

# Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2023

*Leiria*

*anam*

*[Signature]*

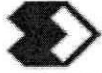
*[Signature]*

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			6.066.695,59	3,01%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.289.088,39	2,13%	965	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.622.371,64	2,79%	527	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.004.428,10	2,48%	473	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	15/08/2024	1.585.098,17	0,79%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.502.219,95	1,74%	794	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	7.832.997,00	3,88%	936	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.816.683,44	1,89%	926	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.610.865,51	1,29%	294	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	D+1	Não há	3.462.287,66	1,72%	73	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	7.905.625,74	3,92%	1.078	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.780.730,32	2,37%	394	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	33.277.240,54	16,50%	334	0,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.827.856,01	0,91%	201	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+3	Não há	1.323.941,04	0,66%	1.374	1,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.012.934,40	5,46%	86	2,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	5.891.611,31	2,92%	242	1,84%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 du	Não há	11.454.424,50	5,68%	1.215	4,20%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.947.937,77	2,95%	522	3,10%	Artigo 8º, Inciso I
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	D+7 du ...	Não há	1.175.402,81	0,58%	8	7,02%	Artigo 8º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.751.827,60	2,36%	4.305	1,79%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.183.477,84	0,59%	1.642	0,14%	Artigo 8º, Inciso I
BRANCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.457.069,68	0,72%	28	0,75%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.670.782,75	2,32%	3.485	0,41%	Artigo 8º, Inciso I
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3	Não há	1.239.145,93	0,61%	264	0,53%	Artigo 8º, Inciso I
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	7.041.618,33	3,49%	41	0,67%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+23 du	Não há	1.971.959,07	0,98%	26	0,10%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	1.796.668,29	0,89%	168	3,68%	Artigo 8º, Inciso I
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	D+1 du	Não há	418.128,77	0,21%	52	2,42%	Artigo 8º, Inciso I
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.244.434,34	2,10%	5.092	1,86%	Artigo 8º, Inciso I
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	4.907.355,87	2,43%	2.339	1,62%	Artigo 8º, Inciso I
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.458.525,54	0,72%	249	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	D+32	Não há	4.082.317,36	2,02%	49	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	1.150.211,11	0,57%	32	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVE...	D+6 du	Não há	2.678.994,48	1,33%	3.449	1,18%	Artigo 9º, Inciso II
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD ...	D+6 du	Não há	1.627.881,06	0,81%	11	11,05%	Artigo 9º, Inciso II
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTI...	D+4 du	Não há	1.187.061,44	0,59%	255	0,41%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.747.795,95	1,36%	158	0,21%	Artigo 9º, Inciso III
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.927.337,26	0,96%	618	8,19%	Artigo 9º, Inciso III
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	2.146.228,87	1,06%	4.676	0,99%	Artigo 9º, Inciso III



Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 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	4.927.417,59	2,44%	623	2,88%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	2.774.327,24	1,38%	8.152	0,17%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIME...	D+3 du	Não há	3.003.399,34	1,49%	10	6,45%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	3.040.359,30	1,51%	22	2,38%	Artigo 10º, Inciso I
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	D+3 du	Não há	2.063.895,89	1,02%	20	1,27%	Artigo 10º, Inciso I
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1 du	Não há	3.518.624,79	1,75%	3.534	1,87%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.232.800,00	0,61%		1,27%	Artigo 11º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>201.640.085,58</b>				

*Handwritten signature*

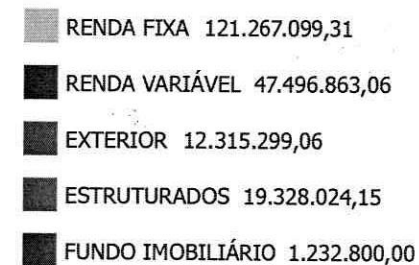
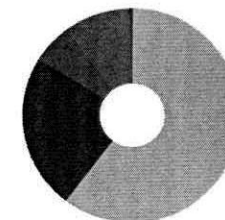
*Handwritten signature*

