

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2023

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 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	24.715.054,41	5,32%	692	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	35.045.157,31	7,55%	977	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	832.216,87	0,18%	769	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	7.188.674,24	1,55%	210	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	21.098.043,89	4,54%	547	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.431.323,33	0,74%	1.116	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	6.154.564,05	1,33%	358	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	17.918.761,02	3,86%	125	3,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	2.630.228,75	0,57%	92	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.472.456,48	1,18%	237	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	12.669.459,23	2,73%	287	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	2.700.188,76	0,58%	105	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	15/08/2024	4.827.908,07	1,04%	26	2,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2027	3.030.825,98	0,65%	71	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIM...	D+0	Não há	199.441,83	0,04%	327	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	17.892.235,13	3,85%	801	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	29.377.696,27	6,33%	928	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.489.533,93	0,54%	732	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	567.733,61	0,12%	1.182	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.114.324,23	0,24%	198	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.449.436,07	0,74%	294	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.928.725,42	2,78%	655	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.029.970,90	0,22%	907	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	24.791.198,13	5,34%	1.070	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	13.656.176,18	2,94%	158	1,89%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	18.983.741,20	4,09%	125	2,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.156.572,85	3,69%	376	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	22.201.300,57	4,78%	229	1,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	2.116.793,39	0,46%	198	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	9.645.692,26	2,08%	305	0,37%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	13.183.012,85	2,84%	642	3,42%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	D+3	Não há	6.135.869,02	1,32%	25.211	0,46%	Artigo 8º, Inciso I
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	11.201.097,34	2,41%	1.702	1,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.307.994,28	0,93%	6.575	3,41%	Artigo 8º, Inciso I
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.697.273,06	0,37%	33.430	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.859.515,08	0,40%	25.055	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.879.098,71	1,70%	613	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.440.364,38	0,74%	151	0,74%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	5.682.646,60	1,22%	1.262	0,87%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	9.020.902,08	1,94%	87	1,36%	Artigo 8º, Inciso I

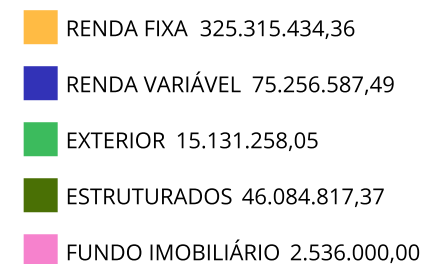
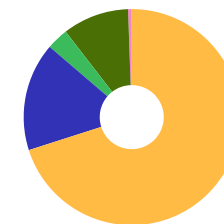
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	7.814.325,97	1,68%	20.840	0,35%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	D+3	Não há	3.034.488,12	0,65%	9.205	0,88%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO N...	D+12	Não há	6.710.409,12	1,45%	734	8,20%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	4.570.727,96	0,98%	13.502	0,69%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	3.850.120,97	0,83%	505	0,19%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.864.968,87	2,12%	6.883	0,55%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	11.552.982,89	2,49%	124	1,61%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	10.318.013,61	2,22%	8.463	0,59%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	6.544.405,38	1,41%	3.342	0,39%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.804.446,62	1,68%	6.884	1,09%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	2.536.000,00	0,55%		2,54%	Artigo 11º
Total para cálculo dos limites da Resolução			464.324.097,27				



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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	215.733.988,88	46,46%	20,82%	39,42%	86,74%	187.020.733,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	99.935.753,22	21,52%	10,23%	25,60%	60,00%	178.658.705,14
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	92.864.819,45
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	5,00%	9.645.692,26	2,08%	0,00%	2,10%	5,00%	13.570.512,60
Total Renda Fixa	100,00%	325.315.434,36	70,06%	31,05%	67,12%	171,74%	

