


Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2023



afic *amylarina* 

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
TÍTULOS PÚBLICOS			6.182.523,02	3,06%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.694.174,59	1,83%	977	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.552.008,78	2,75%	547	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.963.633,18	2,46%	481	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	15/08/2024	1.609.302,69	0,80%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.468.746,54	1,72%	801	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	6.036.669,09	2,99%	948	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.764.333,69	1,86%	928	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.589.376,46	1,28%	294	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	3.414.730,28	1,69%	74	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	7.838.692,64	3,88%	1.070	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.910.340,49	1,93%	376	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	33.756.856,93	16,70%	317	0,92%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.812.151,46	0,90%	198	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	1.307.604,34	0,65%	1.324	1,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.861.941,74	5,37%	92	2,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	5.841.408,23	2,89%	255	1,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	11.470.231,64	5,67%	1.351	3,99%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.343.530,17	3,14%	529	3,08%	Artigo 8º, Inciso I
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	D+7 du ...	Não há	1.260.609,00	0,62%	8	7,02%	Artigo 8º, Inciso I

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]

[Handwritten signature]



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.124.344,94	2,54%	4.475	1,70%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.277.179,20	0,63%	1.702	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.574.913,38	0,78%	28	0,78%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.977.403,43	2,46%	3.577	0,40%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	1.339.525,62	0,66%	262	0,54%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.311.561,62	3,62%	41	0,68%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	2.131.901,21	1,05%	26	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	1.999.517,20	0,99%	169	3,47%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	Não há	461.532,80	0,23%	53	2,29%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.630.643,07	2,29%	5.187	1,83%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	5.438.907,58	2,69%	2.412	1,61%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.595.585,10	0,79%	261	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.188.231,80	2,07%	49	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	1.198.187,29	0,59%	32	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	2.762.742,22	1,37%	3.566	1,15%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	D+6 du	Não há	1.604.310,61	0,79%	11	11,05%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.182.942,84	0,59%	271	0,41%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.737.434,33	1,35%	158	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.917.317,40	0,95%	636	8,13%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	2.163.764,44	1,07%	4.829	1,09%	Artigo 9º, Inciso III

[Handwritten signatures]

[Handwritten signature]



Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BRDESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	D+4	Não há	5.021.350,10	2,48%	630	2,84%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.823.758,00	1,40%	8.463	0,16%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	2.976.495,10	1,47%	10	6,45%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	3.115.155,06	1,54%	22	2,38%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	2.058.063,04	1,02%	20	1,27%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	3.582.318,59	1,77%	3.658	1,81%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.268.000,00	0,63%		1,27%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			202.141.950,93				

du

amy

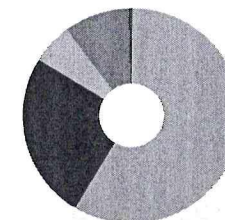
lina

[Handwritten signature]



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	6.182.523,02	3,06%	1,50%	18,90%	84,06%	163.738.000,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	35.092.975,30	17,36%	20,45%	20,50%	84,06%	134.827.548,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	65.328.995,83	32,32%	8,00%	12,00%	70,00%	76.170.369,82
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	15,00%	30.321.292,64
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	11.470.231,64	5,67%	0,00%	0,00%	10,00%	8.743.963,45
Total Renda Fixa	100,00%	118.074.725,79	58,41%	29,95%	54,40%	263,12%	



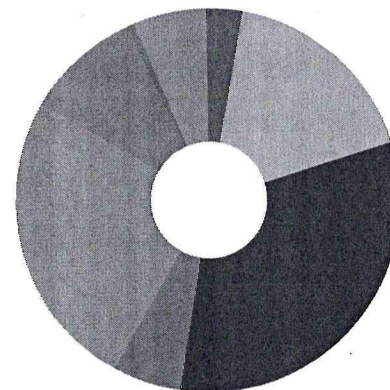
- RENDA FIXA 118.074.725,79
- RENDA VARIÁVEL 50.853.573,41
- EXTERIOR 12.368.511,84
- ESTRUTURADOS 19.577.139,89
- FUNDO IMOBILIÁRIO 1.268.000,00

ⓘ 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!

