

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2023

Este relatório atende a Portaria MTP N° 1.467, de 2 de junho de 2022.



Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria n° 23.500/2021

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	6.037.708,82	2,65%	692	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.616.904,65	2,03%	769	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	167.191,49	0,07%	1.116	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	32.002.281,29	14,06%	358	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	251.513,48	0,11%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	13.082.599,25	5,75%	287	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	21.362.192,90	9,39%	801	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	413.082,48	0,18%	928	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	645.279,28	0,28%	126	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	291.472,42	0,13%	212	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	579.306,63	0,25%	150	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	40.154.740,82	17,64%	316	0,49%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	8.881.527,19	3,90%	560	1,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA	D+0	Não há	24.399.027,87	10,72%	2.603	5,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	969.193,35	0,43%	1.324	0,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	14.048.686,89	6,17%	472	0,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	431.408,30	0,19%	64	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	3.249.220,22	1,43%	7.317	0,29%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	615.448,82	0,27%	529	0,30%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	730.490,00	0,32%	8.400	0,26%	Artigo 8º, Inciso I

Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.599/2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

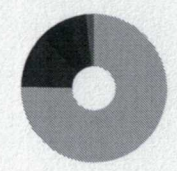
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRASESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	991.104,33	0,44%	613	0,11%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	8.845.445,65	3,89%	125	1,31%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	5.550.403,22	2,44%	41	0,52%	Artigo 8º, Inciso I
MAG FI AÇÕES	D+3	Não há	4.786.079,74	2,09%	32	11,04%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.901.847,02	0,84%	160	0,80%	Artigo 8º, Inciso I
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	229.805,71	0,10%	1.706	0,02%	Artigo 8º, Inciso I
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	D+4	Não há	650.417,59	0,29%	1.448	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.787.413,43	1,22%	49	0,22%	Artigo 8º, Inciso I
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	D+7	Não há	974.172,84	0,43%	53	0,72%	Artigo 8º, Inciso I
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	D+4 du	Não há	3.395.172,43	1,49%	88	3,40%	Artigo 9º, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIME...	D+5	Não há	3.551.575,74	1,56%	7.719	0,60%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	6.134.717,87	2,70%	7.065	0,64%	Artigo 9º, Inciso II
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	485.288,92	0,21%	501	0,05%	Artigo 9º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.495.316,71	4,61%	27.728	1,13%	Artigo 10º, Inciso I
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	15.382,18	0,01%	111	0,61%	Artigo 10º, Inciso II
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	3.906.094,83	1,72%		6,45%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			227.589.514,36				



Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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%	8,00%	30,00%	68.276.854,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	78.578.753,64	34,53%	15,00%	22,00%	70,00%	80.733.906,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	22.758.951,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	89.323.955,17	39,25%	20,00%	30,00%	60,00%	47.229.753,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	34.138.427,15
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	45.517.902,87
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.379.475,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	3.249.220,22	1,43%	3,00%	5,00%	5,00%	8.130.255,50
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	11.379.475,72
Total Renda Fixa	100,00%	171.151.929,03	75,20%	38,00%	66,00%	220,00%	



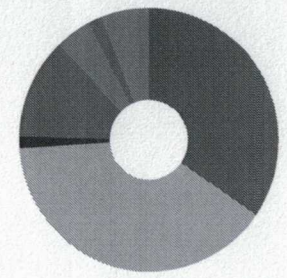
- RENDA FIXA 171.151.929,03
- RENDA VARIÁVEL 28.022.628,35
- EXTERIOR 13.566.754,96
- ESTRUTURADOS 10.510.698,89
- FUNDO IMOBILIÁRIO 3.906.094,83

Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.600/2021

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%	28.022.628,35	12,31%	0,00%	14,00%	30,00%	40.254.225,96
Artigo 8º, Inciso II	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	22.758.951,44
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	10.495.316,71	4,61%	5,00%	7,00%	10,00%	12.263.634,73
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	15.382,18	0,01%	0,01%	3,00%	5,00%	11.364.093,54
Artigo 10º, Inciso III	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	4.551.790,29
Artigo 11º	5,00%	3.906.094,83	1,72%	0,01%	1,00%	5,00%	7.473.380,89
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	42.439.422,07	18,65%	5,02%	25,00%	62,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	2.275.895,14
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	13.081.466,04	5,75%	4,49%	5,99%	10,00%	9.677.485,40
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	485.288,92	0,21%	0,10%	2,01%	10,00%	22.273.662,52
Total Exterior	10,00%	13.566.754,96	5,96%	4,59%	8,00%	21,00%	