*Handwritten signature*



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

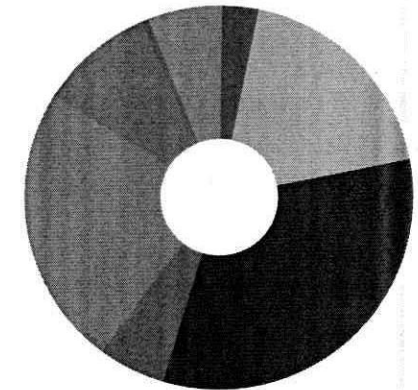
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	6.066.695,59	3,01%	1,50%	18,90%	84,06%	163.431.960,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	37.726.039,86	18,71%	20,45%	20,50%	84,06%	131.772.616,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	66.019.939,36	32,74%	8,00%	12,00%	70,00%	75.128.120,55
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	15,00%	30.246.012,84
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	10,00%	11.454.424,50	5,68%	0,00%	0,00%	10,00%	8.709.584,06
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>121.267.099,31</b>	<b>60,14%</b>	<b>29,95%</b>	<b>54,40%</b>	<b>263,12%</b>	



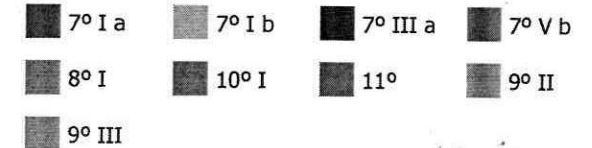
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 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%	47.496.863,06	23,56%	10,00%	20,40%	40,00%	33.159.171,17
Artigo 8º, Inciso II	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	40.328.017,12
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	19.328.024,15	9,59%	3,75%	10,00%	10,00%	835.984,41
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	10.082.004,28
Artigo 11º	10,00%	1.232.800,00	0,61%	0,50%	0,70%	5,00%	8.849.204,28
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>40,00%</b>	<b>68.057.687,21</b>	<b>33,75%</b>	<b>14,25%</b>	<b>35,60%</b>	<b>80,00%</b>	



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%	5.493.936,98	2,72%	2,00%	5,00%	10,00%	14.670.071,58
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	6.821.362,08	3,38%	3,00%	5,00%	10,00%	13.342.646,48
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>12.315.299,06</b>	<b>6,11%</b>	<b>5,00%</b>	<b>10,00%</b>	<b>20,00%</b>	





**CRÉDITO  
& MERCADO**

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
ITAÚ UNIBANCO	42.685.572,15	21,17	0,01
CAIXA DTVM	28.135.721,63	13,95	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	26.752.787,66	13,27	-
SOMMA INVESTIMENTOS	16.361.780,37	8,11	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	11.012.934,40	5,46	0,00
SICREDI	9.410.236,10	4,67	0,01
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	8.107.654,53	4,02	0,52
GUEPARDO INVESTIMENTOS	7.041.618,33	3,49	0,22
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	6.384.487,27	3,17	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	6.066.695,59	3,01	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	5.947.937,77	2,95	0,20
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	5.431.495,78	2,69	0,06
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.751.827,60	2,36	0,01
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	4.670.782,75	2,32	0,29
TARPON INVESTIMENTOS	4.082.317,36	2,02	0,07
XP ASSET MANAGEMENT	2.678.994,48	1,33	-
MULTINVEST CAPITAL	2.214.797,06	1,10	0,27
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.927.337,26	0,96	0,02
MIRAE ASSET	1.627.881,06	0,81	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	1.458.525,54	0,72	0,00
MONGERAL AEGON INVESTIMENTOS	1.323.941,04	0,66	0,14
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	1.239.145,93	0,61	-
ATHENA CAPITAL	1.175.402,81	0,58	0,11
TRÍGONO CAPITAL	1.150.211,11	0,57	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 '	6.066.695,59	3,01	1,50	84,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	37.726.039,86	18,71	20,45	84,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	66.019.939,36	32,74	18,00	70,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	11.454.424,50	5,68	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I	47.496.863,06	23,56	10,00	40,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso II	5.493.936,98	2,72	2,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	6.821.362,08	3,38	3,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	19.328.024,15	9,59	3,75	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.232.800,00	0,61	0,50	5,00

*Handwritten signatures and initials:*  
 - Top right: "dini"  
 - Middle: "Lae in."  
 - Bottom: "ramy" and several illegible signatures.