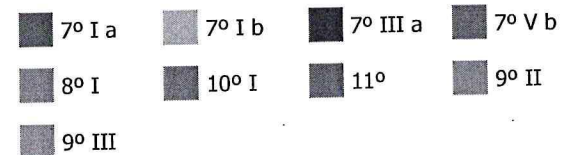
(Handwritten signatures)

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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	40,00%	50.853.573,41	25,16%	10,00%	20,40%	40,00%	30.003.206,96
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	40.428.390,19
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.577.139,89	9,68%	3,75%	10,00%	10,00%	637.055,20
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	10.107.097,55
Artigo 11º	10,00%	1.268.000,00	0,63%	0,50%	0,70%	5,00%	8.839.097,55
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	40,00%	71.698.713,30	35,47%	14,25%	35,60%	80,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	5.549.995,67	2,75%	2,00%	5,00%	10,00%	14.664.199,42
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.818.516,17	3,37%	3,00%	5,00%	10,00%	13.395.678,92
Total Exterior	10,00%	12.368.511,84	6,12%	5,00%	10,00%	20,00%	



[Handwritten signatures in blue ink]



**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
ITAÚ UNIBANCO	43.279.404,32	21,41	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.063.122,72	12,89	-
CAIXA DTVM	25.470.526,96	12,60	-
SOMMA INVESTIMENTOS	16.909.139,22	8,36	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	10.861.941,74	5,37	0,00
SICREDI	9.423.726,82	4,66	0,01
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	8.149.713,20	4,03	0,56
GUEPARDO INVESTIMENTOS	7.311.561,62	3,62	0,22
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	6.596.263,48	3,26	0,00
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	6.343.530,17	3,14	0,21
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	6.182.523,02	3,06	-
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.813.585,91	2,88	0,06
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.124.344,94	2,54	0,01
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.977.403,43	2,46	0,28
TARPON INVESTIMENTOS	4.188.231,80	2,07	0,07
XP ASSET MANAGEMENT	2.762.742,22	1,37	-
MULTINVEST CAPITAL	2.461.050,00	1,22	0,32
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.917.317,40	0,95	0,02
MIRAE ASSET	1.604.310,61	0,79	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	1.595.585,10	0,79	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	1.339.525,62	0,66	-
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	1.307.604,34	0,65	0,01
ATHENA CAPITAL	1.260.609,00	0,62	0,11
TRÍGONO CAPITAL	1.198.187,29	0,59	0,03

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 '	6.182.523,02	3,06	1,50	84,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	35.092.975,30	17,36	20,45	84,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65.328.995,83	32,32	18,00	70,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	11.470.231,64	5,67	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	50.853.573,41	25,16	10,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	5.549.995,67	2,75	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	6.818.516,17	3,37	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	19.577.139,89	9,68	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.268.000,00	0,63	0,50	5,00

(Handwritten signatures in blue ink)



**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
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%

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%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,38%	1,38%	1,96%	4,32%	11,00%	15,85%	1,14%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,39%	1,39%	2,19%	1,48%	4,49%	2,35%	0,93%	0,05%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1,37%	1,37%	1,92%	4,24%	10,86%	14,85%	1,15%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,00%	0,00%	-0,99%	2,84%	7,15%	5,93%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-0,01%	-1,03%	2,70%	6,90%	5,39%	2,90%	0,04%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,04%	-0,04%	-1,16%	2,52%	6,69%	4,89%	2,93%	0,04%

IRF-M (Benchmark)	0,84%	0,84%	1,65%	6,17%	9,82%	8,42%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	0,82%	1,56%	6,01%	9,61%	7,83%	1,86%	0,03%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,89%	0,89%	1,53%	6,12%	10,20%	8,22%	1,76%	0,03%
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%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

afu

aamy

caia

[Handwritten signature]



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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	1,13%	3,37%	6,92%	13,47%	20,02%	0,02%	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 MATRIZ FI RENDA FIXA	1,10%	1,10%	3,28%	6,76%	13,04%	18,94%	0,03%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,03%	1,03%	2,68%	5,77%	12,46%	19,88%	0,23%	0,01%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,10%	0,10%	2,44%	6,37%	13,03%	21,17%	0,99%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
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)	-	-	-	-	-	-	-	-

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
S&P 500 (Benchmark)	6,18%	6,18%	5,28%	-1,30%	-9,72%	9,76%	-	-
BRDESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	6,42%	6,42%	7,25%	2,91%	-1,85%	22,56%	7,53%	0,24%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	6,56%	6,56%	7,58%	3,56%	-0,72%	25,51%	7,52%	0,24%

