

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2023

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 (Fevereiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.153.313.646,64	50,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	3.318.543,08	0,15%	140	1,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	10.478.200,44	0,46%	92	5,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	83.449.307,75	3,65%	936	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	209.889.871,11	9,18%	1.078	1,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	30,74	0,00%	16.580	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	107.285.192,17	4,69%	334	2,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	40.077.610,07	1,75%	24.448	3,14%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	34.834.072,74	1,52%	32.677	4,06%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	32.666.953,11	1,43%	24.240	2,55%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	D+3	Não há	23.192.620,72	1,01%	52	7,50%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	59.414.605,12	2,60%	149	14,14%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	31.226.194,18	1,37%	1.226	5,18%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	34.364.995,28	1,50%	189	5,94%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	55.110.935,01	2,41%	94	12,56%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	50.054.200,47	2,19%	20.172	2,49%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	41.872.367,96	1,83%	42	7,76%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	7.687.431,96	0,34%	17	5,30%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+33	Não há	891.226,84	0,04%	3.036	0,48%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.504.202,91	0,07%	209	0,99%	Artigo 8º, Inciso I



**CRÉDITO
& MERCADO**

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)

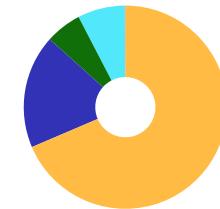
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	D+5 du	Não há	31.074.893,78	1,36%	68	2,57%	Artigo 9º, Inciso II
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	29.577.685,80	1,29%	59	4,84%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	11.396.438,45	0,50%	721	13,92%	Artigo 9º, Inciso II
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIO...	D+5 du	Não há	5.350.455,06	0,23%	94	1,79%	Artigo 9º, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIME...	D+8	Não há	28.309.149,76	1,24%	6.689	3,07%	Artigo 9º, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	20.703.203,44	0,91%	502	1,04%	Artigo 9º, Inciso III
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.902.096,86	0,21%	483	0,58%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	85.191.357,68	3,73%	8.152	5,09%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	87.129.803,96	3,81%	733	7,64%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.849.200,00	0,08%		1,90%	Artigo 11º
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		37.710,49	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução				2.286.116.493,09			
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS				37.710,49			
				PL Total	2.286.154.203,58		



**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento e Política de Investimento (RENDAS FIXAS) - base (Fevereiro / 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%	1.153.313.646,64	50,45%	10,00%	60,00%	100,00%	1.132.802.846,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	97.246.051,27	4,25%	0,00%	3,00%	90,00%	1.960.258.792,51
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	90,00%	2.057.504.843,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	65,00%	317.175.094,02	13,87%	2,00%	3,00%	65,00%	1.168.800.626,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	65,00%	1.485.975.720,51
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	114.305.824,65
Total Renda Fixa	100,00%	1.567.734.791,93	68,58%	12,00%	66,00%	415,00%	



- █ RENDA FIXA 1.567.734.791,93
- █ RENDA VARIÁVEL 412.897.416,37
- █ EXTERIOR 131.313.923,15
- █ ESTRUTURADOS 172.321.161,64
- █ FUNDO IMOBILIÁRIO 1.849.200,00

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!

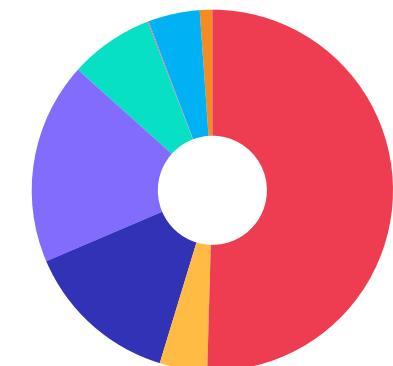




**CRÉDITO
& MERCADO**

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 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%	412.897.416,37	18,06%	0,00%	18,20%	35,00%	387.243.356,21
Artigo 8º, Inciso II	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	35,00%	800.140.772,58
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	172.321.161,64	7,54%	0,00%	9,50%	10,00%	56.290.487,67
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	114.305.824,65
Artigo 11º	5,00%	1.849.200,00	0,08%	0,00%	0,30%	5,00%	112.456.624,65
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	35,00%	587.067.778,01	25,68%	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%	105.708.622,85	4,62%	0,00%	4,30%	10,00%	122.903.026,46
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	25.605.300,30	1,12%	0,00%	1,70%	10,00%	203.006.349,01
Total Exterior	10,00%	131.313.923,15	5,74%	0,00%	6,00%	20,00%	

