

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2023



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

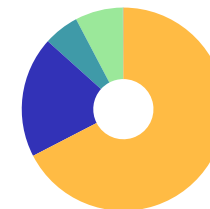
| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|---------|------------|------------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 1.080.732.507,66 | 46,96% | | 0,00% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a ' |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1 | Não há | 84.737.340,58 | 3,68% | 977 | 1,18% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI... | D+0 | 15/08/2024 | 3.370.801,17 | 0,15% | 140 | 1,81% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR... | D+0 | 15/08/2024 | 10.643.910,97 | 0,46% | 92 | 5,11% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0 | Não há | 82.196.237,29 | 3,57% | 948 | 1,20% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE... | D+0 | Não há | 183.200.370,65 | 7,96% | 1.070 | 1,41% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | D+0 | Não há | 4.825,57 | 0,00% | 16.475 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 106.410.391,09 | 4,62% | 317 | 2,91% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | D+3 | Não há | 40.748.891,25 | 1,77% | 25.211 | 3,03% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 37.896.433,23 | 1,65% | 33.430 | 4,00% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 35.703.679,67 | 1,55% | 25.055 | 2,53% | Artigo 8º, Inciso I |
| BRANCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | D+3 | Não há | 25.071.867,83 | 1,09% | 50 | 7,86% | Artigo 8º, Inciso I |
| BRANCO SELECTION FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 64.220.279,78 | 2,79% | 151 | 13,88% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 33.555.263,56 | 1,46% | 1.262 | 5,13% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | D+15 | Não há | 36.498.977,30 | 1,59% | 193 | 5,87% | Artigo 8º, Inciso I |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | D+4 | Não há | 59.531.150,48 | 2,59% | 96 | 12,20% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | D+24 | Não há | 53.706.443,90 | 2,33% | 20.840 | 2,41% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 44.978.767,36 | 1,95% | 44 | 7,47% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ... | D+24 | Não há | 8.256.107,25 | 0,36% | 17 | 5,30% | Artigo 8º, Inciso I |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | D+33 | Não há | 963.328,31 | 0,04% | 3.234 | 0,46% | Artigo 8º, Inciso I |

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

| Produto / Fundo | Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | Enquadramento |
|---|------------|---------------|-------------------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------|
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | D+3 | Não há | 1.624.142,34 | 0,07% | 214 | 0,98% | Artigo 8º, Inciso I |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR... | D+5 du | Não há | 30.307.607,64 | 1,32% | 62 | 2,46% | Artigo 9º, Inciso II |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI... | D+5 du | Não há | 29.115.322,88 | 1,27% | 59 | 4,83% | Artigo 9º, Inciso II |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N... | D+12 | Não há | 11.306.684,35 | 0,49% | 734 | 13,82% | Artigo 9º, Inciso II |
| ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO... | D+5 du | Não há | 5.568.220,59 | 0,24% | 98 | 1,75% | Artigo 9º, Inciso II |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME... | D+8 | Não há | 28.183.520,77 | 1,22% | 7.065 | 2,92% | Artigo 9º, Inciso II |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+4 | Não há | 20.549.142,03 | 0,89% | 505 | 1,04% | Artigo 9º, Inciso III |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | D+5 | Não há | 4.890.783,58 | 0,21% | 501 | 0,55% | Artigo 9º, Inciso III |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | D+1 | Não há | 86.709.229,70 | 3,77% | 8.463 | 4,93% | Artigo 10º, Inciso I |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 88.712.836,56 | 3,85% | 755 | 7,51% | Artigo 10º, Inciso I |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | Não se ... | Não se aplica | 1.902.000,00 | 0,08% | | 1,90% | Artigo 11º |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | D+0 | | 19.566,35 | 0,00% | | 0,00% | DF - Artigo 6º |
| Total para cálculo dos limites da Resolução | | | 2.301.297.065,34 | | | | |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS | | | 19.566,35 | Artigo 6º | | | |
| PL Total | | | 2.301.316.631,69 | | | | |