IBX (Benchmark)	3,51%	3,51%	-2,34%	9,39%	0,75%	-1,38%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	3,64%	3,64%	-2,17%	9,90%	1,97%	-4,44%	9,98%	0,21%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	8,33%	8,33%	-9,30%	9,21%	-12,74%	-13,29%	13,47%	0,33%

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%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	3,41%	3,41%	-2,32%	9,05%	0,67%	10,59%	8,25%	0,18%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,75%	3,75%	-5,38%	6,78%	-4,03%	-11,33%	8,90%	0,21%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	3,71%	3,71%	-2,37%	9,46%	-3,43%	-3,51%	9,02%	0,21%
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%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	3,52%	3,52%	-4,25%	9,61%	2,99%	-1,44%	10,10%	0,20%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	3,26%	3,26%	-5,83%	11,63%	1,69%	-2,84%	11,16%	0,20%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,34%	3,34%	-2,25%	4,69%	-3,79%	0,62%	9,96%	0,19%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,37%	3,37%	-0,28%	12,21%	12,43%	52,08%	8,41%	0,22%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,92%	-0,92%	-12,38%	5,94%	-2,18%	16,23%	10,17%	0,29%



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
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	2,35%	2,35%	-12,51%	11,07%	15,94%	41,78%	9,74%	0,27%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,41%	2,41%	-4,62%	11,24%	6,23%	-0,37%	10,29%	0,23%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	1,67%	1,67%	0,80%	6,86%	3,84%	-	3,62%	0,07%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,21%	0,21%	-1,09%	3,65%	-	-	1,40%	-
SMLL (Benchmark)	2,92%	2,92%	-11,39%	3,51%	-15,47%	-24,13%	-	-
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	5,36%	5,36%	-11,35%	5,08%	-5,27%	-15,30%	12,51%	0,25%
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%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,64%	0,64%	-8,51%	0,64%	-7,45%	-44,44%	8,18%	0,15%

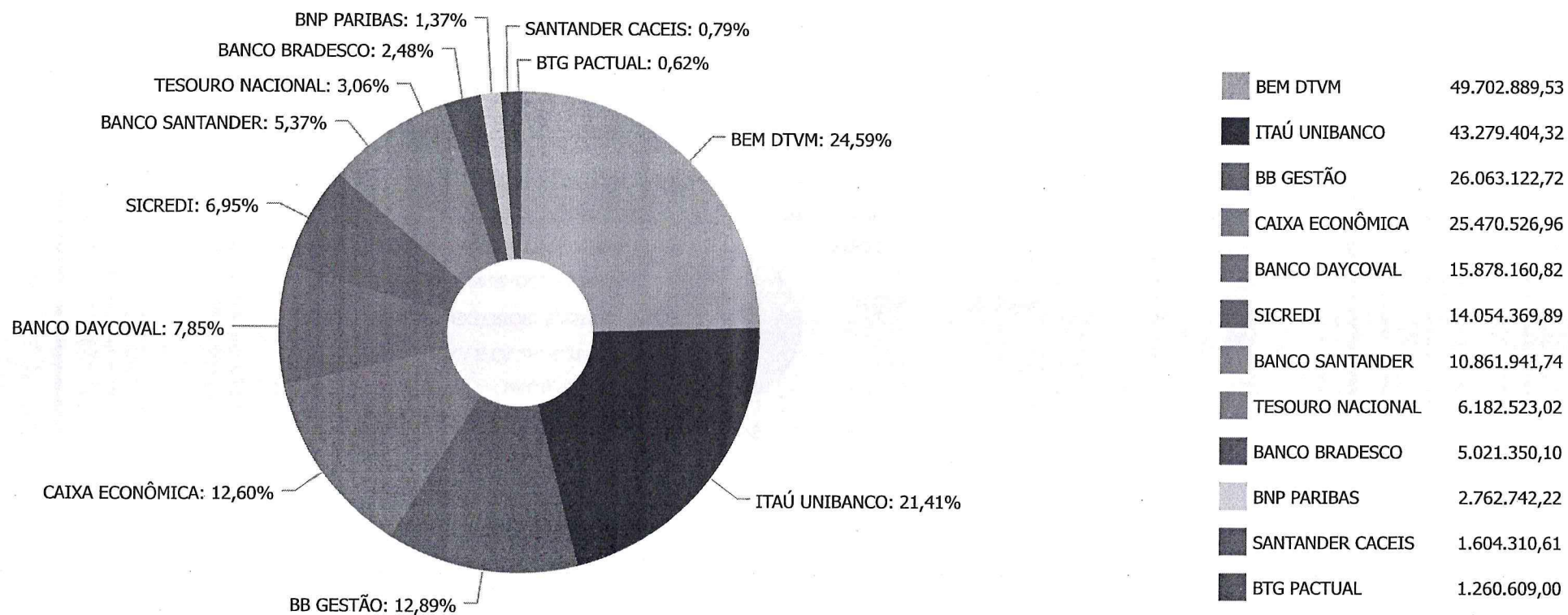
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	1,74%	10,26%	-	-10,98%	-	10,91%	17,53%
Ibovespa (Benchmark)	3,37%	3,37%	-2,25%	9,95%	1,15%	-1,42%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	1,74%	10,26%	-	-10,98%	-	10,91%	17,53%
MSCI ACWI (Benchmark)	4,67%	4,67%	7,25%	-0,08%	-13,97%	-6,09%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	1,74%	10,26%	-	-10,98%	-	10,91%	17,53%