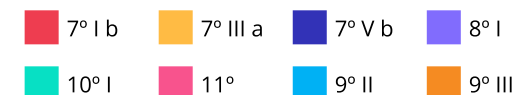
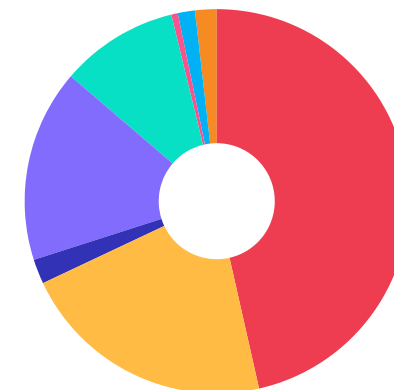




Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2023)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	75.256.587,49	16,21%	5,00%	18,71%	30,00%	64.040.641,69
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	46.084.817,37	9,93%	1,83%	7,40%	10,00%	347.592,36
Artigo 11º	5,00%	2.536.000,00	0,55%	0,00%	0,63%	5,00%	20.680.204,86
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	123.877.404,86	26,68%	6,83%	26,74%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	6.710.409,12	1,45%	0,30%	3,38%	10,00%	39.722.000,61
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	8.420.848,93	1,81%	0,40%	2,76%	10,00%	38.011.560,80
Total Exterior	10,00%	15.131.258,05	3,26%	0,70%	6,14%	20,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	201.272.718,72	43,35	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	187.790.682,49	40,44	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	41.778.112,19	9,00	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	30.448.095,75	6,56	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.034.488,12	0,65	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 ' b '	215.534.547,05	46,42	20,82	86,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	77.734.452,65	16,74	10,23	60,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	9.645.692,26	2,08	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I	75.256.587,49	16,21	5,00	30,00
Artigo 9º, Inciso II	6.710.409,12	1,45	0,30	10,00
Artigo 9º, Inciso III	8.420.848,93	1,81	0,40	10,00
Artigo 10º, Inciso I	46.084.817,37	9,93	1,83	10,00
Artigo 11º	2.536.000,00	0,55	0,00	5,00

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%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,72%	0,72%	0,90%	6,13%	8,73%	4,24%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	0,73%	0,79%	5,86%	8,32%	3,46%	2,82%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-1,26%	-1,26%	-3,59%	1,84%	3,66%	-3,05%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,26%	-1,26%	-3,65%	1,68%	3,33%	-3,61%	4,61%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	1,10%	1,10%	3,25%	6,75%	12,54%	16,51%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	1,12%	3,23%	6,66%	12,31%	16,01%	0,24%	0,01%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,09%	1,09%	3,19%	6,64%	12,30%	15,96%	0,25%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	1,06%	3,16%	6,58%	12,22%	15,86%	0,26%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,40%	1,40%	2,01%	4,40%	11,19%	16,27%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,39%	1,39%	2,19%	1,48%	4,49%	2,35%	0,93%	0,05%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,39%	1,39%	2,19%	1,55%	4,56%	2,39%	0,93%	0,05%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,38%	1,38%	1,93%	4,27%	10,93%	15,65%	1,15%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	1,38%	1,95%	4,36%	11,08%	15,87%	1,14%	0,03%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,19%	1,19%	-1,85%	0,58%	-	-	2,04%	-

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
IMA-B (Benchmark)	0,00%	0,00%	-0,99%	2,84%	7,15%	5,93%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,03%	-0,03%	-1,10%	2,78%	6,97%	5,46%	2,95%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,01%	-0,01%	-1,03%	2,70%	6,90%	5,39%	2,90%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	0,84%	0,84%	1,65%	6,17%	9,82%	8,42%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	0,88%	1,70%	6,18%	9,76%	8,12%	1,83%	0,02%
CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	1,03%	1,03%	2,68%	5,77%	12,46%	19,88%	0,23%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,12%	3,22%	6,65%	12,79%	18,38%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	1,10%	1,10%	3,28%	6,76%	13,04%	18,94%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,96%	0,96%	2,84%	5,78%	10,97%	15,22%	0,00%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,65%	1,30%	4,80%	9,80%	11,12%	1,44%	0,01%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,03%	1,03%	3,03%	6,18%	11,68%	15,99%	0,01%	0,00%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,18%	1,18%	3,54%	7,25%	13,90%	20,62%	0,03%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
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 FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	1,50%	3,22%	5,48%	12,98%	18,07%	0,59%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,50%	0,50%	-0,90%	2,12%	7,81%	13,13%	2,23%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,28%	6,11%	11,10%	11,70%	0,39%	0,01%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,98%	0,98%	1,99%	5,93%	10,96%	12,55%	0,58%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,57%	0,57%	0,95%	4,72%	9,11%	9,83%	1,76%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	1,19%	0,87%	3,33%	-	-	2,05%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,50%	1,50%	0,10%	2,28%	-	-	0,59%	-