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

| Artigos - Renda Fixa | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------------------|-----------------------------------|-------------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|------------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a' | 100,00% | 1.080.732.507,66 | 46,96% | 10,00% | 60,00% | 100,00% | 1.220.564.557,68 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' | 100,00% | 180.948.290,01 | 7,86% | 0,00% | 3,00% | 90,00% | 1.890.219.068,80 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c' | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 90,00% | 2.071.167.358,81 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 65,00% | 289.615.587,31 | 12,58% | 2,00% | 3,00% | 65,00% | 1.206.227.505,16 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 65,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 65,00% | 1.495.843.092,47 |
| Artigo 7º, Inciso IV | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 115.064.853,27 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 1.551.296.384,98 | 67,41% | 12,00% | 66,00% | 415,00% | |



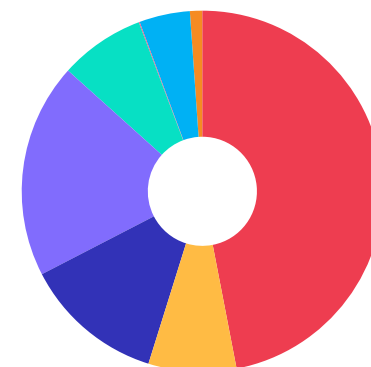
| | |
|-------------------|------------------|
| RENDA FIXA | 1.551.296.384,98 |
| RENDA VARIÁVEL | 442.755.332,26 |
| EXTERIOR | 129.921.281,84 |
| ESTRUTURADOS | 175.422.066,26 |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 1.902.000,00 |

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!

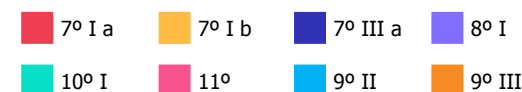


Enquadramento e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2023)

| Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - 2023 | | | GAP Superior |
|---|--------------------------------------|-----------------------|---------------|----------------------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | | | | Inf | Alvo | Sup | |
| Artigo 8º, Inciso I | 35,00% | 442.755.332,26 | 19,24% | 0,00% | 18,20% | 35,00% | 362.698.640,61 |
| Artigo 8º, Inciso II | 35,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 35,00% | 805.453.972,87 |
| Artigo 10º, Inciso I | 10,00% | 175.422.066,26 | 7,62% | 0,00% | 9,50% | 10,00% | 54.707.640,27 |
| Artigo 10º, Inciso II | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 115.064.853,27 |
| Artigo 11º | 5,00% | 1.902.000,00 | 0,08% | 0,00% | 0,30% | 5,00% | 113.162.853,27 |
| Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário | 35,00% | 620.079.398,52 | 26,94% | 0,00% | 28,00% | 90,00% | |



| Artigos - Exterior | Resolução Pró Gestão - Nível 1 | Carteira \$ | Carteira | Estratégia de Alocação - Limite - 2023 | | | GAP Superior |
|-----------------------|-----------------------------------|-----------------------|--------------|--|--------------|---------------|-----------------|
| | | | | Inferior | Alvo | Superior | |
| Artigo 9º, Inciso II | 10,00% | 104.481.356,23 | 4,54% | 0,00% | 4,30% | 10,00% | 125.648.350,30 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00% | 25.439.925,61 | 1,11% | 0,00% | 1,70% | 10,00% | 204.689.780,92 |
| Total Exterior | 10,00% | 129.921.281,84 | 5,65% | 0,00% | 6,00% | 20,00% | |



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

| Gestão | Valor | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|------------------|---------------|----------------|
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL... | 1.080.732.507,66 | 46,96 | - |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 455.724.358,04 | 19,80 | - |
| CAIXA DTVM | 332.253.510,28 | 14,44 | - |
| ITAÚ UNIBANCO | 200.691.448,24 | 8,72 | 0,04 |
| ITAÚ DTVM | 106.941.318,51 | 4,65 | 0,02 |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT | 89.292.147,61 | 3,88 | 0,01 |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 28.183.520,77 | 1,22 | 0,01 |
| BANCO J. SAFRA S/A | 7.478.254,23 | 0,32 | 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 ' | 1.080.732.507,66 | 46,96 | 10,00 | 100,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' | 180.948.290,01 | 7,86 | 0,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 90,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 289.615.587,31 | 12,58 | 2,00 | 65,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 65,00 |
| Artigo 8º, Inciso I | 442.755.332,26 | 19,24 | 0,00 | 35,00 |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 35,00 |
| Artigo 9º, Inciso II | 104.481.356,23 | 4,54 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 9º, Inciso III | 25.439.925,61 | 1,11 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso I | 175.422.066,26 | 7,62 | 0,00 | 10,00 |
| Artigo 10º, Inciso II | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 5,00 |
| Artigo 11º | 1.902.000,00 | 0,08 | 0,00 | 1,00 |
| Artigo 12º | 0,00 | 0,00 | 0,00 | 10,00 |