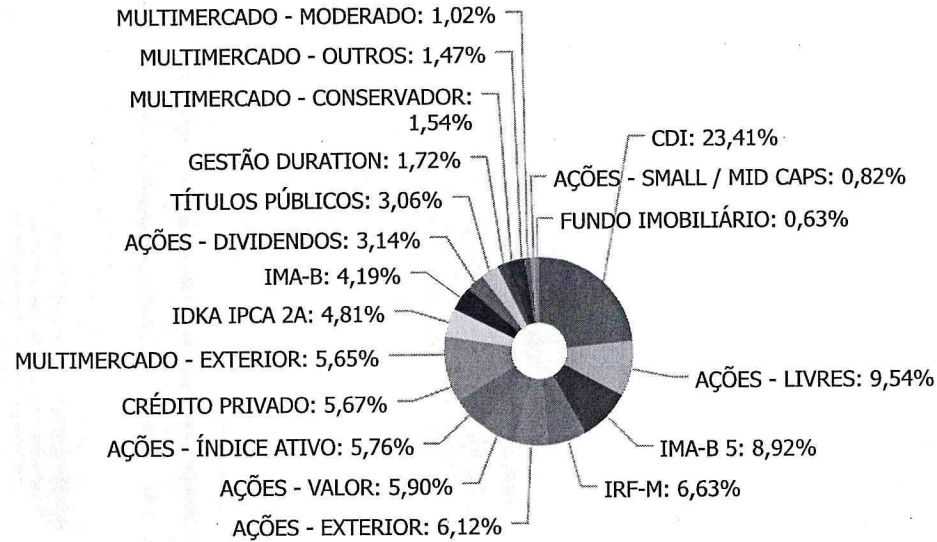
[Handwritten signatures in blue ink]



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



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



■ CDI	47.318.041,52	■ AÇÕES - LIVRES	19.278.075,48	■ IMA-B 5	18.041.005,71
■ IRF-M	13.394.417,87	■ AÇÕES - EXTERIOR	12.368.511,84	■ AÇÕES - VALOR	11.927.783,64
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	11.644.464,03	■ CRÉDITO PRIVADO	11.470.231,64	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	11.427.426,69
■ IDKA IPCA 2A	9.730.843,68	■ IMA-B	8.468.915,81	■ AÇÕES - DIVIDENDOS	6.343.530,17
■ TÍTULOS PÚBLICOS	6.182.523,02	■ GESTÃO DURATION	3.468.746,54	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	3.115.155,06
■ MULTIMERCADO - OUTROS	2.976.495,10	■ MULTIMERCADO - MODERADO	2.058.063,04	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.659.720,09
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.268.000,00				

afu

adam

laiva

[Signature]



CRÉDITO
& MERCADO

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

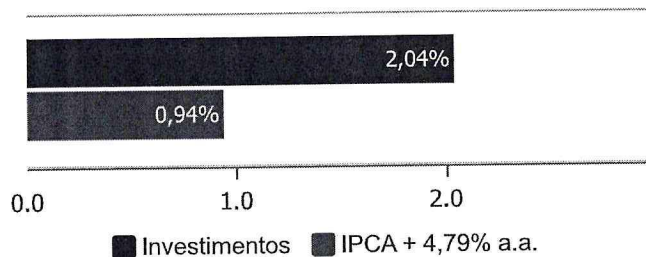
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	19/08/2022	760	3.944,24192900	4.108,578703	2.997.623,87	3.122.519,81	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	14/12/2022	747	4.012,12341	4.082,254006	2.997.056,19	3.049.443,74	Curva