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	1,62%	3,08%	4,36%	6,05%	11,25%	18,71%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,49%	2,95%	4,20%	6,00%	11,25%	18,21%	1,45%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	2,93%	4,20%	5,90%	10,95%	17,94%	1,47%	0,03%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,41%	2,82%	3,79%	5,87%	11,57%	18,62%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,39%	2,79%	3,73%	5,76%	11,45%	18,22%	1,18%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	1,39%	2,79%	3,74%	5,78%	11,38%	18,19%	1,18%	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,50%	-0,14%	1,18%	3,05%	4,70%	4,80%	5,02%	0,05%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	1,39%	2,78%	3,71%	5,70%	11,25%	17,37%	1,19%	0,03%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	1,28%	1,28%	1,08%	3,02%	7,94%	8,94%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	1,26%	1,04%	2,90%	7,68%	8,38%	2,45%	0,04%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,25%	1,21%	1,00%	2,59%	7,50%	7,93%	2,37%	0,04%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,86%	1,71%	3,21%	4,93%	10,13%	10,66%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	1,65%	3,10%	4,73%	9,88%	10,03%	1,59%	0,02%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,86%	1,75%	3,19%	4,81%	10,31%	10,65%	1,52%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	1,72%	3,19%	4,92%	10,02%	10,29%	1,59%	0,02%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

*lae in - cam*



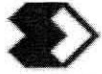




Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,82%	1,96%	3,11%	6,53%	13,29%	20,83%	0,11%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,85%	1,99%	3,13%	6,42%	13,03%	19,82%	0,13%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,79%	1,90%	3,05%	6,34%	12,95%	19,81%	0,04%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,87%	1,91%	3,08%	5,74%	12,44%	21,11%	0,26%	0,01%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	-0,14%	-0,04%	1,18%	4,83%	11,90%	20,51%	0,61%	0,02%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,97%	2,01%	3,17%	5,58%	11,28%	13,35%	0,28%	0,01%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-

*Lein* *amy* *afici*



**CRÉDITO  
& MERCADO**

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO PROTEÇÃO BOLSA AMERICANA II FI MULTIMERCADO	0,90%	2,84%	4,53%	-	-	-	10,25%	-

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-7,49%	-4,38%	-6,72%	-4,19%	-7,26%	-4,64%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,24%	-2,54%	-3,93%	-5,73%	-1,22%	7,54%	7,91%	0,19%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-7,49%	-4,34%	-6,94%	-5,77%	-6,49%	5,10%	7,40%	0,20%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-7,27%	-3,80%	-7,46%	-7,32%	-10,14%	-15,75%	7,69%	0,22%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	-9,77%	-6,43%	-8,37%	-7,58%	-11,83%	-10,89%	8,61%	0,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-6,16%	-2,57%	-5,65%	-8,88%	-3,33%	0,31%	7,21%	0,21%
MULTINVEST FI AÇÕES	-10,15%	-6,78%	-8,76%	-15,36%	-16,59%	-24,38%	8,50%	0,23%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	-8,34%	-5,12%	-7,16%	-5,03%	-6,99%	-4,29%	8,25%	0,22%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	-6,76%	-3,72%	-4,18%	-1,49%	-2,92%	-6,04%	8,38%	0,21%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-7,34%	-4,24%	-6,62%	-7,40%	-10,52%	-1,82%	8,82%	0,20%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,00%	-0,77%	-2,08%	-1,48%	10,98%	40,21%	4,90%	0,23%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,69%	-4,58%	-7,72%	-8,27%	-1,24%	19,59%	10,50%	0,29%
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	-2,53%	-0,24%	-4,99%	-1,71%	7,65%	31,82%	9,69%	0,27%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,80%	-4,55%	-2,85%	-2,69%	0,22%	-6,99%	7,04%	0,24%
RIO BRAVO PROTEÇÃO FI MULTIMERCADO	-2,40%	-0,77%	-0,88%	1,31%	3,39%	-	3,24%	0,07%
RIO BRAVO PROTEÇÃO II FI MULTIMERCADO	0,28%	0,50%	-0,04%	-0,39%	-	-	1,62%	-