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% |

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| CDI (Benchmark) | 1,12% | 1,12% | 3,30% | 6,71% | 12,81% | 18,45% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,13% | 1,13% | 3,37% | 6,92% | 13,47% | 20,02% | 0,02% | 0,00% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,89% | 0,89% | 2,61% | 5,31% | 10,00% | 13,21% | 0,00% | 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% |

| | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|-------|
| IPCA (Benchmark) | 0,53% | 0,53% | 1,57% | 1,50% | 5,77% | 16,75% | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,38% | 1,38% | 2,19% | 4,44% | 11,73% | 18,11% | 0,93% | 0,03% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,38% | 1,38% | 2,19% | 4,41% | 11,43% | 17,13% | 0,93% | 0,03% |

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% | - | - |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 6,49% | 6,49% | 7,50% | 3,38% | -0,97% | 24,72% | 7,50% | 0,24% |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | 5,92% | 5,92% | 6,77% | 2,22% | -2,94% | 20,10% | 6,96% | 0,23% |

| | | | | | | | | |
|--------------------------------|-------|-------|-------|--------|---------|--------|---|---|
| Global BDRX (Benchmark) | 4,37% | 4,37% | 7,06% | -3,63% | -16,72% | -5,42% | - | - |
|--------------------------------|-------|-------|-------|--------|---------|--------|---|---|

| | | | | | | | | |
|--|-------|-------|--------|--------|--------|---------|--------|-------|
| Ibovespa (Benchmark) | 3,37% | 3,37% | -2,25% | 9,95% | 1,15% | -1,42% | - | - |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 3,36% | 3,36% | -4,05% | 9,16% | 1,55% | -7,63% | 10,02% | 0,20% |
| BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | 3,40% | 3,40% | -2,14% | 10,04% | 1,14% | -1,67% | 10,51% | 0,21% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 3,30% | 3,30% | -2,12% | 9,99% | 1,37% | -1,47% | 10,30% | 0,21% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 4,46% | 4,46% | -2,30% | 7,42% | -2,65% | 2,26% | 10,20% | 0,20% |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 6,69% | 6,69% | -5,82% | 5,64% | -5,20% | -13,91% | 9,93% | 0,24% |
| BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES | 3,93% | 3,93% | -2,67% | 10,30% | 4,31% | -5,91% | 10,13% | 0,22% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 2,42% | 2,42% | -4,62% | 11,26% | 6,28% | 0,01% | 10,29% | 0,23% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 3,52% | 3,52% | -8,11% | 5,22% | -3,84% | -11,80% | 9,75% | 0,22% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | 3,80% | 3,80% | -6,37% | 4,71% | -8,72% | -20,07% | 10,31% | 0,21% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 3,30% | 3,30% | -3,17% | 5,45% | 4,39% | 15,93% | 9,08% | 0,18% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 3,11% | 3,11% | -8,12% | 5,04% | -5,21% | -19,94% | 10,27% | 0,23% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | 5,07% | 5,07% | -7,18% | 7,87% | -7,77% | -24,82% | 10,52% | 0,25% |

