

# 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.

**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	3.133.003,11	4,92%	675	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	961.140,29	1,51%	965	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.123.079,45	1,76%	765	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.259.299,47	1,98%	527	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	525.697,89	0,83%	473	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	3.896.141,42	6,12%	359	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA P...	D+0	1795 dias	1.729.152,77	2,71%	135	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	2024-08-15	3.983.929,88	6,25%	339	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/05/2023	4.783.189,29	7,51%	287	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.231.225,21	5,07%	794	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.488.365,53	3,91%	936	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.992.778,45	3,13%	294	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.720.946,03	2,70%	2.433	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.084.599,82	1,70%	922	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.258.488,47	6,68%	154	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.300.672,01	6,75%	394	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	963.923,55	1,51%	215	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.437.838,36	2,26%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	395.765,51	0,62%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	331.256,54	0,52%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

**Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)**

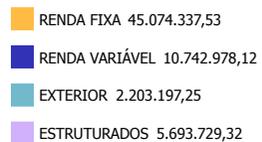
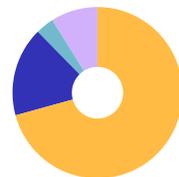
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.311.914,55	2,06%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	Não se ...	Não se aplica	49.782,81	0,08%	20	0,75%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	D+1260	90 dias	103.250,49	0,16%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	8.896,63	0,01%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	1.576.204,97	2,47%	24.240	0,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.396.109,43	2,19%	189	0,24%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	182.918,10	0,29%	87	0,03%	Artigo 8º, Inciso I
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.980.286,23	3,11%	3.485	0,18%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	D+4	Não há	501.004,30	0,79%	7	1,51%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	D+3	Não há	520.029,38	0,82%	355	0,13%	Artigo 8º, Inciso I
ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	D+3	Não há	355.505,30	0,56%	12.328	0,07%	Artigo 8º, Inciso I
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.188.823,66	3,44%	157	1,02%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	1.109.028,80	1,74%	20	0,21%	Artigo 8º, Inciso I
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇ...	D+32	Não há	717.297,66	1,13%	32	0,08%	Artigo 8º, Inciso I
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTI...	D+5 du	Não há	451.214,28	0,71%	59	0,07%	Artigo 9º, Inciso II
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR ...	D+2 du	Não há	469.845,22	0,74%	25.027	0,11%	Artigo 9º, Inciso III
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	837.561,38	1,31%	158	0,07%	Artigo 9º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	444.576,37	0,70%	502	0,02%	Artigo 9º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	1.768.990,74	2,78%	98	1,40%	Artigo 10º, Inciso I
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.201.188,19	1,89%	57.229	0,04%	Artigo 10º, Inciso I

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.424.428,92	2,24%	6.641	0,08%	Artigo 10º, Inciso I
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	753.463,70	1,18%	8.152	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	545.657,77	0,86%	733	0,05%	Artigo 10º, Inciso I
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	215.770,29	0,34%		0,23%	Desenquadrado - RV
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>63.714.242,22</b>				

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

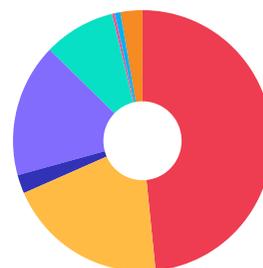
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2023			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	12.742.848,44
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	30.827.948,79	48,38%	15,00%	54,00%	90,00%	26.514.869,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	12.772.544,26	20,05%	4,00%	10,00%	60,00%	25.456.001,07
Artigo 7º, Inciso IV	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.185.712,11
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	5,00%	1.473.844,48	2,31%	0,00%	2,50%	5,00%	1.711.867,63
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	3,00%	1.911.427,27
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>45.074.337,53</b>	<b>70,74%</b>	<b>19,00%</b>	<b>69,50%</b>	<b>183,00%</b>	



