

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 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	3.138.176,92	4,41%	675	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.116.602,20	2,98%	359	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	3.799.766,55	5,35%	135	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	4.766.650,27	6,71%	339	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	2.342.523,16	3,30%	449	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	0,01	0,00%	236	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	4.062.852,29	5,72%	280	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.747.299,21	5,27%	936	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.889.346,87	4,06%	28	4,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.137.308,30	8,63%	926	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.155.911,99	3,03%	705	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.076.161,89	2,92%	294	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	3.340.576,43	4,70%	73.719	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.560.694,53	9,23%	154	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	593.121,17	0,83%	1.078	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.532.232,13	10,60%	327	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.021.957,05	14,10%	1.002	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA R...	D+0	Não há	2.723.401,42	3,83%	470	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	3.085.475,30	4,34%	3.277	0,18%	Artigo 10º, Inciso I
SANTANDER PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	0,01	0,00%	4.863	0,00%	Desenquadrado - RF

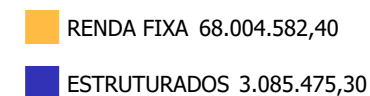
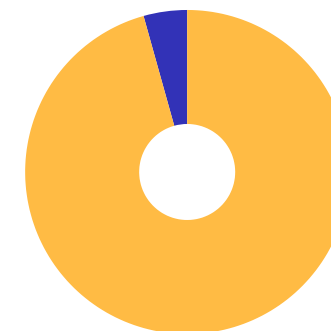


Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			71.090.057,70				

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

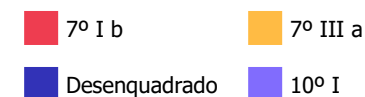
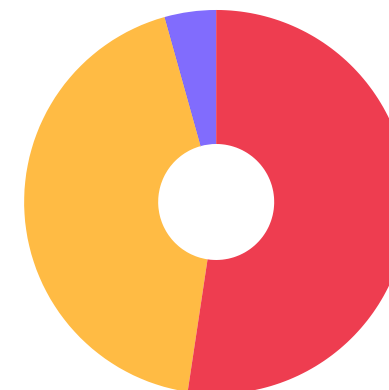
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	26,24%	86,17%	61.258.302,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	37.232.599,66	52,37%	21,52%	28,69%	86,17%	24.025.703,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	30.771.982,73	43,29%	21,34%	28,45%	60,00%	11.882.051,89
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	14.218.011,54
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.554.502,89
Desenquadrado - RF	0,00%	0,01	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-0,01
Total Renda Fixa	100,00%	68.004.582,40	95,66%	42,86%	88,38%	257,34%	



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

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	14.218.011,54
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	3.085.475,30	4,34%	0,00%	3,62%	10,00%	4.023.530,47
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	3.085.475,30	4,34%	0,00%	5,62%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	7.109.005,77
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2023)

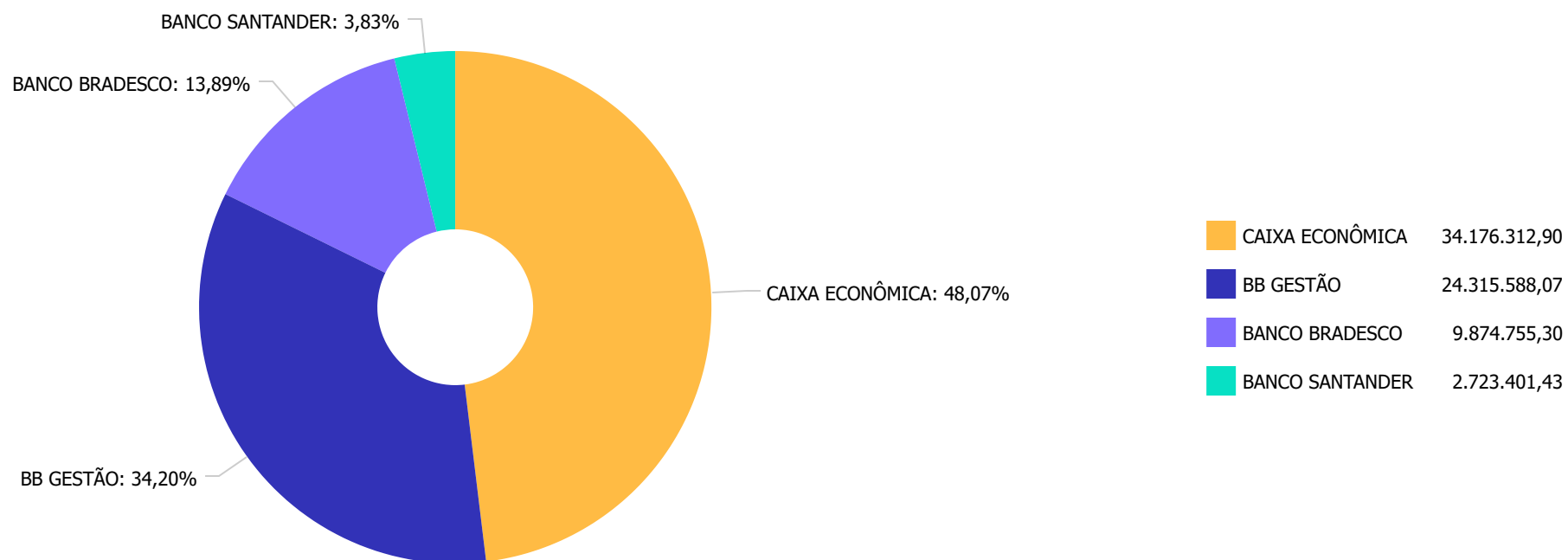
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	34.176.312,90	48,07	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.315.588,07	34,20	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.874.755,30	13,89	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.723.401,43	3,83	0,00