■ 7º I a	■ 7º I b	■ 7º III a	■ 8º I
■ 10º I	■ 11º	■ 9º II	■ 9º III



Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	1.153.313.646,64	50,45	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	391.917.830,13	17,14	-
CAIXA DTVM	323.291.662,53	14,14	-
ITAÚ UNIBANCO	199.765.451,19	8,74	0,05
ITAÚ DTVM	99.614.000,39	4,36	0,02
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	82.607.225,84	3,61	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	28.309.149,76	1,24	0,01
BANCO J. SAFRA S/A	7.297.526,61	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)

Artigos	Estratégia de Alocação - 2023		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	1.153.313.646,64	50,45	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	97.246.051,27	4,25	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	317.175.094,02	13,87	2,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	65,00
Artigo 8º, Inciso I	412.897.416,37	18,06	0,00	35,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	35,00
Artigo 9º, Inciso II	105.708.622,85	4,62	0,00	10,00
Artigo 9º, Inciso III	25.605.300,30	1,12	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso I	172.321.161,64	7,54	0,00	10,00
Artigo 10º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 11º	1.849.200,00	0,08	0,00	1,00
Artigo 12º	0,00	0,00	0,00	10,00



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,62%	3,08%	4,36%	6,05%	11,25%	18,71%	-	-
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%

CDI (Benchmark)	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,82%	1,96%	3,11%	6,53%	13,29%	20,83%	0,11%	0,00%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,73%	1,62%	2,52%	5,09%	10,17%	14,02%	0,00%	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%

IPCA (Benchmark)	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	2,74%	4,09%	6,02%	11,98%	20,23%	1,27%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	2,74%	4,09%	6,02%	11,70%	19,50%	1,27%	0,03%



**CRÉDITO
& MERCADO**

FUNDAÇÃO DA SEGURIDADE SOCIAL DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE SOROCABA

Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 28/02/2023

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
S&P 500 (Benchmark)	-2,61%	3,40%	-2,70%	0,38%	-9,45%	4,17%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,78%	4,59%	-0,45%	4,90%	-0,57%	19,27%	7,62%	0,24%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	-1,65%	4,18%	-0,60%	4,01%	-2,03%	15,06%	7,46%	0,23%
Global BDRX (Benchmark)	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-

Ibovespa (Benchmark)	-7,49%	-4,38%	-6,72%	-4,19%	-7,26%	-4,64%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-6,91%	-3,78%	-5,83%	-4,46%	-6,37%	-10,56%	7,61%	0,21%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	-7,50%	-4,35%	-6,63%	-4,13%	-7,24%	-4,87%	8,66%	0,22%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	-7,43%	-4,38%	-6,56%	-4,07%	-6,95%	-4,61%	8,57%	0,22%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-8,51%	-4,43%	-6,88%	-7,04%	-10,63%	-1,68%	8,62%	0,22%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-8,08%	-1,93%	-4,74%	-10,72%	-10,58%	-19,78%	8,40%	0,25%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	-7,48%	-3,85%	-6,33%	-6,03%	-1,59%	-10,03%	8,06%	0,23%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-6,80%	-4,55%	-2,83%	-2,67%	0,27%	-7,23%	7,04%	0,24%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-6,94%	-3,67%	-7,19%	-8,39%	-9,31%	-15,57%	7,52%	0,23%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	-7,39%	-3,86%	-5,69%	-9,17%	-13,63%	-25,04%	8,72%	0,22%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-5,85%	-2,74%	-5,15%	-6,66%	-1,33%	9,16%	7,56%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	-6,89%	-3,99%	-6,58%	-8,46%	-11,74%	-23,02%	7,55%	0,24%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-7,49%	-2,79%	-4,87%	-9,36%	-12,02%	-30,40%	8,55%	0,26%