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
CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1,72%	1,72%	0,97%	8,54%	10,99%	13,67%	3,09%	0,06%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1,10%	1,10%	3,03%	6,80%	13,52%	19,21%	0,40%	0,01%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,12%	1,12%	1,54%	9,19%	13,41%	17,46%	2,15%	0,04%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,21%	1,21%	1,01%	6,67%	10,87%	14,01%	2,93%	0,04%
Global BDRX (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,06%	-3,63%	-16,72%	-5,42%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,32%	4,32%	6,18%	-4,25%	-17,40%	-8,03%	8,80%	0,19%
Ibovespa (Benchmark)	3,37%	3,37%	-2,25%	9,95%	1,15%	-1,42%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	6,69%	6,69%	-5,82%	5,64%	-5,20%	-13,91%	9,93%	0,24%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	4,46%	4,46%	-2,30%	7,42%	-2,65%	2,26%	10,20%	0,20%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2,42%	2,42%	-4,62%	11,26%	6,28%	0,01%	10,29%	0,23%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	3,84%	3,84%	-9,37%	2,09%	-5,66%	-18,58%	10,90%	0,22%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,52%	3,52%	-8,11%	5,22%	-3,84%	-11,80%	9,75%	0,22%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	3,93%	3,93%	-2,67%	10,30%	4,31%	-5,91%	10,13%	0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3,34%	3,34%	-2,25%	4,69%	-3,79%	0,62%	9,96%	0,19%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3,33%	3,33%	-1,67%	7,27%	0,34%	-3,51%	9,58%	0,20%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	3,16%	3,16%	-16,55%	-7,06%	-26,04%	-44,18%	13,31%	0,30%