**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%	10.527.207,83	16,52%	0,00%	18,00%	30,00%	8.587.064,84
Artigo 10º, Inciso I	10,00%	5.693.729,32	8,94%	0,00%	6,00%	10,00%	677.694,90
Artigo 10º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	3.185.712,11
Artigo 11º	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.185.712,11
Desenquadrado - RV	0,00%	215.770,29	0,34%	0,00%	0,00%	0,00%	-215.770,29
<b>Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário</b>	<b>30,00%</b>	<b>16.436.707,44</b>	<b>25,80%</b>	<b>0,00%</b>	<b>27,00%</b>	<b>50,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2023			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso II	10,00%	451.214,28	0,71%	0,00%	0,50%	10,00%	5.920.209,94
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.751.982,97	2,75%	0,00%	3,00%	10,00%	4.619.441,25
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>2.203.197,25</b>	<b>3,46%</b>	<b>0,00%</b>	<b>3,50%</b>	<b>20,00%</b>	





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

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

<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,33%	2,47%	3,72%	6,18%	12,96%	33,64%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-3,03%	-3,22%	-2,90%	-3,72%	-10,10%	-19,88%	5,54%	0,04%
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR 1	-0,29%	0,15%	0,34%	0,84%	2,65%	5,51%	0,17%	0,01%

<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,41%	2,82%	3,79%	5,87%	11,57%	18,62%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,40%	2,79%	3,73%	5,73%	11,31%	17,99%	1,19%	0,03%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,26%	-4,85%	-4,73%	-17,21%	-18,62%	-39,38%	1,41%	0,14%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,34%	0,92%	1,33%	2,60%	4,56%	4,25%	0,21%	0,01%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1,35%	2,67%	3,55%	5,56%	10,96%	16,78%	1,15%	0,03%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	1,28%	1,28%	1,08%	3,02%	7,94%	8,94%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	1,26%	1,04%	2,90%	7,68%	8,38%	2,45%	0,04%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,45%	0,53%	0,73%	2,88%	5,62%	3,03%	0,84%	0,01%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,86%	1,71%	3,21%	4,93%	10,13%	10,66%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	1,65%	3,10%	4,73%	9,88%	10,03%	1,59%	0,02%

**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
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	1,72%	3,19%	4,92%	10,02%	10,29%	1,59%	0,02%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,70%	1,53%	2,68%	5,99%	12,67%	19,63%	0,31%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	2,43%	3,41%	6,59%	12,46%	19,86%	0,42%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	2,75%	4,11%	6,04%	10,88%	-	1,28%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,85%	1,89%	2,95%	5,94%	11,87%	16,92%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,79%	1,90%	3,05%	6,34%	12,95%	19,81%	0,04%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	0,23%	-0,11%	12,15%	10,65%	-55,07%	-57,66%	1,29%	0,61%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	-0,54%	-11,86%	-12,63%	-13,19%	-16,02%	4.233.985.424.560,00%	-	-

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,84%	1,37%	2,00%	2,73%	5,60%	16,73%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	1,63%	2,41%	4,63%	10,13%	13,25%	1,21%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VÉRTICE 2027 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,71%	2,92%	3,25%	4,54%	-	-	2,04%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,97%	2,01%	3,17%	5,58%	11,28%	13,35%	0,28%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,14%	1,65%	1,27%	2,66%	8,04%	14,35%	1,98%	0,02%

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	2,42%	3,40%	3,36%	5,49%	-	0,42%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,92%	2,05%	3,20%	6,44%	13,00%	19,38%	-	-
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,31%	1,38%	1,76%	3,41%	9,51%	14,85%	0,44%	0,02%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,99%	2,95%	5,79%	11,20%	15,43%	0,69%	0,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,14%	1,06%	2,17%	4,22%	9,80%	14,50%	2,19%	0,04%

<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
--------------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-7,49%	-4,38%	-6,72%	-4,19%	-7,26%	-4,64%	-	-
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	-8,51%	-4,43%	-6,88%	-7,04%	-10,63%	-1,68%	8,62%	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 PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	-7,48%	-4,30%	-6,56%	-3,97%	-6,88%	-4,16%	8,67%	0,22%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	-7,67%	-4,36%	-6,78%	-5,21%	-8,42%	-6,87%	8,38%	0,23%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-6,16%	-2,57%	-5,65%	-8,88%	-3,33%	0,31%	7,21%	0,21%
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,00%	-0,77%	-2,08%	-1,48%	10,98%	40,21%	4,90%	0,23%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,19%	0,83%	-1,92%	2,63%	20,35%	-	8,75%	0,26%