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

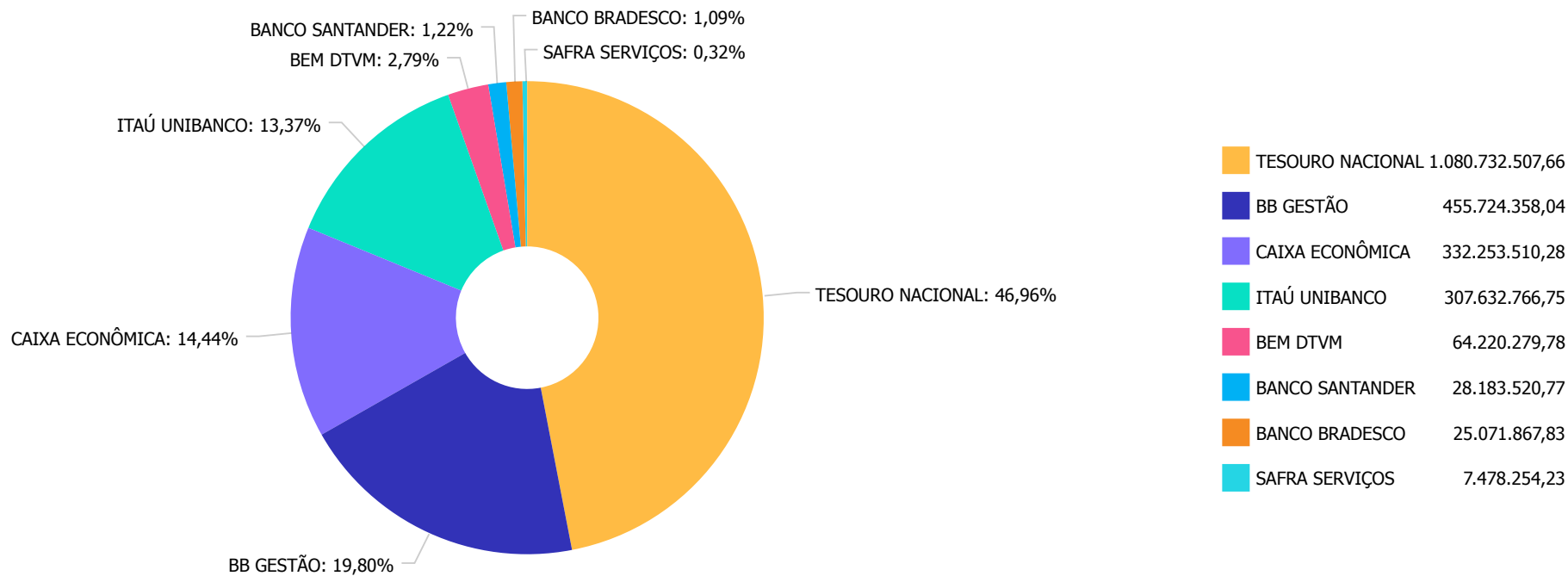
| | Mês | Ano | 3M | 6M | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|-------|-------|-------|--------|---------|--------|---------|------------------|
| MSCI ACWI (Benchmark) | 4,67% | 4,67% | 7,25% | -0,08% | -13,97% | -6,09% | - | - |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 6,53% | 6,53% | 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% |

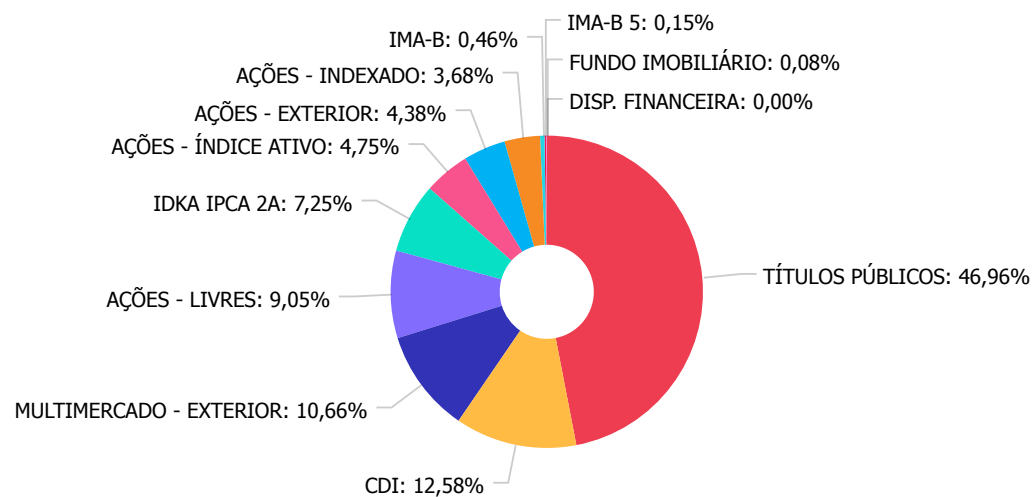
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