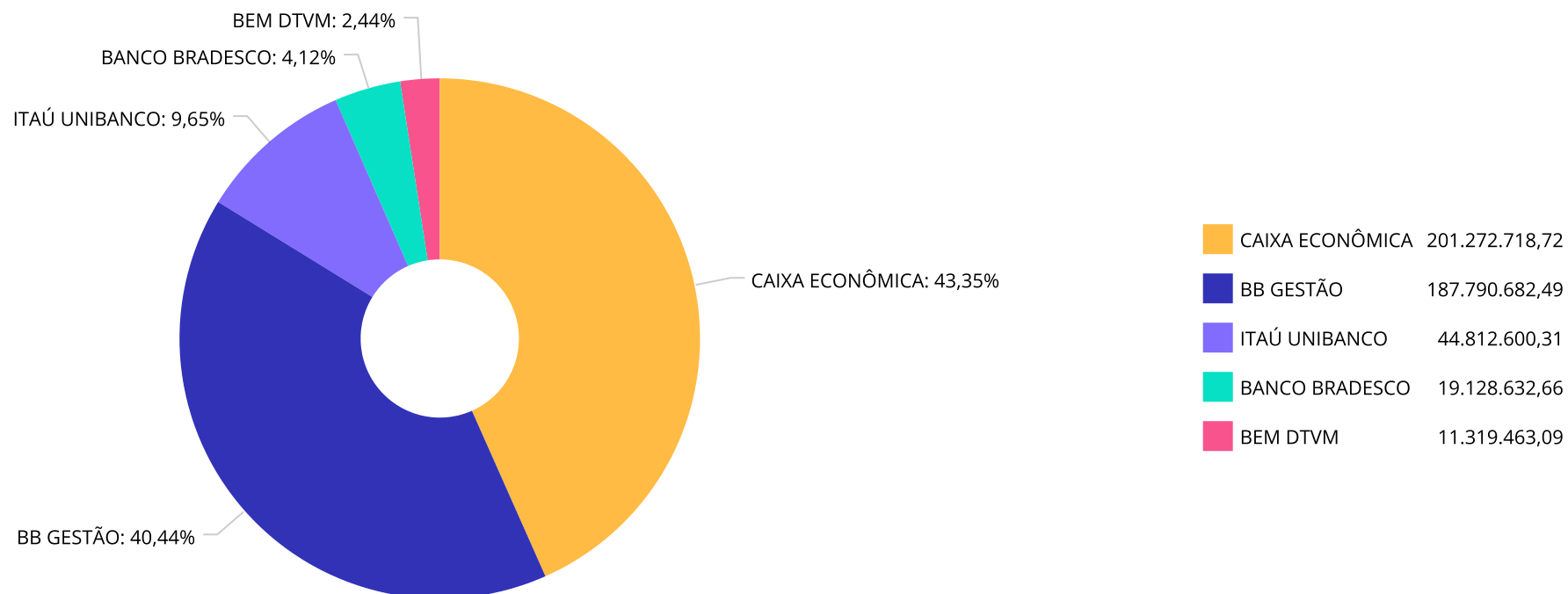
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX-50 (Benchmark)	3,38%	3,38%	-1,47%	10,88%	1,52%	0,57%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	4,79%	4,79%	-3,87%	10,25%	-0,63%	-2,08%	9,84%	0,22%
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%
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%
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,95%	3,95%	2,07%	-3,32%	-15,33%	-1,85%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,88%	1,88%	3,05%	-3,51%	-15,53%	-4,97%	8,14%	0,18%
S&P 500 (Moeda Original) (Benchmark)	6,18%	6,18%	5,28%	-1,30%	-9,72%	9,76%	-	-
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5,92%	5,92%	6,77%	2,22%	-2,94%	20,10%	6,96%	0,23%
SMLL (Benchmark)	2,92%	2,92%	-11,39%	3,51%	-15,47%	-24,13%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	3,35%	3,35%	-10,07%	2,84%	-8,79%	-12,16%	13,47%	0,27%

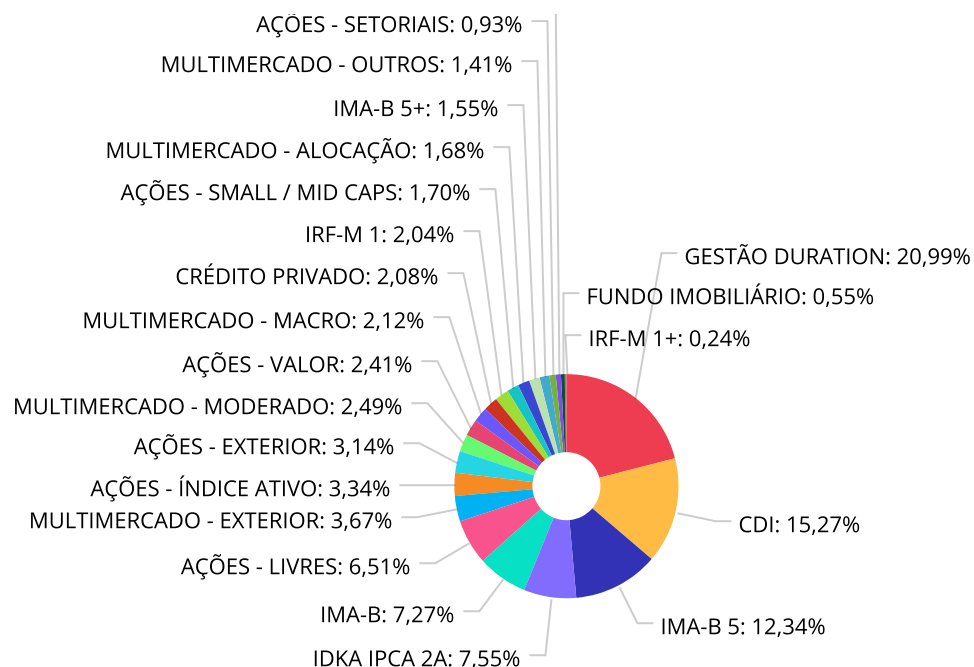
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
MSCI USA Extended ESG Focus (Benchmark)	3,95%	3,95%	2,07%	-3,32%	-15,33%	-1,85%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1,88%	1,88%	3,05%	-3,51%	-15,53%	-4,97%	8,14%	17,811%
Global BDRX (Benchmark)	4,37%	4,37%	7,06%	-3,63%	-16,72%	-5,42%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,32%	4,32%	6,18%	-4,25%	-17,40%	-8,03%	8,80%	19,224%
MSCI WORLD (Benchmark)	4,58%	4,58%	6,03%	-0,33%	-13,34%	-2,56%	-	-
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC MU...	2,76%	2,76%	8,20%	-0,80%	-15,67%	-24,01%	10,10%	17,391%