<b>IBX (Benchmark)</b>	-7,59%	-4,34%	-6,85%	-4,76%	-8,23%	-5,60%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-9,11%	-4,65%	-8,43%	-7,21%	-12,82%	-20,39%	8,00%	0,27%

<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	-7,54%	-4,41%	-6,85%	-3,59%	-7,74%	-3,34%	-	-
---------------------------	--------	--------	--------	--------	--------	--------	---	---

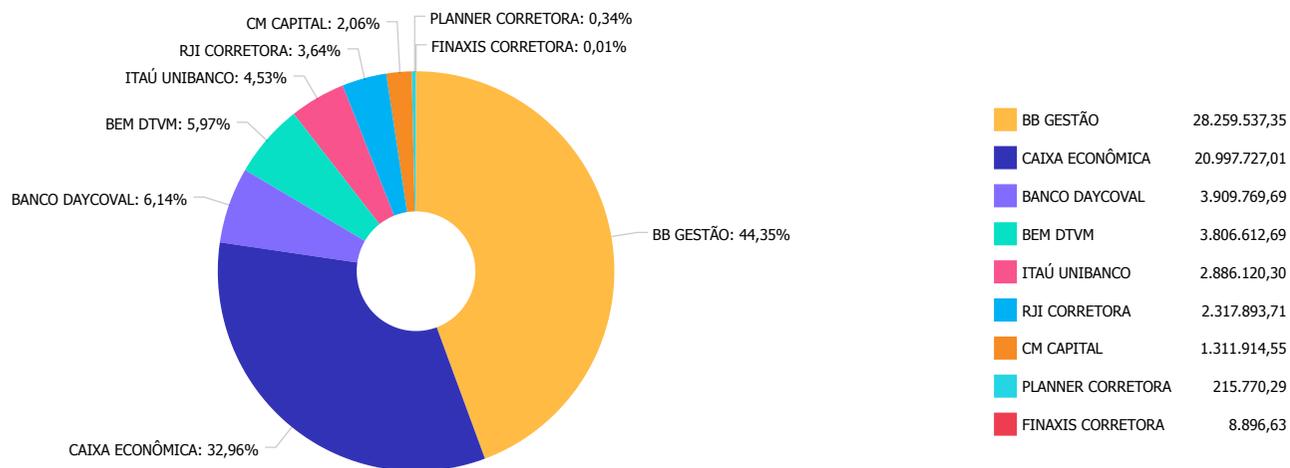
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-7,44%	-3,01%	-5,43%	-3,95%	-9,01%	-6,05%	8,12%	0,23%
<b>IFIX (Benchmark)</b>	-0,45%	-2,05%	-2,05%	-5,64%	2,45%	-2,71%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-0,05%	-84,68%	-0,24%	-50,66%	-50,86%	-51,22%	-	-
<b>MSCI ACWI (Benchmark)</b>	-0,92%	3,71%	-1,93%	3,17%	-8,75%	-9,86%	-	-
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	-1,75%	4,66%	-0,47%	4,91%	-0,63%	19,22%	7,63%	0,24%
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-2,61%	3,40%	-2,70%	0,38%	-9,45%	4,17%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-1,78%	4,59%	-0,45%	4,90%	-0,57%	19,27%	7,62%	0,24%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-10,52%	-7,90%	-10,68%	-16,48%	-20,22%	-30,84%	-	-
ITAÚ SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	-8,60%	-6,51%	-8,98%	-13,84%	-15,92%	-21,52%	8,36%	0,26%

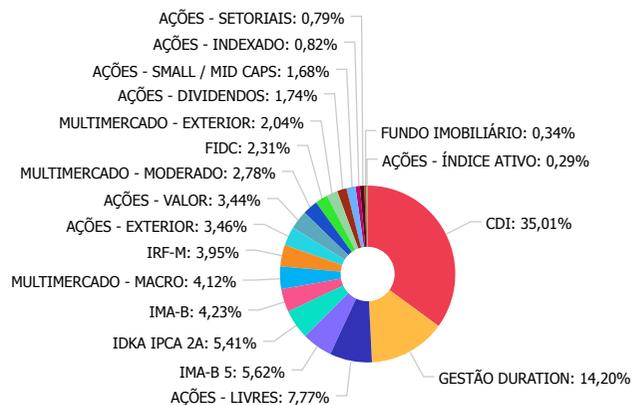
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2023 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	1,15%	5,57%	1,12%	0,53%	-9,60%	-7,95%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	5,10%	0,14%	-	-	-	9,98%	0,18%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	-	3,44%	1,86%	-	-	-	6,36%	0,21%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-	2,36%	-2,85%	-	-	-	7,60%	0,17%
<b>MSCI WORLD (Benchmark)</b>	-0,45%	4,10%	-1,86%	3,90%	-7,70%	-6,26%	-	-
BB NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	-	2,55%	-2,20%	-	-	-	7,49%	0,15%