| | 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% | - | - |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU... | - | 2,76% | 8,20% | - | -15,67% | - | 10,10% | 17,39% |
| MSCI WORLD (Benchmark) | 4,58% | 4,58% | 6,03% | -0,33% | -13,34% | -2,56% | - | - |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO | - | 2,57% | 9,32% | - | -9,02% | - | 12,06% | 16,39% |

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



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



| | | | | | | | |
|------------------|------------------|----------------------|----------------|-------------------------|----------------|------------------|----------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | 1.080.732.507,66 | CDI | 289.615.587,31 | MULTIMERCADO - EXTERIOR | 245.219.879,02 | AÇÕES - LIVRES | 208.204.375,56 |
| IDKA IPCA 2A | 166.933.577,87 | AÇÕES - ÍNDICE ATIVO | 109.199.047,14 | AÇÕES - EXTERIOR | 100.872.360,33 | AÇÕES - INDEXADO | 84.603.018,31 |
| IMA-B | 10.643.910,97 | IMA-B 5 | 3.370.801,17 | FUNDO IMOBILIÁRIO | 1.902.000,00 | DISP. FINANCEIRA | 19.566,35 |

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 | 15/05/2023 | 17/12/2021 | 13.149 | 3.802,324181 | 4.077,384721 | 49.996.760,66 | 53.613.531,70 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2023 | 17/12/2021 | 39.450 | 3.802,324181 | 4.077,384721 | 150.001.688,94 | 160.852.827,24 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2023 | 14/01/2022 | 11.606 | 3.834,196131 | 4.075,277781 | 44.499.680,30 | 47.297.673,93 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2023 | 14/01/2022 | 13.692 | 3.834,196131 | 4.075,277781 | 52.497.813,43 | 55.798.703,38 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2023 | 28/01/2022 | 521 | 3.832,607958 | 4.070,440663 | 1.996.788,75 | 2.120.699,59 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2023 | 23/05/2022 | 805 | 3972,610228 | 4.076,857986 | 3.197.951,23 | 3.281.870,68 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2023 | 23/05/2022 | 1.510 | 3972,610228 | 4.076,857986 | 5.998.641,44 | 6.156.055,56 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 14/06/2022 | 9.875 | 4049,567430 | 4.132,941211 | 39.989.478,37 | 40.812.794,46 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 29/08/2022 | 7.642 | 3925,476529 | 4.092,197641 | 29.998.491,63 | 31.272.574,37 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 23/11/2022 | 3.761 | 3988,237004 | 4.088,329555 | 14.999.759,37 | 15.376.207,46 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 23/11/2022 | 1.254 | 3988,237004 | 4.088,329555 | 5.001.249,20 | 5.126.765,26 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 28/11/2022 | 2.515 | 3977,260022 | 4.071,815804 | 10.002.808,96 | 10.240.616,75 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 28/11/2022 | 3.771 | 3977,260022 | 4.071,815804 | 14.998.247,54 | 15.354.817,40 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2030 | 09/03/2022 | 10.335 | 3870,303778 | 4.148,546243 | 39.999.589,55 | 42.875.225,42 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 07/07/2022 | 9.782 | 4089,215327 | 4.135,643242 | 40.000.704,33 | 40.454.862,19 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 11/07/2022 | 7.384 | 4062,955171 | 4.107,649880 | 30.000.860,98 | 30.330.886,71 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2032 | 16/09/2022 | 9.987 | 4004,964372 | 4.158,224500 | 39.997.579,18 | 41.528.188,08 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 25/02/2022 | 10.047 | 3.981,059981 | 4.161,276347 | 39.997.709,63 | 41.808.343,46 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 04/03/2022 | 15.090 | 3976,077337 | 4.147,452564 | 59.999.007,02 | 62.585.059,19 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 29/06/2022 | 296 | 4047,135758 | 4.106,343094 | 1.197.952,18 | 1.215.477,56 | Curva |