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



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



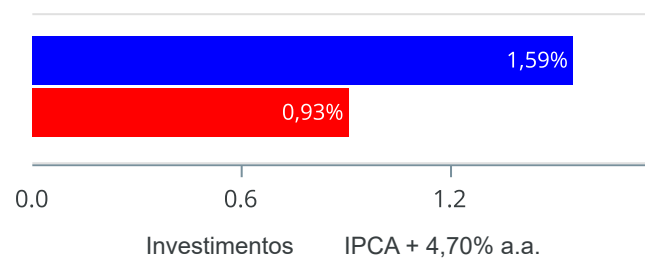
■ GESTÃO DURATION	97.448.507,49	■ CDI	70.892.161,75	■ IMA-B 5	57.314.064,19	■ IDKA IPCA 2A	35.045.157,31
■ IMA-B	33.745.903,40	■ AÇÕES - LIVRES	30.236.773,56	■ MULTIMERCADO - EXTERIOR	17.028.422,73	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	15.495.754,58
■ AÇÕES - EXTERIOR	14.556.717,95	■ MULTIMERCADO - MODERADO	11.552.982,89	■ AÇÕES - VALOR	11.201.097,34	■ MULTIMERCADO - MACRO	9.864.968,87
■ CRÉDITO PRIVADO	9.645.692,26	■ IRF-M 1	9.471.513,42	■ AÇÕES - SMALL / MID CAPS	7.879.098,71	■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	7.804.446,62
■ IMA-B 5+	7.188.674,24	■ MULTIMERCADO - OUTROS	6.544.405,38	■ AÇÕES - SETORIAIS	4.307.994,28	■ IRF-M	3.449.436,07
■ FUNDO IMOBILIÁRIO	2.536.000,00	■ IRF-M 1+	1.114.324,23				



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	460.890.844,21	24.061.731,63	27.952.589,81	464.324.097,27	7.324.111,24	7.324.111,24	1,59%	1,59%	0,93%	0,93%	170,16%	3,17%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



