0,00	6.504,45	157.783,53	-177,24	-0,11%	-4,60%	6,38%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	960.873,29	0,00	0,00	959.032,47	-1.840,82	-0,19%	-0,19%	0,08%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR 1	1.145.650,70	0,00	0,00	1.141.826,89	-3.823,81	-0,33%	-	-
Total Renda Fixa	82.914.430,06	2.605.686,61	1.431.232,14	85.103.535,91	1.014.651,38	1,21%		0,83%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TRÍGONO DELPHOS INCOME FIC AÇÕES	2.442.607,02	0,00	0,00	2.569.849,47	127.242,45	5,21%	5,21%	8,82%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕE...	2.148.442,71	0,00	0,00	2.220.807,07	72.364,36	3,37%	3,37%	8,41%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	337.773,65	0,00	0,00	349.009,13	11.235,48	3,33%	3,33%	9,58%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.574.890,60	0,00	0,00	1.626.925,02	52.034,42	3,30%	3,30%	9,08%
HAZ FII - ATCR11	1.112.363,14	0,00	3.120,33	1.110.795,06	1.552,25	0,14%	-0,14%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	291.094,50	0,00	0,00	262.191,50	-28.903,00	-9,93%	-8,96%	19,96%
Total Renda Variável	7.907.171,62	0,00	3.120,33	8.139.577,25	235.525,96	2,98%		9,20%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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	835.804,24	0,00	0,00	871.889,29	36.085,05	4,32%	4,32%	8,80%
BB AÇÕES ESG GLOBAIS IS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	870.728,42	0,00	0,00	887.115,10	16.386,68	1,88%	1,88%	8,14%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.210.444,19	0,00	0,00	1.225.030,10	14.585,91	1,21%	1,21%	2,93%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.255.246,68	0,00	0,00	2.251.777,76	-3.468,92	-0,15%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	16.663,44	0,00	0,00	16.603,66	-59,78	-0,36%	-0,36%	0,00%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.076.041,86	0,00	0,00	923.232,05	-152.809,81	-14,20%	-14,20%	22,49%
Total Exterior	6.264.928,83	0,00	0,00	6.175.647,96	-89.280,87	-1,43%		10,00%



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.