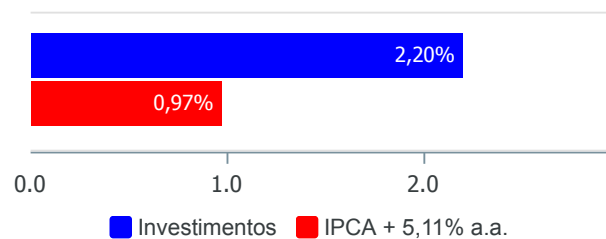
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2023)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | Marcação |
|--|------------|------------|--------|--------------|--------------|---------------|---------------|----------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 07/07/2022 | 498 | 4019,563107 | 4.065,776443 | 2.001.742,43 | 2.024.756,67 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 07/03/2022 | 10.178 | 3929,750612 | 4.215,867826 | 39.997.001,73 | 42.909.102,73 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 08/03/2022 | 10.225 | 3.911,428571 | 4.194,251578 | 39.994.357,14 | 42.886.222,39 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2040 | 15/03/2022 | 3.890 | 3895,024106 | 4.159,989666 | 15.151.643,77 | 16.182.359,80 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 25/02/2022 | 15.015 | 3.995,877115 | 4.179,177302 | 59.998.094,88 | 62.750.347,19 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 10/05/2022 | 2.400 | 4129,737582 | 4.149,487129 | 9.911.370,20 | 9.958.769,11 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 09/05/2022 | 4.840 | 4131,678715 | 4.154,412706 | 19.997.324,98 | 20.107.357,50 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 11/05/2022 | 2.310 | 4113,158402 | 4.129,865238 | 9.501.395,91 | 9.539.988,70 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 27/06/2022 | 223 | 4039,820802 | 4.105,530877 | 900.880,04 | 915.533,39 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2045 | 27/06/2022 | 520 | 4039,820802 | 4.105,530877 | 2.100.706,82 | 2.134.876,06 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2050 | 11/05/2022 | 4.940 | 4048,514642 | 4.183,833480 | 19.999.662,33 | 20.668.137,39 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2050 | 15/06/2022 | 9.790 | 4085,727657 | 4.167,778109 | 39.999.273,76 | 40.802.547,69 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2055 | 06/07/2022 | 5.050 | 3962,882939 | 4.011,132693 | 20.012.558,84 | 20.256.220,10 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 29/06/2022 | 4.935 | 4052,223528 | 4.112,937336 | 19.997.723,11 | 20.297.345,75 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 07/07/2022 | 5.024 | 3981,139802 | 4.027,469526 | 20.001.246,37 | 20.234.006,90 | Curva |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2060 | 23/11/2022 | 10.213 | 3916,628783 | 4.010,746689 | 40.000.529,76 | 40.961.755,93 | 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 | 2.228.676.184,81 | 156.376.748,48 | 133.604.967,93 | 2.300.984.841,17 | 49.536.875,81 | 49.536.875,81 | 2,20% | 2,20% | 0,97% | 0,97% | 227,21% | 5,89% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade