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



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

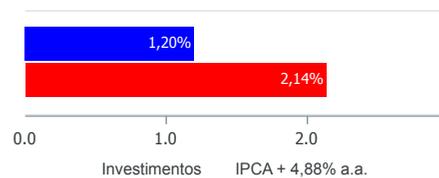


CDI	22.307.020,89	GESTÃO DURATION	9.049.097,90	AÇÕES - LIVRES	4.952.600,63	IMA-B 5	3.579.254,27
IDKA IPCA 2A	3.449.505,82	IMA-B	2.697.137,83	MULTIMERCADO - MACRO	2.625.617,11	IRF-M	2.518.476,34
AÇÕES - EXTERIOR	2.203.197,25	AÇÕES - VALOR	2.188.823,66	MULTIMERCADO - MODERADO	1.768.990,74	FIDC	1.473.844,48
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.299.121,47	AÇÕES - DIVIDENDOS	1.109.028,80	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.072.802,96	AÇÕES - INDEXADO	520.029,38
AÇÕES - SETORIAIS	501.004,30	FUNDO IMOBILIÁRIO	215.770,29	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	182.918,10		

**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	63.080.883,61	7.645.059,03	8.409.259,70	63.433.808,80	1.117.125,86	1.117.125,86	1,77%	1,77%	0,95%	0,95%	186,60%	3,03%
Fevereiro	63.433.808,80	6.748.190,39	6.107.126,78	63.714.242,22	-360.630,19	756.495,67	-0,56%	1,20%	1,18%	2,14%	55,88%	2,51%

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...	1.700.146,22	0,00	0,00	1.729.152,77	29.006,55	1,71%	1,71%	2,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.451.498,72	0,00	0,00	2.488.365,53	36.866,81	1,50%	1,50%	1,47%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	947.026,99	0,00	0,00	961.140,29	14.113,30	1,49%	1,49%	1,45%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.107.585,63	0,00	0,00	1.123.079,45	15.493,82	1,40%	1,40%	1,19%
DAYCOVAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA	1.698.047,72	0,00	0,00	1.720.946,03	22.898,31	1,35%	1,35%	1,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XXI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	4.044.356,15	0,00	114.474,97	3.983.929,88	54.048,70	1,34%	1,34%	1,28%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.243.539,59	0,00	0,00	1.259.299,47	15.759,88	1,27%	1,27%	2,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	953.042,31	0,00	0,00	963.923,55	10.881,24	1,14%	1,14%	1,98%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.102.697,84	0,00	0,00	3.133.003,11	30.305,27	0,98%	0,98%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.860.820,01	0,00	0,00	3.896.141,42	35.321,41	0,91%	0,91%	0,42%
CAIXA BRASIL 2023 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.739.973,82	0,00	0,00	4.783.189,29	43.215,47	0,91%	0,91%	0,42%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.976.376,65	0,00	0,00	1.992.778,45	16.401,80	0,83%	0,83%	1,59%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	521.412,52	0,00	0,00	525.697,89	4.285,37	0,82%	0,82%	1,59%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	4.228.821,09	0,00	0,00	4.258.488,47	29.667,38	0,70%	0,70%	0,31%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.184.468,18	0,00	4.000.000,00	3.231.225,21	46.757,03	0,65%	0,97%	0,28%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.431.414,12	0,00	0,00	1.437.838,36	6.424,24	0,45%	0,45%	0,84%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	317.592,38	0,00	318.975,18	0,00	1.382,80	0,44%	0,85%	0,13%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	4.283.212,56	0,00	4.300.672,01	17.459,45	0,41%	0,79%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	238.499,12	2.464.977,83	1.629.790,54	1.084.599,82	10.913,41	0,40%	0,85%	0,00%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	394.430,09	0,00	0,00	395.765,51	1.335,42	0,34%	0,34%	0,21%