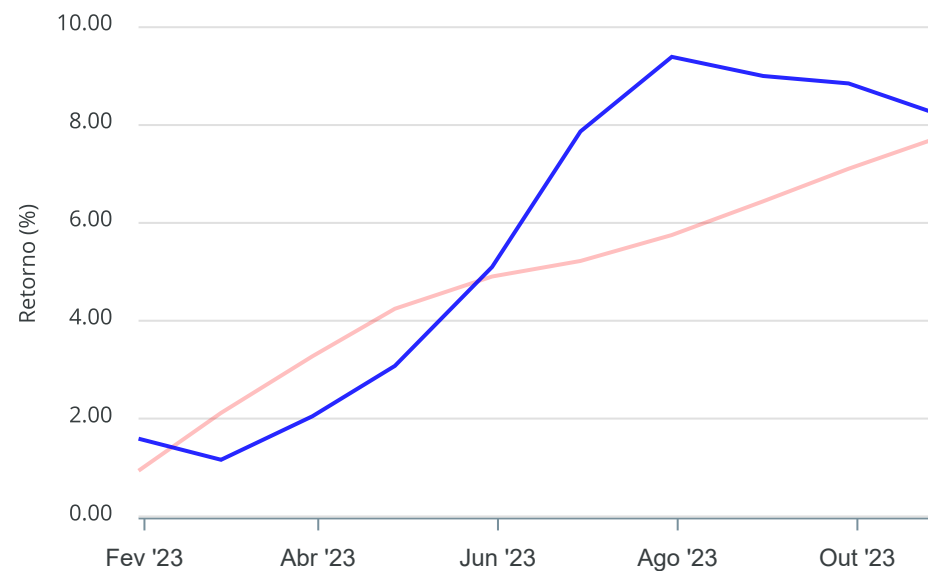
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	6.063.566,20	0,00	0,00	6.154.564,05	90.997,85	1,50%	1,50%	0,59%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.482.613,92	0,00	0,00	12.669.459,23	186.845,31	1,50%	1,50%	0,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	34.548.955,40	0,00	0,00	35.045.157,31	496.201,91	1,44%	1,44%	1,15%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.663.273,30	0,00	0,00	2.700.188,76	36.915,46	1,39%	1,39%	0,93%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.761.964,80	0,00	0,00	4.827.908,07	65.943,27	1,38%	1,38%	0,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.594.342,89	0,00	0,00	2.630.228,75	35.885,86	1,38%	1,38%	0,93%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	820.931,26	0,00	0,00	832.216,87	11.285,61	1,37%	1,37%	1,15%
CAIXA BRASIL 2027 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.995.172,41	0,00	0,00	3.030.825,98	35.653,57	1,19%	1,19%	2,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PRE...	12.920.764,44	4.790.400,14	0,00	17.918.761,02	207.596,44	1,17%	1,19%	2,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	32.999.361,74	0,00	4.000.000,00	29.377.696,27	378.334,53	1,15%	1,37%	1,14%
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.413.630,02	0,00	0,00	5.472.456,48	58.826,46	1,09%	1,09%	0,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	23.525.302,48	1.000.000,00	0,00	24.791.198,13	265.895,65	1,08%	1,12%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.395.434,62	0,00	0,00	3.431.323,33	35.888,71	1,06%	1,06%	0,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	17.708.798,99	0,00	0,00	17.892.235,13	183.436,14	1,04%	1,04%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	2.095.142,60	0,00	0,00	2.116.793,39	21.650,79	1,03%	1,03%	0,23%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	18.798.814,73	0,00	0,00	18.983.741,20	184.926,47	0,98%	0,98%	0,58%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.805.047,85	2.000.000,00	0,00	12.928.725,42	123.677,57	0,97%	1,12%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	755.897,54	0,00	195.436,50	567.733,61	7.272,57	0,96%	1,12%	0,24%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA SIMPL...	175.219,49	22.400,00	0,00	199.441,83	1.822,34	0,92%	0,96%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	11.001.080,39	6.000.000,00	0,00	17.156.572,85	155.492,46	0,91%	1,10%	0,03%