**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
MSCI ACWI (Benchmark)	-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%

IFIX (Benchmark)	-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%



**CRÉDITO
& MERCADO**

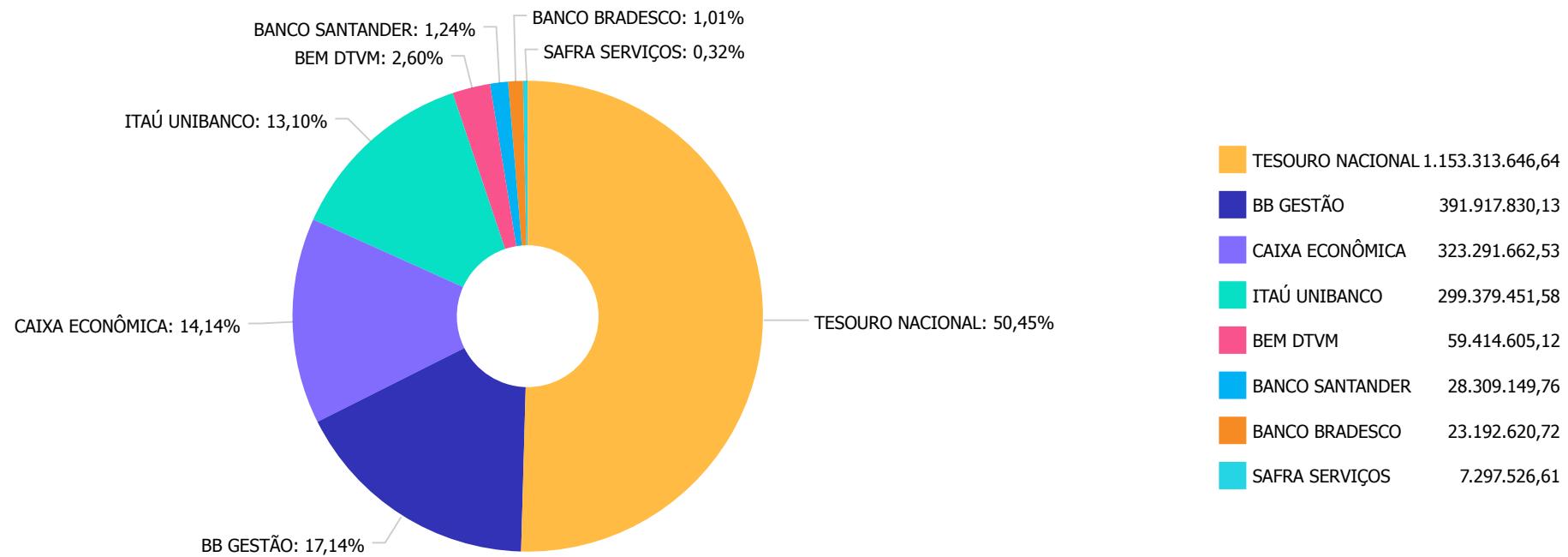
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	5,10%	0,14%	-	-	-	9,98%	18,28%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	2,79%	-1,45%	-	-	-	6,67%	17,48%
MSCI WORLD (Benchmark)	-0,45%	4,10%	-1,86%	3,90%	-7,70%	-6,26%	-	-
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	-	3,57%	-0,45%	-	-	-	6,96%	16,72%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	2,55%	-2,20%	-	-	-	7,49%	15,33%
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCADO	-	5,17%	0,99%	-	-	-	8,49%	16,11%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	-	2,37%	-1,53%	-	-	-	6,34%	16,22%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	-	-0,20%	0,85%	-	-	-	7,82%	23,19%