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

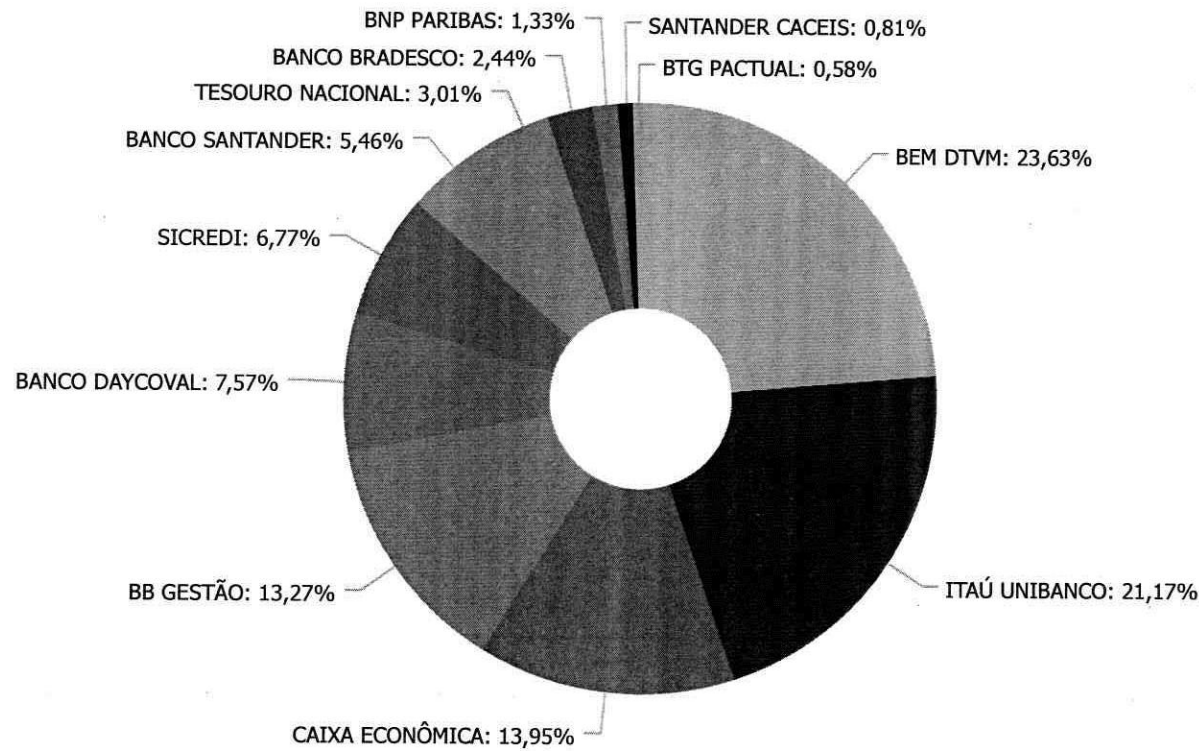
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IBX (Benchmark)</b>	-7,59%	-4,34%	-6,85%	-4,76%	-8,23%	-5,60%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	-7,48%	-4,12%	-6,55%	-4,58%	-7,33%	-8,77%	8,36%	0,22%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	-8,59%	-0,98%	-3,41%	-9,48%	-13,90%	-23,09%	10,26%	0,34%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	-0,45%	-2,05%	-2,05%	-5,64%	2,45%	-2,71%	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-2,78%	-2,16%	-10,64%	-10,55%	-5,14%	-37,10%	12,03%	0,14%
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	-0,92%	3,71%	-1,93%	3,17%	-8,75%	-9,86%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,75%	4,66%	-0,47%	4,91%	-0,63%	19,22%	7,63%	0,24%
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-2,61%	3,40%	-2,70%	0,38%	-9,45%	4,17%	-	-
BRDESCO S&P 500 MAIS FIC MULTIMERCADO	-1,87%	4,43%	-0,70%	4,42%	-1,46%	17,17%	7,65%	0,24%
SICREDI BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,78%	4,67%	-0,40%	5,07%	-0,37%	19,82%	7,64%	0,24%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-10,52%	-7,90%	-10,68%	-16,48%	-20,22%	-30,84%	-	-
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	-9,40%	-4,55%	-7,66%	-12,53%	-11,26%	-18,54%	7,92%	0,27%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
ITAÚ FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-	-0,66%	-5,50%	-	-	-	7,84%	0,15%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	2,36%	-2,85%	-	-	-	7,60%	0,17%
DAYCOVAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	4,86%	-0,01%	-	-	-	9,59%	0,18%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-7,49%	-4,38%	-6,72%	-4,19%	-7,26%	-4,64%	-	-
GLOBAL X ROBÓTICA E INTELIGÊNCIA ARTIFICIAL USD INVESTIMENTO NO E...	-	12,78%	8,85%	-	-	-	12,15%	0,30%
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	-0,92%	3,71%	-1,93%	3,17%	-8,75%	-9,86%	-	-
SCHRODER SUSTENTABILIDADE GLOBAIS USD IS INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	2,10%	-0,50%	-	-	-	8,90%	0,17%
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTER...	-	8,58%	6,12%	-	-	-	10,74%	0,27%