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	193.188.837,21	28.759.181,70	27.851.412,72	198.048.355,79	3.951.749,60	3.951.749,60	2,04%	2,04%	0,94%	0,94%	216,25%	4,19%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



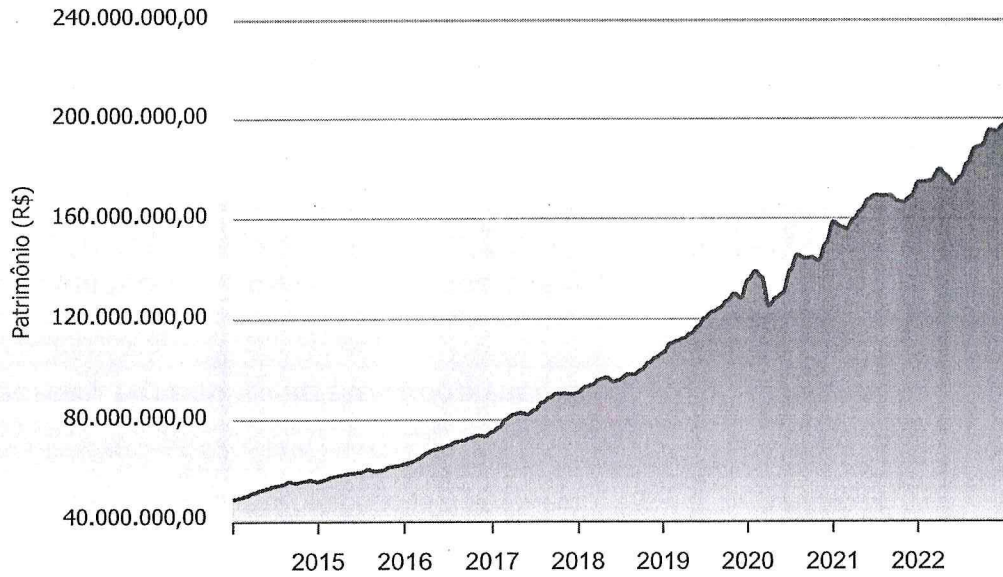
Página 15 de 21



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**

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...	3.641.869,03	0,00	0,00	3.694.174,59	52.305,56	1,44%	1,44%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.952.801,89	0,00	0,00	6.036.669,09	83.867,20	1,41%	1,41%	1,19%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.587.321,60	0,00	0,00	1.609.302,69	21.981,09	1,38%	1,38%	0,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	3.368.276,61	0,00	0,00	3.414.730,28	46.453,67	1,38%	1,38%	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.713.283,78	0,00	0,00	3.764.333,69	51.049,91	1,37%	1,37%	1,14%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	10.715.400,44	0,00	0,00	10.861.941,74	146.541,30	1,37%	1,37%	1,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.751.581,81	0,00	0,00	7.838.692,64	87.110,83	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.867.798,81	0,00	0,00	3.910.340,49	42.541,68	1,10%	1,10%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.793.616,60	0,00	0,00	1.812.151,46	18.534,86	1,03%	1,03%	0,23%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	5.790.079,92	0,00	0,00	5.841.408,23	51.328,31	0,89%	0,89%	1,76%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.566.789,85	0,00	0,00	2.589.376,46	22.586,61	0,88%	0,88%	1,83%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.923.418,39	0,00	0,00	4.963.633,18	40.214,79	0,82%	0,82%	1,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	13.525.337,85	0,00	10.162.111,87	3.468.746,54	105.520,56	0,78%	1,04%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.611.734,68	28.759.181,70	854.247,17	33.756.856,93	240.187,72	0,70%	1,13%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	16.872.800,47	0,00	16.956.094,26	0,00	83.293,79	0,49%	0,65%	1,44%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.458.765,23	0,00	0,00	11.470.231,64	11.466,41	0,10%	0,10%	0,99%
TÍTULOS PÚBLICOS	6.182.523,02	0,00	0,00	6.182.523,02	0,00	0,00%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.552.592,42	0,00	0,00	5.552.008,78	-583,64	-0,01%	-0,01%	2,90%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.308.103,15	0,00	0,00	1.307.604,34	-498,81	-0,04%	-0,04%	2,93%
Total Renda Fixa	116.184.095,55	28.759.181,70	27.972.453,30	118.074.725,79	1.103.901,84	0,94%		0,82%