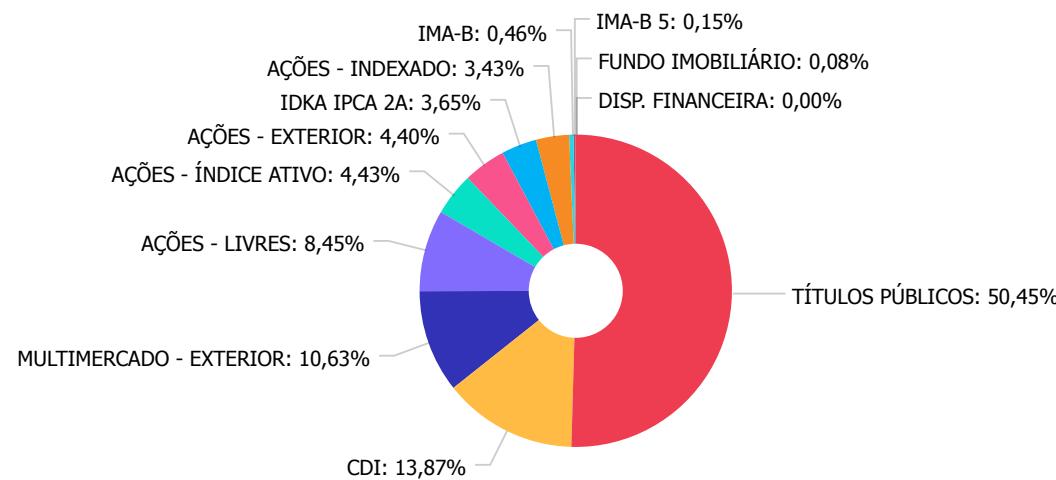
CRÉDITO
& MERCADO

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





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



■ TÍTULOS PÚBLICOS	1.153.313.646,64	■ CDI	317.175.094,02	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	243.101.643,63	■ AÇÕES - LIVRES	193.229.277,49
■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	101.286.973,08	■ AÇÕES - EXTERIOR	100.611.051,23	■ IDKA IPCA 2A	83.449.307,75	■ AÇÕES - INDEXADO	78.303.555,73
■ IMA-B	10.478.200,44	■ IMA-B 5	3.318.543,08	■ FUNDO IMOBILIÁRIO	1.849.200,00	■ DISP. FINANCEIRA	37.710,49



**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	15/05/2023	14/01/2022	11.606	3.834,196131	4.114,467392	44.499.680,30	47.752.508,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	14/01/2022	13.692	3.834,196131	4.114,467392	52.497.813,43	56.335.287,53	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	28/01/2022	521	3.832,607958	4.110,861072	1.996.788,75	2.141.758,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/05/2022	805	3972,610228	4.115,647937	3.197.951,23	3.313.096,59	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	23/05/2022	1.510	3972,610228	4.115,647937	5.998.641,44	6.214.628,38	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	17/12/2021	13.149	3.802,324181	4.116,040104	49.996.760,66	54.121.811,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	17/12/2021	39.450	3.802,324181	4.116,040104	150.001.688,94	162.377.782,10	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/06/2022	9.875	4049,567430	4.053,252942	39.989.478,37	40.025.872,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	29/08/2022	7.642	3925,476529	4.014,121136	29.998.491,63	30.675.913,72	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	3.761	3988,237004	4.010,401613	14.999.759,37	15.083.120,47	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	23/11/2022	1.254	3988,237004	4.010,401613	5.001.249,20	5.029.043,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	2.515	3977,260022	3.994,532997	10.002.808,96	10.046.250,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	28/11/2022	3.771	3977,260022	3.994,532997	14.998.247,54	15.063.383,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2030	09/03/2022	10.335	3870,303778	4.068,870894	39.999.589,55	42.051.780,69	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	07/07/2022	9.782	4089,215327	4.055,981939	40.000.704,33	39.675.615,33	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	11/07/2022	7.384	4062,955171	4.027,992530	30.000.860,98	29.742.696,84	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2032	16/09/2022	9.987	4004,964372	4.078,557825	39.997.579,18	40.732.557,00	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	25/02/2022	10.047	3.981,059981	4.200,901825	39.997.709,63	42.206.460,64	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	04/03/2022	15.090	3976,077337	4.187,054688	59.999.007,02	63.182.655,24	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	29/06/2022	296	4047,135758	4.145,889274	1.197.952,18	1.227.183,23	Curva