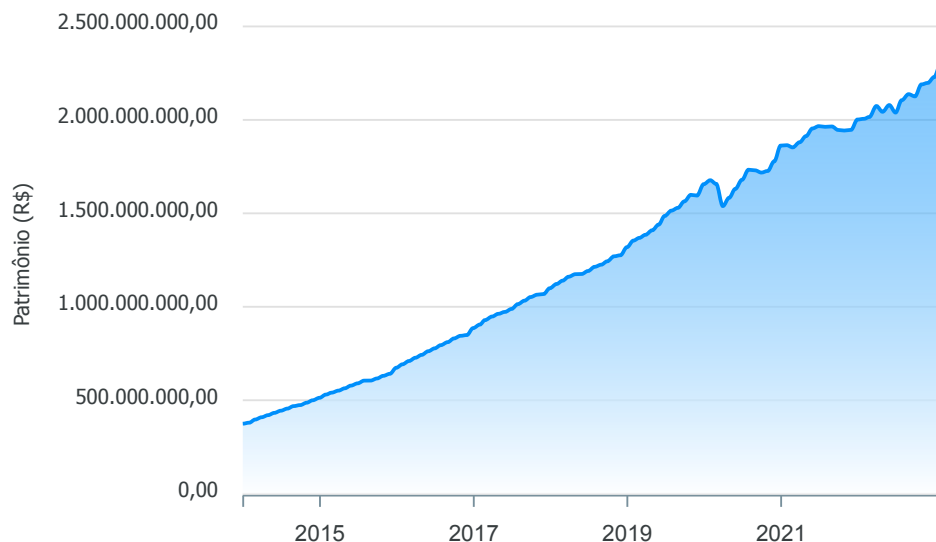


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

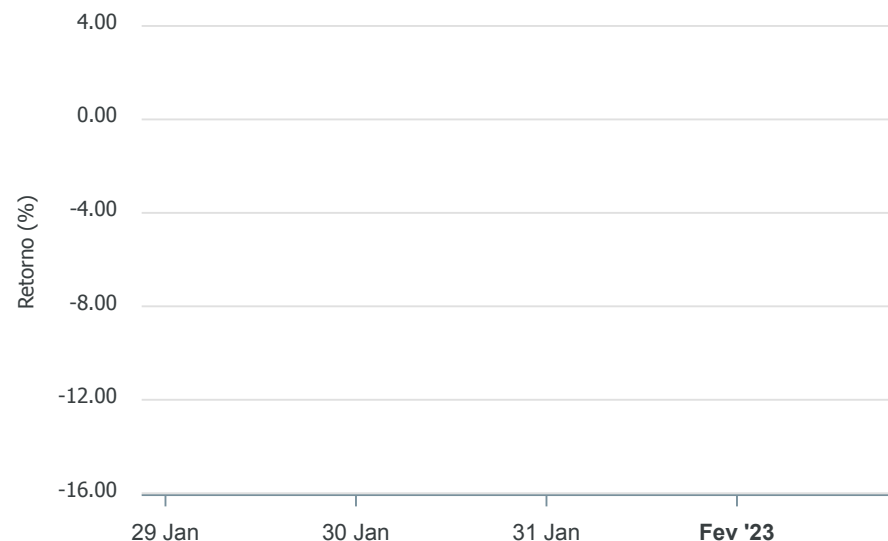
ANO

36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- ☒ 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 Janeiro/2023

FUNDOS DE RENDA FIXA

| Ativos Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-------------------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|----------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 81.037.598,75 | 16.800,00 | 0,00 | 82.196.237,29 | 1.141.838,54 | 1,41% | 1,41% | 1,19% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 182.185.160,86 | 0,00 | 100.000.000,00 | 84.737.340,58 | 2.552.179,72 | 1,40% | 1,44% | 1,15% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 10.498.689,42 | 0,00 | 0,00 | 10.643.910,97 | 145.221,55 | 1,38% | 1,38% | 0,93% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE... | 3.324.825,44 | 0,00 | 0,00 | 3.370.801,17 | 45.975,73 | 1,38% | 1,38% | 0,93% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 1.067.976.064,80 | 0,00 | 0,00 | 1.080.732.507,66 | 12.756.442,86 | 1,19% | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 93.031.393,40 | 12.201.831,44 | 0,00 | 106.410.391,09 | 1.177.166,25 | 1,12% | 1,13% | 0,02% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC... | 71.108.336,35 | 144.310.000,00 | 33.433.060,27 | 183.200.370,65 | 1.215.094,57 | 0,56% | 1,12% | 0,01% |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 4.758,56 | 45.117,04 | 45.117,04 | 4.825,57 | 67,01 | 0,13% | 0,88% | 0,00% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 400.000,00 | 400.190,62 | 0,00 | 190,62 | 0,05% | 1,03% | 0,01% |
| Total Renda Fixa | 1.509.166.827,58 | 156.973.748,48 | 133.878.367,93 | 1.551.296.384,98 | 19.034.176,85 | 1,24% | | 0,45% |