[Handwritten signatures and initials in blue ink]



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.472.922,52	0,00	0,00	1.595.585,10	122.662,58	8,33%	8,33%	13,47%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	3.361.775,22	0,00	0,00	3.582.318,59	220.543,37	6,56%	6,56%	7,52%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	2.650.771,60	0,00	0,00	2.823.758,00	172.986,40	6,53%	6,53%	7,51%
BRADESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	4.718.264,05	0,00	0,00	5.021.350,10	303.086,05	6,42%	6,42%	7,53%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	438.056,43	0,00	0,00	461.532,80	23.476,37	5,36%	5,36%	12,51%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.102.822,11	0,00	0,00	6.343.530,17	240.708,06	3,94%	3,94%	9,12%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.793.815,93	0,00	0,00	4.977.403,43	183.587,50	3,83%	3,83%	8,29%
MULTINVEST FI AÇÕES	1.927.340,82	0,00	0,00	1.999.517,20	72.176,38	3,74%	3,74%	10,52%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.939.388,05	0,00	0,00	5.124.344,94	184.956,89	3,74%	3,74%	8,90%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	5.244.315,86	0,00	0,00	5.438.907,58	194.591,72	3,71%	3,71%	9,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	1.519.606,53	0,00	0,00	1.574.913,38	55.306,85	3,64%	3,64%	9,98%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	4.473.270,83	0,00	0,00	4.630.643,07	157.372,24	3,52%	3,52%	10,10%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.295.373,61	0,00	0,00	1.339.525,62	44.152,01	3,41%	3,41%	8,25%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃOE...	1.159.144,70	0,00	0,00	1.198.187,29	39.042,59	3,37%	3,37%	8,41%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.235.936,70	0,00	0,00	1.277.179,20	41.242,50	3,34%	3,34%	9,96%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FIAÇÕES	1.220.845,15	0,00	0,00	1.260.609,00	39.763,85	3,26%	3,26%	11,16%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.081.643,04	0,00	0,00	2.131.901,21	50.258,17	2,41%	2,41%	10,29%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	4.092.086,77	0,00	0,00	4.188.231,80	96.145,03	2,35%	2,35%	9,74%
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERC...	2.920.490,89	0,00	0,00	2.976.495,10	56.004,21	1,92%	1,92%	7,22%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	3.063.980,26	0,00	0,00	3.115.155,06	51.174,80	1,67%	1,67%	3,62%


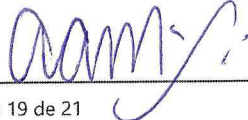




CRÉDITO
& MERCADO

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.260.000,00	0,00	0,00	1.268.000,00	8.000,00	0,63%	0,63%	8,18%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	2.053.662,32	0,00	0,00	2.058.063,04	4.400,72	0,21%	0,21%	1,40%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.379.642,27	0,00	0,00	7.311.561,62	-68.080,65	-0,92%	-0,92%	10,17%
Total Renda Variável	69.405.155,66	0,00	0,00	71.698.713,30	2.293.557,64	3,30%		8,67%



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
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVEST...	2.467.239,44	0,00	0,00	2.762.742,22	295.502,78	11,98%	11,98%	8,97%
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD IN...	1.443.412,27	0,00	0,00	1.604.310,61	160.898,34	11,15%	11,15%	10,07%
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.838.038,20	0,00	0,00	1.917.317,40	79.279,20	4,31%	4,31%	8,79%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.684.510,00	0,00	0,00	2.737.434,33	52.924,33	1,97%	1,97%	8,14%
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIME...	1.162.661,69	0,00	0,00	1.182.942,84	20.281,15	1,74%	1,74%	10,91%
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	2.160.507,98	0,00	0,00	2.163.764,44	3.256,46	0,15%	0,15%	7,26%
Total Exterior	11.756.369,58	0,00	0,00	12.368.511,84	612.142,26	5,21%		8,79%

Handwritten signatures in blue ink.

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.