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

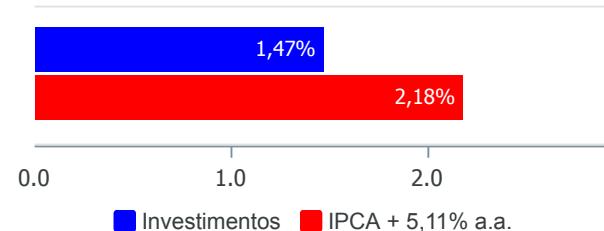
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	07/07/2022	498	4019,563107	4.105,265616	2.001.742,43	2.044.422,28	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	07/03/2022	10.178	3929,750612	4.136,473221	39.997.001,73	42.101.024,44	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	08/03/2022	10.225	3.911,428571	4.114,786786	39.994.357,14	42.073.694,89	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2040	15/03/2022	3.890	3895,024106	4.080,425673	15.151.643,77	15.872.855,87	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	25/02/2022	15.015	3.995,877115	4.219,087057	59.998.094,88	63.349.592,16	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	10/05/2022	2.400	4129,737582	4.189,278316	9.911.370,20	10.054.267,96	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	09/05/2022	4.840	4131,678715	4.194,222856	19.997.324,98	20.300.038,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	11/05/2022	2.310	4113,158402	4.169,581017	9.501.395,91	9.631.732,15	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	223	4039,820802	4.145,153455	900.880,04	924.369,22	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	27/06/2022	520	4039,820802	4.145,153455	2.100.706,82	2.155.479,80	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	11/05/2022	4.940	4048,514642	4.104,412552	19.999.662,33	20.275.798,01	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	15/06/2022	9.790	4085,727657	4.088,289229	39.999.273,76	40.024.351,55	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	06/02/2023	10.000	3897,835457	3.826,305449	38.978.354,57	38.263.054,49	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	06/07/2022	5.050	3962,882939	4.050,337968	20.012.558,84	20.454.206,74	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	29/06/2022	4.935	4052,223528	4.033,191776	19.997.723,11	19.903.801,41	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	07/07/2022	5.024	3981,139802	3.947,303143	20.001.246,37	19.831.250,99	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	23/11/2022	10.213	3916,628783	3.930,496560	40.000.529,76	40.142.161,37	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2060	06/02/2023	10.327	3873,291227	3.808,993496	39.999.478,50	39.335.475,83	Mercado



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%
Fevereiro	2.300.984.841,17	228.773.683,89	228.216.386,55	2.285.153.296,15	-16.388.842,36	33.148.033,45	-0,71%	1,47%	1,20%	2,18%	67,56%	5,13%