## 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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	8.876,16	0,00	0,00	8.896,63	20,47	0,23%	0,23%	1,29%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.352.969,50	0,00	42.061,51	1.311.914,55	1.006,56	0,07%	-3,03%	5,54%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	334.004,90	0,00	1.824,58	331.256,54	-923,78	-0,28%	-0,26%	1,41%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	103.548,73	0,00	0,00	103.250,49	-298,24	-0,29%	-0,29%	0,17%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL SUBORDINADA 1	50.052,31	0,00	0,00	49.782,81	-269,50	-0,54%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>43.991.200,75</b>	<b>6.748.190,39</b>	<b>6.107.126,78</b>	<b>45.074.337,53</b>	<b>442.073,17</b>	<b>0,99%</b>		<b>1,00%</b>

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

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
OSASCO PROPERTIES FII	215.884,13	0,00	0,00	215.770,29	-113,84	-0,05%	-0,05%	-
TRÍGONO FLAGSHIP SMALL CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕE...	747.216,69	0,00	0,00	717.297,66	-29.919,03	-4,00%	-4,00%	4,90%
TRÍGONO DELPHOS INCOME INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.157.474,69	0,00	0,00	1.109.028,80	-48.445,89	-4,19%	-4,19%	8,75%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE QUANTITATIVO FIC AÇÕES	1.482.804,40	0,00	0,00	1.396.109,43	-86.694,97	-5,85%	-5,85%	7,56%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.110.285,15	0,00	0,00	1.980.286,23	-129.998,92	-6,16%	-6,16%	7,21%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	197.626,23	0,00	0,00	182.918,10	-14.708,13	-7,44%	-7,44%	8,12%
ITAU PRIVATE INDEX IBOVESPA FIC AÇÕES I	562.053,07	0,00	0,00	520.029,38	-42.023,69	-7,48%	-7,48%	8,67%
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA SUSTENTÁVEL FI AÇÕES	542.647,04	0,00	0,00	501.004,30	-41.642,74	-7,67%	-7,67%	8,38%
BB SELEÇÃO FATORIAL FIC AÇÕES	1.722.729,30	0,00	0,00	1.576.204,97	-146.524,33	-8,51%	-8,51%	8,62%
ITAU SMALL CAP VALUATION FIC AÇÕES	388.965,18	0,00	0,00	355.505,30	-33.459,88	-8,60%	-8,60%	8,36%
META VALOR FI AÇÕES	2.408.156,63	0,00	0,00	2.188.823,66	-219.332,97	-9,11%	-9,11%	8,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>11.535.842,51</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>10.742.978,12</b>	<b>-792.864,39</b>	<b>-6,87%</b>		<b>7,82%</b>

**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 NORDEA GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT INVESTIME...	444.160,83	0,00	0,00	451.214,28	7.053,45	1,59%	1,59%	7,49%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	1.755.505,79	0,00	0,00	1.768.990,74	13.484,95	0,77%	0,77%	0,69%
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	441.268,09	0,00	0,00	444.576,37	3.308,28	0,75%	0,75%	9,98%
BB AÇÕES ESG IS FI AÇÕES BDR NÍVEL I	834.403,03	0,00	0,00	837.561,38	3.158,35	0,38%	0,38%	7,60%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.197.435,83	0,00	0,00	1.201.188,19	3.752,36	0,31%	0,31%	0,44%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.426.428,23	0,00	0,00	1.424.428,92	-1.999,31	-0,14%	-0,14%	2,19%
CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	766.888,32	0,00	0,00	753.463,70	-13.424,62	-1,75%	-1,75%	7,63%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	555.571,64	0,00	0,00	545.657,77	-9.913,87	-1,78%	-1,78%	7,62%
BB AÇÕES BOLSAS GLOBAIS ATIVO ETF FIC AÇÕES BDR NÍ...	485.103,78	0,00	0,00	469.845,22	-15.258,56	-3,15%	-3,15%	6,36%
<b>Total Exterior</b>	<b>7.906.765,54</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>7.896.926,57</b>	<b>-9.838,97</b>	<b>-0,12%</b>		<b>4,05%</b>

#### Disclaimer

---

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são substanciadas 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.