- 7º I b 7º III a 7º V b 8º I
- 10º I 10º II 11º 9º II
- 9º III

Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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	30,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	78.578.753,64	34,53	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	88.354.761,82	38,82	20,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	3.249.220,22	1,43	3,00	5,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	28.022.628,35	12,31	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 9º, Inciso II	13.081.466,04	5,75	4,49	10,00
Artigo 9º, Inciso III	485.288,92	0,21	0,10	10,00
Artigo 10º, Inciso I	10.495.316,71	4,61	5,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	15.382,18	0,01	0,01	5,00
Artigo 10º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 11º	3.906.094,83	1,72	0,01	5,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00


Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	43.703.320,28	19,20	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.367.072,15	19,05	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	41.725.151,78	18,33	0,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	36.778.693,61	16,16	0,32
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	21.910.509,93	9,63	0,00
WESTERN ASSET	10.495.316,71	4,61	0,02
ICATU VANGUARDA	8.881.527,19	3,90	0,02
GUEPARDO INVESTIMENTOS	5.550.403,22	2,44	0,17
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.906.094,83	1,72	-
XP ASSET MANAGEMENT	3.551.575,74	1,56	-
TARPON INVESTIMENTOS	2.767.413,43	1,22	0,04
META ASSET MANAGEMENT	1.901.847,02	0,84	0,79
VINCI PARTNERS	974.172,84	0,43	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	730.490,00	0,32	0,00
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	615.448,82	0,27	0,02
SAFRA WEALTH DISTRIBUIDORA DE ...	485.288,92	0,21	-
OCCAM BRASIL	229.805,71	0,10	0,00
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.382,18	0,01	0,00

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)

Rodolfo
Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
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%	0,53%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,40%	1,40%	2,01%	4,40%	11,19%	16,27%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	3,26%	6,67%	14,66%	22,60%	0,00%	1,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,38%	1,38%	1,93%	4,27%	10,93%	15,65%	1,15%	3,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	1,36%	1,36%	1,93%	4,22%	10,70%	14,87%	1,14%	2,96%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	1,38%	1,38%	1,96%	4,30%	10,97%	15,81%	1,14%	3,00%
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%	2,97%

IMA-B (Benchmark)	0,00%	0,00%	-0,99%	2,84%	7,15%	5,93%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,05%	-0,05%	-1,04%	2,65%	6,82%	5,35%	2,93%	3,90%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,04%	-0,04%	-1,16%	2,52%	6,69%	4,89%	2,93%	4,03%

CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	-0,48%	-0,48%	1,83%	5,55%	12,19%	19,87%	1,61%	1,63%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	1,05%	3,27%	6,80%	13,16%	19,54%	0,07%	0,40%
MAG FI RENDA FIXA	1,09%	1,09%	3,28%	6,72%	12,90%	19,34%	0,05%	0,41%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	1,13%	3,39%	6,95%	13,39%	19,73%	0,02%	0,40%
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENDA FIXA LP	0,32%	0,32%	2,42%	5,97%	12,28%	18,34%	0,78%	0,83%

R
Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,30%	4,80%	9,80%	11,12%	1,44%	1,38%
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%	3,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,28%	6,11%	11,10%	11,70%	0,39%	1,36%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,93%	0,93%	2,05%	5,07%	9,94%	13,83%	0,69%	0,76%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,50%	1,50%	0,10%	2,28%	-	-	0,59%	-

Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
Ibovespa (Benchmark)	3,37%	3,37%	-2,25%	9,95%	1,15%	-1,42%	-	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,92%	-0,92%	-12,38%	5,94%	-2,18%	16,23%	10,17%	28,68%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	4,57%	4,57%	-3,23%	8,85%	2,32%	-11,61%	9,55%	20,49%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	3,18%	3,18%	-6,55%	5,44%	-1,25%	-5,37%	10,07%	20,57%
OCCAM FIC AÇÕES	2,75%	2,75%	-5,24%	8,21%	0,82%	-3,26%	7,93%	19,01%
MAG FI AÇÕES	3,29%	3,29%	-4,60%	7,40%	-1,39%	-16,74%	11,12%	20,57%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	2,46%	2,46%	-8,28%	1,16%	-4,44%	-4,39%	10,28%	21,83%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,94%	3,94%	-3,74%	7,30%	3,49%	8,97%	9,12%	17,37%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,35%	2,35%	-12,51%	11,07%	15,94%	41,78%	9,74%	27,17%
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%	26,04%
IFIX (Benchmark)	-1,60%	-1,60%	-5,69%	0,25%	1,59%	-2,03%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,66%	0,66%	-3,19%	-3,68%	-29,77%	20,33%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0,70%	0,70%	1,16%	3,74%	-43,43%	94,27%	0,08%	46,71%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	6,18%	6,18%	5,28%	-1,30%	-9,72%	9,76%	-	-

Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6,49%	6,49%	7,43%	3,30%	-1,13%	24,33%	7,53%	23,99%
SMLL (Benchmark)	2,92%	2,92%	-11,39%	3,51%	-15,47%	-24,13%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FIAÇÕES	3,35%	3,35%	-10,07%	2,84%	-8,79%	-12,16%	13,47%	27,45%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIAÇÕES	5,35%	5,35%	-8,97%	3,89%	-12,30%	-19,42%	11,50%	26,60%

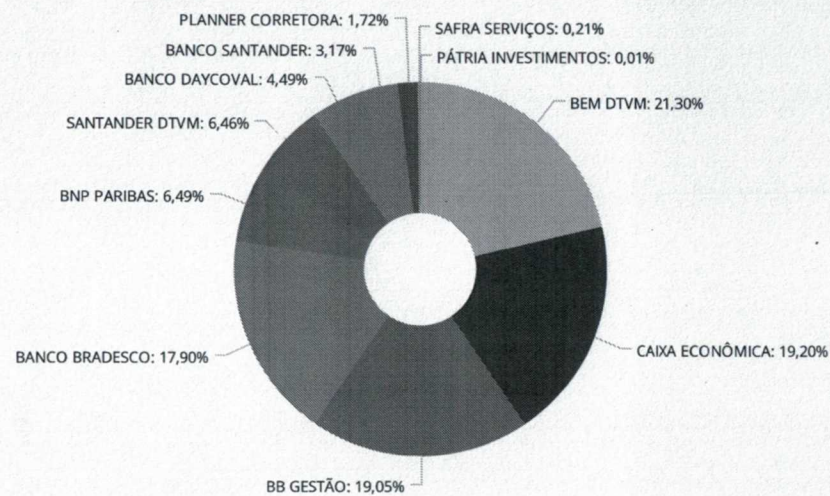
Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.600/2021

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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	2,55%	2,55%	4,16%	-5,12%	-19,13%	-7,86%	8,14%	18,488%
MSCI WORLD (Benchmark)	4,58%	4,58%	6,03%	-0,33%	-13,34%	-2,56%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	1,92%	1,92%	6,85%	1,32%	-13,23%	-11,19%	8,19%	16,820%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	11,00%	11,00%	14,94%	2,75%	-26,03%	-37,52%	17,36%	28,613%
MSCI ACWI (Benchmark)	4,67%	4,67%	7,25%	-0,08%	-13,97%	-6,09%	-	-
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MULTIMERCADO	2,45%	2,45%	10,97%	-11,73%	-27,97%	-39,93%	11,99%	22,660%


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 29.560/2021

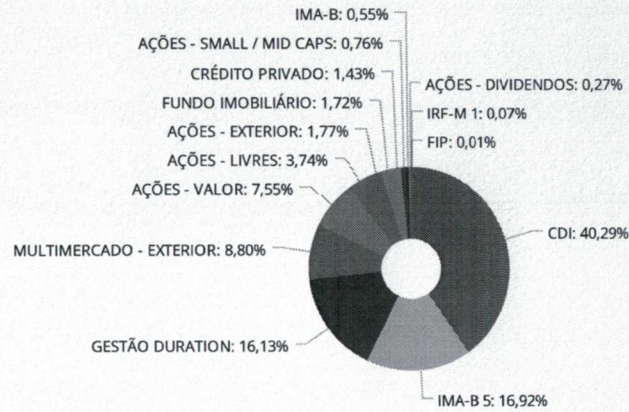
Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2023)



BEM DTVM	48.470.752,50
CAIXA ECONÔMICA	43.703.320,28
BB GESTÃO	43.367.072,15
BANCO BRADESCO	40.734.047,45
BNP PARIBAS	14.777.382,45
SANTANDER DTVM	14.693.966,17
BANCO DAYCOVAL	10.219.663,67
BANCO SANTANDER	7.216.543,76
PLANNER CORRETORA	3.906.094,83
SAFRA SERVIÇOS	485.288,92
PÁTRIA INVESTIMENTOS	15.382,18