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 |
|--|-----------------------|-------------|------------------|-----------------------|----------------------|--------------|------------|--------------|
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES | 35.520.979,70 | 0,00 | 0,00 | 37.896.433,23 | 2.375.453,53 | 6,69% | 6,69% | 9,93% |
| CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 81.397.330,81 | 0,00 | 0,00 | 86.709.229,70 | 5.311.898,89 | 6,53% | 6,53% | 7,51% |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO | 83.308.679,75 | 0,00 | 0,00 | 88.712.836,56 | 5.404.156,81 | 6,49% | 6,49% | 7,50% |
| BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES | 38.470.176,55 | 0,00 | 0,00 | 40.748.891,25 | 2.278.714,70 | 5,92% | 5,92% | 6,96% |
| SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES | 916.843,29 | 0,00 | 0,00 | 963.328,31 | 46.485,02 | 5,07% | 5,07% | 10,52% |
| BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES | 34.180.085,74 | 0,00 | 0,00 | 35.703.679,67 | 1.523.593,93 | 4,46% | 4,46% | 10,20% |
| BRDESCO SELECTION FIC AÇÕES | 61.794.096,48 | 0,00 | 0,00 | 64.220.279,78 | 2.426.183,30 | 3,93% | 3,93% | 10,13% |
| SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES | 1.564.648,36 | 0,00 | 0,00 | 1.624.142,34 | 59.493,98 | 3,80% | 3,80% | 10,31% |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES | 32.415.963,37 | 0,00 | 0,00 | 33.555.263,56 | 1.139.300,19 | 3,51% | 3,51% | 9,75% |
| BRDESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES | 24.247.722,02 | 0,00 | 0,00 | 25.071.867,83 | 824.145,81 | 3,40% | 3,40% | 10,51% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 43.517.339,28 | 0,00 | 0,00 | 44.978.767,36 | 1.461.428,08 | 3,36% | 3,36% | 10,02% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES | 35.331.619,87 | 0,00 | 0,00 | 36.498.977,30 | 1.167.357,43 | 3,30% | 3,30% | 9,08% |
| CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES | 57.632.150,40 | 0,00 | 0,00 | 59.531.150,48 | 1.899.000,08 | 3,30% | 3,30% | 10,30% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES | 8.007.061,48 | 0,00 | 0,00 | 8.256.107,25 | 249.045,77 | 3,11% | 3,11% | 10,27% |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES | 52.438.724,82 | 0,00 | 0,00 | 53.706.443,90 | 1.267.719,08 | 2,42% | 2,42% | 10,29% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 1.890.000,00 | 0,00 | 16.800,00 | 1.902.000,00 | 28.800,00 | 1,52% | 0,63% | 8,18% |
| Total Renda Variável | 592.633.421,92 | 0,00 | 16.800,00 | 620.079.398,52 | 27.462.776,60 | 4,63% | | 9,12% |

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|-----------------------|-------------|-------------|-----------------------|---------------------|--------------|------------|---------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 19.698.670,78 | 0,00 | 0,00 | 20.549.142,03 | 850.471,25 | 4,32% | 4,32% | 8,80% |
| ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ... | 5.360.955,67 | 0,00 | 0,00 | 5.568.220,59 | 207.264,92 | 3,87% | 3,87% | 9,69% |
| CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ... | 11.003.265,49 | 0,00 | 0,00 | 11.306.684,35 | 303.418,86 | 2,76% | 2,76% | 10,10% |
| BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F... | 29.547.850,20 | 0,00 | 0,00 | 30.307.607,64 | 759.757,44 | 2,57% | 2,57% | 12,06% |
| SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I | 4.769.058,13 | 0,00 | 0,00 | 4.890.783,58 | 121.725,45 | 2,55% | 2,55% | 8,14% |
| SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT... | 27.653.939,99 | 0,00 | 0,00 | 28.183.520,77 | 529.580,78 | 1,92% | 1,92% | 8,19% |
| BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME... | 28.842.195,05 | 0,00 | 0,00 | 29.115.322,88 | 273.127,83 | 0,95% | 0,95% | 11,46% |
| Total Exterior | 126.875.935,31 | 0,00 | 0,00 | 129.921.281,84 | 3.045.346,53 | 2,40% | | 10,15% |

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.