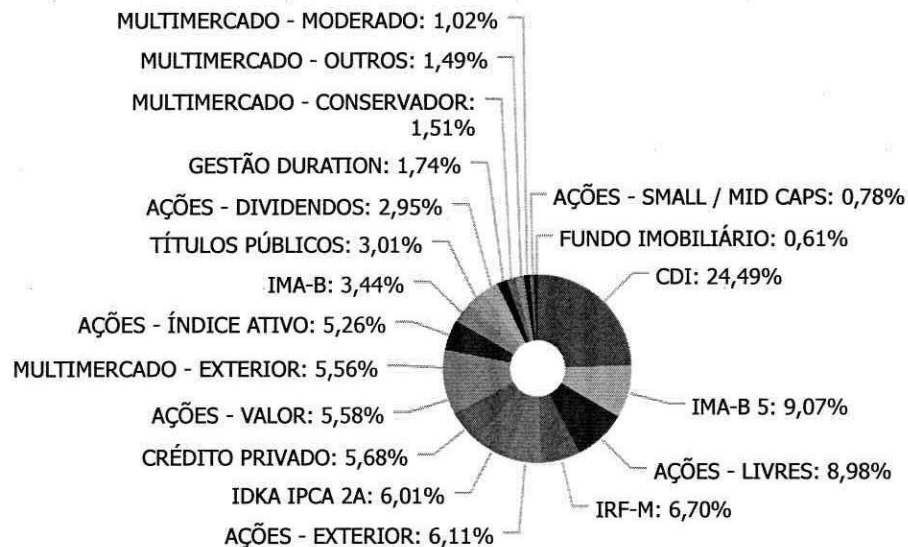


Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2023)



BEM DTVM	47.655.937,76
ITAÚ UNIBANCO	42.685.572,15
CAIXA ECONÔMICA	28.135.721,63
BB GESTÃO	26.752.787,66
BANCO DAYCOVAL	15.266.070,01
SICREDI	13.654.670,44
BANCO SANTANDER	11.012.934,40
TESOURO NACIONAL	6.066.695,59
BANCO BRADESCO	4.927.417,59
BNP PARIBAS	2.678.994,48
SANTANDER CACEIS	1.627.881,06
BTG PACTUAL	1.175.402,81

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



■ CDI	49.376.550,78	■ IMA-B 5	18.291.905,50	■ AÇÕES - LIVRES	18.110.815,13
■ IRF-M	13.506.904,92	■ AÇÕES - EXTERIOR	12.315.299,06	■ IDKA IPCA 2A	12.122.085,39
■ CRÉDITO PRIVADO	11.454.424,50	■ AÇÕES - VALOR	11.260.910,39	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	11.220.369,62
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	10.608.859,89	■ IMA-B	6.946.312,68	■ TÍTULOS PÚBLICOS	6.066.695,59
■ AÇÕES - DIVIDENDOS	5.947.937,77	■ GESTÃO DURATION	3.502.219,95	■ MULTIMERCADO - CONSERVADOR	3.040.359,30
■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.003.399,34	■ MULTIMERCADO - MODERADO	2.063.895,89	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.568.339,88
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.232.800,00				



CRÉDITO  
& MERCADO

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 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	4.029,856335	2.997.623,87	3.062.690,81	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	14/12/2022	747	4.012,12341	4.002,715947	2.997.056,19	2.990.028,81	Curva