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	13.511.828,15	248.931,49	12.856.611,15	1.029.970,90	125.822,41	0,91%	1,03%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.419.347,33	0,00	0,00	3.449.436,07	30.088,74	0,88%	0,88%	1,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.106.230,38	0,00	0,00	1.114.324,23	8.093,85	0,73%	0,73%	2,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	24.556.016,07	0,00	0,00	24.715.054,41	159.038,34	0,65%	0,65%	1,44%
ITAÚ HIGH GRADE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.585.742,04	5.000.000,00	0,00	9.645.692,26	59.950,22	0,63%	1,18%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	13.579.028,18	0,00	0,00	13.656.176,18	77.148,00	0,57%	0,57%	1,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	26.068.675,98	0,00	4.000.000,00	22.201.300,57	132.624,59	0,51%	0,50%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.873.821,70	0,00	2.878.142,16	0,00	4.320,46	0,15%	1,11%	0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	21.100.261,77	0,00	0,00	21.098.043,89	-2.217,88	-0,01%	-0,01%	2,90%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.490.352,05	0,00	0,00	2.489.533,93	-818,12	-0,03%	-0,03%	2,95%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	7.280.583,90	0,00	0,00	7.188.674,24	-91.909,66	-1,26%	-1,26%	4,61%
Total Renda Fixa	327.097.202,62	19.061.731,63	23.930.189,81	325.315.434,36	3.086.689,92	0,94%		1,17%



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1.590.883,28	0,00	0,00	1.697.273,06	106.389,78	6,69%	6,69%	9,93%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	9.685.921,21	0,00	0,00	10.318.013,61	632.092,40	6,53%	6,53%	7,51%
BB AÇÕES BOLSA AMERICANA FI AÇÕES	5.792.745,70	0,00	0,00	6.135.869,02	343.123,32	5,92%	5,92%	6,96%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	8.608.953,68	0,00	0,00	9.020.902,08	411.948,40	4,79%	4,79%	9,84%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.780.163,43	0,00	0,00	1.859.515,08	79.351,65	4,46%	4,46%	10,20%
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	3.310.390,57	0,00	0,00	3.440.364,38	129.973,81	3,93%	3,93%	10,13%
ITAÚ OLIMPO FIC AÇÕES	2.922.271,13	0,00	0,00	3.034.488,12	112.216,99	3,84%	3,84%	10,90%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	5.489.704,00	0,00	0,00	5.682.646,60	192.942,60	3,51%	3,51%	9,75%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	7.623.739,98	0,00	0,00	7.879.098,71	255.358,73	3,35%	3,35%	13,47%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.839.393,03	0,00	0,00	11.201.097,34	361.704,31	3,34%	3,34%	9,96%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	12.758.618,36	0,00	0,00	13.183.012,85	424.394,49	3,33%	3,33%	9,58%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4.176.033,72	0,00	0,00	4.307.994,28	131.960,56	3,16%	3,16%	13,31%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7.629.871,93	0,00	0,00	7.814.325,97	184.454,04	2,42%	2,42%	10,29%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.520.000,00	0,00	22.400,00	2.536.000,00	38.400,00	1,52%	0,63%	8,18%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	9.683.238,04	0,00	2.000.000,00	7.804.446,62	121.208,58	1,25%	1,72%	3,09%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	11.424.567,64	0,00	0,00	11.552.982,89	128.415,25	1,12%	1,12%	2,15%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.482.540,51	5.000.000,00	0,00	6.544.405,38	61.864,87	0,95%	1,10%	0,40%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	11.767.199,12	0,00	2.000.000,00	9.864.968,87	97.769,75	0,83%	1,21%	2,93%
Total Renda Variável	119.086.235,33	5.000.000,00	4.022.400,00	123.877.404,86	3.813.569,53	3,18%		7,68%



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	3.690.775,29	0,00	0,00	3.850.120,97	159.345,68	4,32%	4,32%	8,80%
CAIXA MULTIGESTOR GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO ...	6.530.332,92	0,00	0,00	6.710.409,12	180.076,20	2,76%	2,76%	10,10%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	4.486.298,05	0,00	0,00	4.570.727,96	84.429,91	1,88%	1,88%	8,14%
Total Exterior	14.707.406,26	0,00	0,00	15.131.258,05	423.851,79	2,88%		9,18%

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 CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, 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 o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

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 (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º 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 MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, 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.