Rodrigo Barbosa Franco
Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 28.500/2021

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



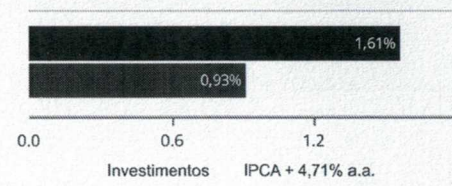
■ CDI	91.685.054,83	■ IMA-B 5	38.508.367,81	■ GESTÃO DURATION	36.712.837,21	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	20.025.207,01
■ AÇÕES - VALOR	17.177.919,19	■ AÇÕES - LIVRES	8.507.666,01	■ AÇÕES - EXTERIOR	4.036.864,66	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	3.906.094,83
■ CRÉDITO PRIVADO	3.249.220,22	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.721.594,33	■ IMA-B	1.260.665,77	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	615.448,82
■ IRF-M 1	167.191,49	■ FIP	15.382,18				

Rodrigo Barbosa Franco
Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 23.500/2021

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	223.796.588,87	12.539.062,06	12.362.323,08	227.589.514,36	3.616.186,51	3.616.186,51	1,61%	1,61%	0,93%	0,93%	172,73%	2,69%

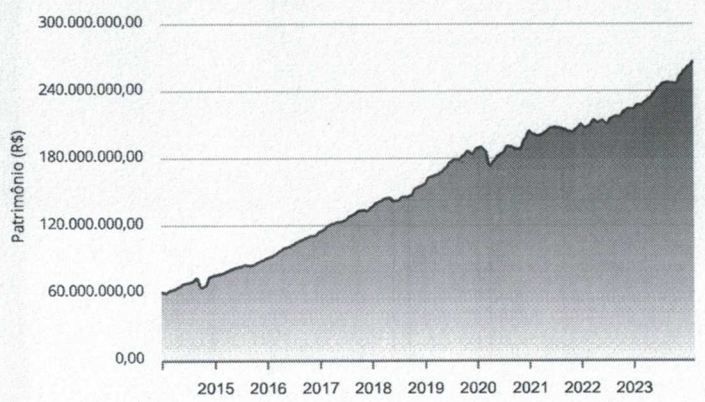
Investimentos x Meta de Rentabilidade



Rodrigo Barbosa Franco
Rodrigo Barbosa Franco
 Agente de Controle Interno
 Portaria nº 28.500/2021

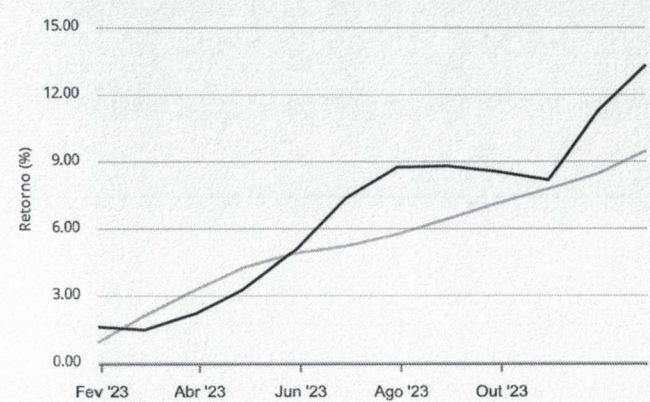
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



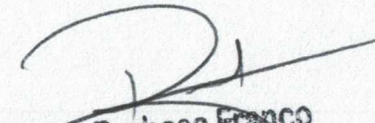
- Investimentos
- Meta de Rentabilidade
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IMA Geral
- IRF-M
- IRF-M 1
- IRF-M 1+
- Ibovespa
- IBX
- SMLL
- IDIV

Rodrigo Barbosa Franco
Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 28.500/2021