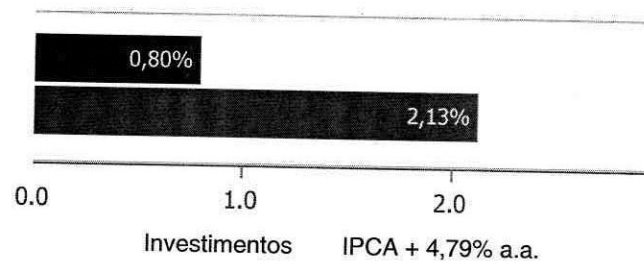
*La in* *campi* *di*



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	198.447.776,34	4.351.170,15	4.351.170,15	2,24%	2,24%	0,94%	0,94%	238,11%	4,19%
Fevereiro	198.447.776,34	2.734.675,74	1.140.768,42	197.229.574,12	-2.812.109,54	1.539.060,61	-1,41%	0,80%	1,18%	2,13%	37,77%	3,89%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



*[Handwritten signatures and initials]*

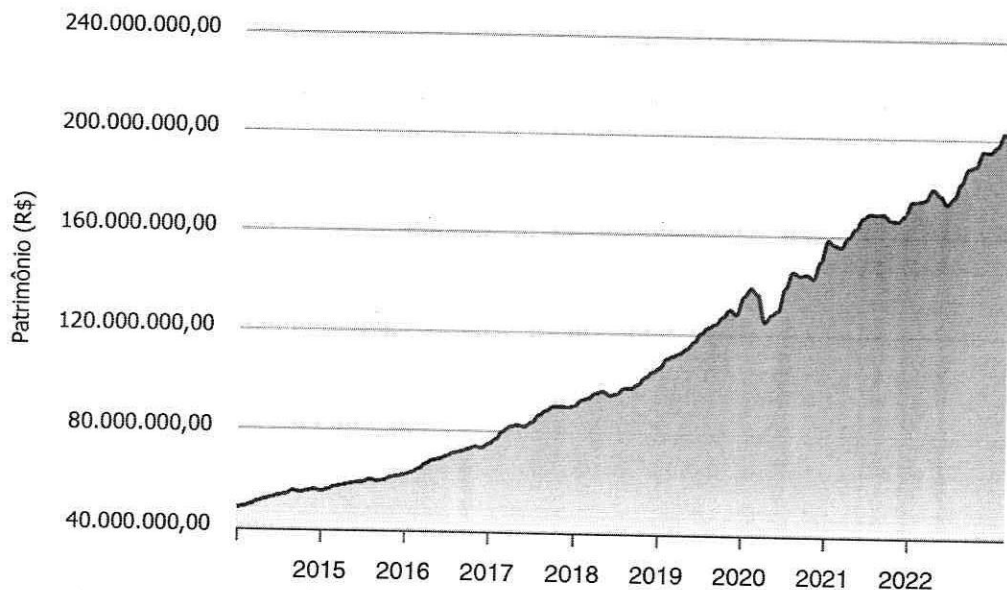




Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

*[Handwritten signatures]*

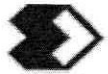
*[Handwritten signature]*

*[Handwritten signature]*

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA I	3.414.730,28	0,00	0,00	3.462.287,66	47.557,38	1,39%	1,39%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.764.333,69	0,00	0,00	3.816.683,44	52.349,75	1,39%	1,39%	1,18%
SANTANDER IMA-B 5 TOP FI RENDA FIXA LP	10.861.941,74	0,00	0,00	11.012.934,40	150.992,66	1,39%	1,39%	1,19%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.694.174,59	538.288,34	0,00	4.289.088,39	56.625,46	1,34%	1,49%	1,45%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.609.302,69	0,00	45.697,27	1.585.098,17	21.492,75	1,34%	-1,50%	5,02%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.036.669,09	1.694.226,37	0,00	7.832.997,00	102.101,54	1,32%	1,50%	1,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.552.008,78	0,00	0,00	5.622.371,64	70.362,86	1,27%	1,27%	2,45%
MAG INFLAÇÃO ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.307.604,34	0,00	0,00	1.323.941,04	16.336,70	1,25%	1,25%	2,37%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	3.468.746,54	0,00	0,00	3.502.219,95	33.473,41	0,97%	0,97%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	1.812.151,46	0,00	0,00	1.827.856,01	15.704,55	0,87%	0,87%	0,26%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	5.841.408,23	0,00	0,00	5.891.611,31	50.203,08	0,86%	0,86%	1,52%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.838.692,64	0,00	0,00	7.905.625,74	66.933,10	0,85%	0,85%	0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.589.376,46	0,00	0,00	2.610.865,51	21.489,05	0,83%	0,83%	1,59%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.963.633,18	0,00	0,00	5.004.428,10	40.794,92	0,82%	0,82%	1,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	34.156.277,38	330.442,16	1.486.558,75	33.277.240,54	277.079,75	0,80%	0,82%	0,11%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	3.910.340,49	836.349,14	0,00	4.780.730,32	34.040,69	0,72%	0,79%	0,04%
SOMMA TORINO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	11.470.231,64	0,00	0,00	11.454.424,50	-15.807,14	-0,14%	-0,14%	0,61%