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)

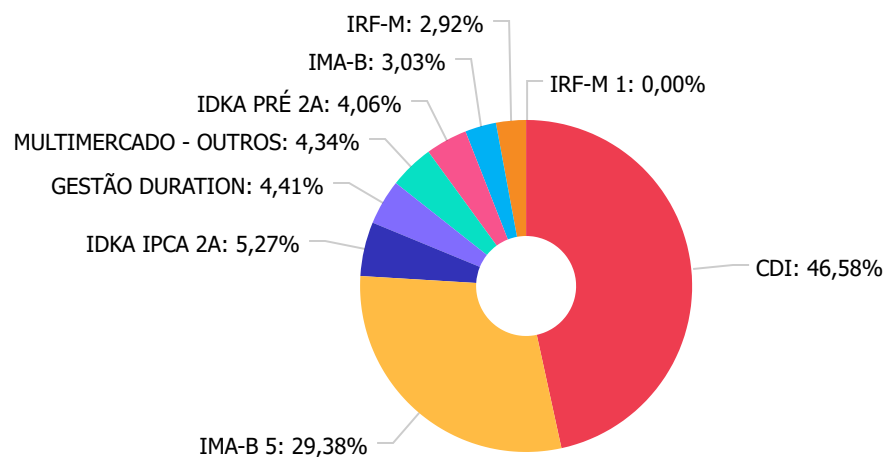
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	86,17
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	37.232.599,66	52,37	21,52	86,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	30.771.982,73	43,29	21,34	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	3.085.475,30	4,34	0,00	10,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	5,00

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



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

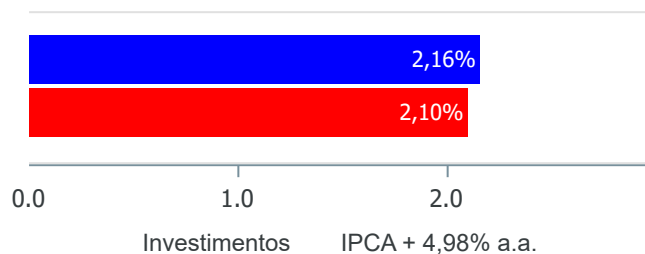


■ CDI	33.114.505,90	■ IMA-B 5	20.883.179,61	■ IDKA IPCA 2A	3.747.299,21	■ GESTÃO DURATION	3.138.176,92
■ MULTIMERCADO - OUTROS	3.085.475,30	■ IDKA PRÉ 2A	2.889.346,87	■ IMA-B	2.155.911,99	■ IRF-M	2.076.161,89
■ IRF-M 1	0,01						

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	69.956.795,26	113.101,56	659.000,00	70.171.122,20	760.225,38	760.225,38	1,09%	1,09%	0,96%	0,96%	113,50%	0,77%
Fevereiro	70.171.122,20	875.276,48	703.958,83	71.090.057,70	747.617,85	1.507.843,23	1,06%	2,16%	1,14%	2,10%	102,71%	1,00%