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	12.889.661,08	0,00	0,00	13.082.599,25	192.938,17	1,50%	1,50%	0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	29.533.292,36	2.022.464,30	0,00	32.002.281,29	446.524,63	1,42%	1,50%	0,59%
SANTANDER IMA-B 5 PREMIUM FIC RENDA FIXA	636.518,83	0,00	0,00	645.279,28	8.760,45	1,38%	1,38%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.554.295,24	0,00	0,00	4.616.904,65	62.609,41	1,37%	1,37%	1,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	408.066,42	0,00	586,60	413.082,48	5.602,66	1,37%	1,37%	1,14%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA	571.516,07	0,00	0,00	579.306,63	7.790,56	1,36%	1,36%	1,14%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	39.707.019,46	0,00	0,00	40.154.740,82	447.721,36	1,13%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	21.173.912,28	0,00	31.000,00	21.362.192,90	219.280,62	1,04%	1,04%	0,39%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	11.655.511,93	2.258.753,72	0,00	14.048.686,89	134.421,24	0,97%	1,05%	0,07%
MAG FI RENDA FIXA	16.199.306,80	8.000.000,00	225,84	24.399.027,87	199.946,91	0,83%	1,09%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	389.014,53	0,00	140.591,71	251.513,48	3.090,66	0,79%	1,11%	0,00%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.092.559,54	0,00	669.375,41	431.408,30	8.224,17	0,75%	0,93%	0,69%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	7.987.974,88	0,00	2.000.000,00	6.037.708,82	49.733,94	0,62%	0,65%	1,44%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	157.817,66	257.844,04	250.543,52	167.191,49	2.073,31	0,50%	1,06%	0,26%
ICATU VANGUARDA PLUS FI RENDA FIXA LP	10.125.627,39	0,00	1.270.000,00	8.881.527,19	25.899,80	0,26%	0,32%	0,78%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	969.563,07	0,00	0,00	969.193,35	-369,72	-0,04%	-0,04%	2,93%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	291.606,21	0,00	0,00	291.472,42	-133,79	-0,05%	-0,05%	2,93%
MAG FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.348.942,35	0,00	8.000.000,00	3.249.220,22	-99.722,13	-0,88%	-0,48%	1,61%
Total Renda Fixa	169.692.206,10	12.539.062,06	12.362.323,08	171.583.337,33	1.714.392,25	1,01%		0,41%


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.600/2021

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.855.401,18	0,00	0,00	10.495.316,71	639.915,53	6,49%	6,49%	7,53%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	693.400,29	0,00	0,00	730.490,00	37.089,71	5,35%	5,35%	11,50%
META VALOR FI AÇÕES	1.813.010,40	0,00	0,00	1.901.847,02	88.836,62	4,90%	4,90%	13,12%
SANTANDER SELEÇÃO CRESCIMENTO SÊNIOR FIC AÇÕES	621.985,32	0,00	0,00	650.417,59	28.432,27	4,57%	4,57%	9,55%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	592.095,34	0,00	0,00	615.448,82	23.353,48	3,94%	3,94%	9,12%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	958.983,00	0,00	0,00	991.104,33	32.121,33	3,35%	3,35%	13,47%
MAG FI AÇÕES	4.614.241,30	0,00	0,00	4.766.079,74	151.838,44	3,29%	3,29%	11,12%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.572.997,78	0,00	0,00	8.845.445,65	272.447,87	3,18%	3,18%	10,07%
OCCAM FI AÇÕES	223.646,34	0,00	0,00	229.805,71	6.159,37	2,75%	2,75%	7,93%
VINCI FATORIAL DINÂMICO FI AÇÕES	950.816,66	0,00	0,00	974.172,84	23.356,18	2,46%	2,46%	10,28%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2.703.884,70	0,00	0,00	2.767.413,43	63.528,73	2,35%	2,35%	9,74%
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	15.275,18	0,00	0,00	15.382,18	107,00	0,70%	0,70%	0,08%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.880.433,33	0,00	0,00	3.906.094,83	25.661,50	0,66%	0,66%	-
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.602.085,09	0,00	0,00	5.550.403,22	-51.681,87	-0,92%	-0,92%	10,17%
Total Renda Variável	41.098.255,91	0,00	0,00	42.439.422,07	1.341.166,16	3,26%		9,73%


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES DÓLAR ADVISORY INVESTIMENT...	3.199.585,27	0,00	0,00	3.551.575,74	351.990,47	11,00%	11,00%	17,36%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FIAÇÕES BDR NÍVEL I	473.210,69	0,00	0,00	485.288,92	12.078,23	2,55%	2,55%	8,14%
MAG GLOBAL SUSTAINABLE INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI...	3.313.887,08	0,00	0,00	3.395.172,43	81.285,35	2,45%	2,45%	11,99%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	6.019.443,82	0,00	0,00	6.134.717,87	115.274,05	1,92%	1,92%	8,19%
Total Exterior	13.006.126,86	0,00	0,00	13.566.754,96	560.628,10	4,31%		11,54%


Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

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

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.



Rodrigo Barbosa Franco
Agente de Controle Interno
Portaria nº 23.500/2021