TÍTULOS PÚBLICOS	6.182.523,02	0,00	0,00	6.066.695,59	-115.827,43	-1,87%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>118.474.146,24</b>	<b>3.399.306,01</b>	<b>1.532.256,02</b>	<b>121.267.099,31</b>	<b>925.903,08</b>	<b>0,77%</b>		<b>0,86%</b>



**CRÉDITO  
& MERCADO**

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TARPON GT INSTITUCIONAL I FIC AÇÕES	4.188.231,80	0,00	0,00	4.082.317,36	-105.914,44	-2,53%	-2,53%	9,69%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.268.000,00	0,00	0,00	1.232.800,00	-35.200,00	-2,78%	-2,78%	12,03%
GUEPARDO VALOR INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.311.561,62	0,00	0,00	7.041.618,33	-269.943,29	-3,69%	-3,69%	10,50%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÃO...	1.198.187,29	0,00	0,00	1.150.211,11	-47.976,18	-4,00%	-4,00%	4,90%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4.977.403,43	0,00	0,00	4.670.782,75	-306.620,68	-6,16%	-6,16%	7,21%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.343.530,17	0,00	0,00	5.947.937,77	-395.592,40	-6,24%	-6,24%	7,91%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	1.260.609,00	0,00	0,00	1.175.402,81	-85.206,19	-6,76%	-6,76%	8,38%
ITAÚ DUNAMIS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.131.901,21	0,00	15.000,00	1.971.959,07	-144.942,14	-6,80%	-6,80%	7,04%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5.124.344,94	0,00	0,00	4.751.827,60	-372.517,34	-7,27%	-7,27%	7,69%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.277.179,20	0,00	0,00	1.183.477,84	-93.701,36	-7,34%	-7,34%	8,82%
BRADESCO INSTITUCIONAL IBX ALPHA FIC AÇÕES	1.574.913,38	0,00	0,00	1.457.069,68	-117.843,70	-7,48%	-7,48%	8,36%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	1.339.525,62	0,00	0,00	1.239.145,93	-100.379,69	-7,49%	-7,49%	7,40%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FI AÇÕES	4.630.643,07	0,00	0,00	4.244.434,34	-386.208,73	-8,34%	-8,34%	8,25%
SULAMÉRICA SELECTION FIC AÇÕES	1.595.585,10	0,00	0,00	1.458.525,54	-137.059,56	-8,59%	-8,59%	10,26%
MULTINVEST SMALL CAPS FI AÇÕES	461.532,80	0,00	0,00	418.128,77	-43.404,03	-9,40%	-9,40%	7,92%
SOMMA BRASIL FI AÇÕES	5.438.907,58	0,00	0,00	4.907.355,87	-531.551,71	-9,77%	-9,77%	8,61%
MULTINVEST FI AÇÕES	1.999.517,20	0,00	0,00	1.796.668,29	-202.848,91	-10,14%	-10,14%	8,50%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>52.121.573,41</b>	<b>0,00</b>	<b>15.000,00</b>	<b>48.729.663,06</b>	<b>-3.376.910,35</b>	<b>-6,48%</b>		<b>8,57%</b>

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.

Os 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 e 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.