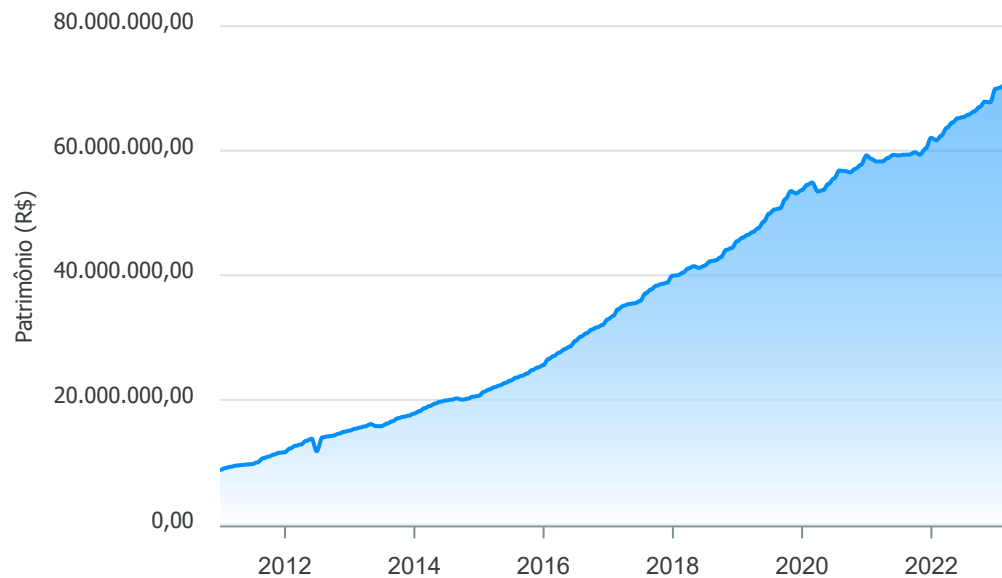
Investimentos x Meta de Rentabilidade



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

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	3.736.025,45	0,00	0,00	3.799.766,55	63.741,10	1,71%	1,71%	2,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.691.780,44	0,00	0,00	3.747.299,21	55.518,77	1,50%	1,50%	1,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.053.128,77	0,00	0,00	6.137.308,30	84.179,53	1,39%	1,39%	1,18%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.128.476,53	0,00	120.822,42	4.062.852,29	55.198,18	1,34%	-1,59%	5,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.129.141,60	0,00	0,00	2.155.911,99	26.770,39	1,26%	1,26%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.977.072,87	863.136,41	133.136,41	4.766.650,27	59.577,40	1,23%	1,34%	1,28%
BB ATIVA PLUS FIC RENDA FIXA LP	3.301.401,74	0,00	0,00	3.340.576,43	39.174,69	1,19%	1,19%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA PRÉ 2A FIC RENDA FIXA LP	2.859.303,97	0,00	0,00	2.889.346,87	30.042,90	1,05%	1,05%	1,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.107.821,59	0,00	0,00	3.138.176,92	30.355,33	0,98%	0,98%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.097.413,64	0,00	0,00	2.116.602,20	19.188,56	0,91%	0,91%	0,42%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	2.321.446,72	0,00	0,00	2.342.523,16	21.076,44	0,91%	0,91%	0,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.466.620,93	0,00	0,00	7.532.232,13	65.611,20	0,88%	0,88%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	576.012,06	12.140,07	0,00	593.121,17	4.969,04	0,84%	0,85%	0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.059.073,79	0,00	0,00	2.076.161,89	17.088,10	0,83%	0,83%	1,59%
SANTANDER INSTITUCIONAL PREMIUM FIC RENDA FIXA REF...	2.701.595,73	0,00	0,00	2.723.401,42	21.805,69	0,81%	0,81%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.389.569,16	0,00	450.000,00	10.021.957,05	82.387,89	0,79%	0,80%	0,04%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	6.514.988,50	0,00	0,00	6.560.694,53	45.706,03	0,70%	0,70%	0,31%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,97%	0,32%
SANTANDER PREMIUM FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,82%	0,07%
Total Renda Fixa	67.110.873,51	875.276,48	703.958,83	68.004.582,40	722.391,24	1,07%		1,04%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável/Estruturados/Imobiliário	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	3.060.248,69	0,00	0,00	3.085.475,30	25.226,61	0,82%	0,82%	0,08%
Total Renda Variável	3.060.248,69	0,00	0,00	3.085.475,30	25.226,61	0,82%		0,08%

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.