Investimentos x Meta de Rentabilidade





CRÉDITO
& MERCADO

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 SMML IDIV



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	82.196.237,29	16.800,00	0,00	83.449.307,75	1.236.270,46	1,50%	1,50%	1,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.643.910,97	0,00	307.456,27	10.478.200,44	141.745,74	1,33%	1,34%	1,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	3.370.801,17	0,00	97.117,06	3.318.543,08	44.858,97	1,33%	1,34%	1,27%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.080.732.507,66	78.977.833,07	17.377.747,28	1.153.313.646,64	10.981.053,19	0,95%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	106.410.391,09	0,00	0,00	107.285.192,17	874.801,08	0,82%	0,82%	0,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	84.737.340,58	0,00	85.194.303,90	0,00	456.963,32	0,54%	1,49%	1,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	183.200.370,65	150.693.001,07	125.488.088,76	209.889.871,11	1.484.588,15	0,44%	0,85%	0,13%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.825,57	41.049,75	45.879,17	30,74	34,59	0,08%	0,73%	0,00%
Total Renda Fixa	1.551.296.384,98	229.728.683,89	228.510.592,44	1.567.734.791,93	15.220.315,50	0,98%		0,43%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	40.748.891,25	0,00	0,00	40.077.610,07	-671.281,18	-1,65%	-1,65%	7,46%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	86.709.229,70	0,00	0,00	85.191.357,68	-1.517.872,02	-1,75%	-1,75%	7,63%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	88.712.836,56	0,00	0,00	87.129.803,96	-1.583.032,60	-1,78%	-1,78%	7,62%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.902.000,00	0,00	16.800,00	1.849.200,00	-36.000,00	-1,89%	-2,78%	12,03%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	36.498.977,30	0,00	0,00	34.364.995,28	-2.133.982,02	-5,85%	-5,85%	7,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	53.706.443,90	0,00	0,00	50.054.200,47	-3.652.243,43	-6,80%	-6,80%	7,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GÊNESIS FIC AÇÕES	8.256.107,25	0,00	0,00	7.687.431,96	-568.675,29	-6,89%	-6,89%	7,55%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	44.978.767,36	0,00	0,00	41.872.367,96	-3.106.399,40	-6,91%	-6,91%	7,61%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	33.555.263,56	0,00	0,00	31.226.194,18	-2.329.069,38	-6,94%	-6,94%	7,52%
SAFRA EQUITY PORTFÓLIO PB FIC AÇÕES	1.624.142,34	0,00	0,00	1.504.202,91	-119.939,43	-7,38%	-7,38%	8,72%
CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	59.531.150,48	0,00	0,00	55.110.935,01	-4.420.215,47	-7,43%	-7,43%	8,57%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	64.220.279,78	0,00	0,00	59.414.605,12	-4.805.674,66	-7,48%	-7,48%	8,06%
SAFRA AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	963.328,31	0,00	0,00	891.226,84	-72.101,47	-7,48%	-7,48%	8,55%
BRADESCO IBOVESPA PLUS FI AÇÕES	25.071.867,83	0,00	0,00	23.192.620,72	-1.879.247,11	-7,50%	-7,50%	8,66%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	37.896.433,23	0,00	0,00	34.834.072,74	-3.062.360,49	-8,08%	-8,08%	8,40%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	35.703.679,67	0,00	0,00	32.666.953,11	-3.036.726,56	-8,51%	-8,51%	8,62%
Total Renda Variável	620.079.398,52	0,00	16.800,00	587.067.778,01	-32.994.820,51	-5,32%		7,85%



**CRÉDITO
& MERCADO**

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB GLOBAL SELECT EQUITY INVESTIMENTO NO EXTERIOR F...	30.307.607,64	0,00	0,00	31.074.893,78	767.286,14	2,53%	2,53%	8,49%
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	29.115.322,88	0,00	0,00	29.577.685,80	462.362,92	1,59%	1,59%	7,49%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	11.306.684,35	0,00	0,00	11.396.438,45	89.754,10	0,79%	0,79%	6,96%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	20.549.142,03	0,00	0,00	20.703.203,44	154.061,41	0,75%	0,75%	9,98%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES DÓLAR MASTER INVESTIMENT...	28.183.520,77	0,00	0,00	28.309.149,76	125.628,99	0,45%	0,45%	6,34%
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4.890.783,58	0,00	0,00	4.902.096,86	11.313,28	0,23%	0,23%	6,67%
ITAÚ MERCADOS EMERGENTES INVESTIMENTO NO EXTERIOR ...	5.568.220,59	0,00	0,00	5.350.455,06	-217.765,53	-3,91%	-3,91%	7,82%
Total Exterior	129.921.281,84	0,00	0,00	131.313.923,15	1.392.641,31	1,07%		7,81%



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.