

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
BRASESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+0	Não há	8.170.601,01	3,98%	454	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	5.400.377,52	2,63%	105	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2024	3.235.195,34	1,58%	17	1,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	9.645.446,40	4,70%	23	4,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	1.382.466,06	0,67%	327	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	26.218.364,82	12,77%	801	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	20.774.583,83	10,12%	948	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	13.707.711,16	6,68%	928	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.031.792,40	0,99%	243	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.975.712,80	4,37%	732	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	18.427.649,61	8,97%	1.182	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	7.053.254,17	3,43%	198	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.790.608,31	4,28%	655	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	23.923.180,11	11,65%	316	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	2.956.903,80	1,44%	219	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.422.847,02	2,15%	1.000	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	2.411.435,12	1,17%	239	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	8.092.494,26	3,94%	297	1,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	7.742.720,34	3,77%	255	2,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	15.947.183,53	7,77%	1.014	1,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2023)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	6.042.189,34	2,94%	124	0,84%	Artigo 10º, Inciso I
Total para cálculo dos limites da Resolução			205.352.716,95				



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	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2023** não está cadastrada !!!



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	

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2023)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	141.476.537,70	68,89	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	32.093.781,12	15,63	0,00
SICREDI	31.782.398,13	15,48	0,04

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 %		

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%	-	-
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%
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%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,28%	-1,28%	-3,66%	1,74%	3,42%	-3,75%	4,62%	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%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	1,10%	1,10%	3,23%	6,76%	12,58%	16,71%	0,23%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,40%	1,40%	2,01%	4,40%	11,19%	16,27%	-	-
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%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,38%	1,38%	2,19%	1,54%	4,54%	2,40%	0,93%	0,05%
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%
IMA-B (Benchmark)	0,00%	0,00%	-0,99%	2,84%	7,15%	5,93%	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,28%	0,28%	-0,64%	-0,12%	1,37%	-6,11%	3,05%	0,06%

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

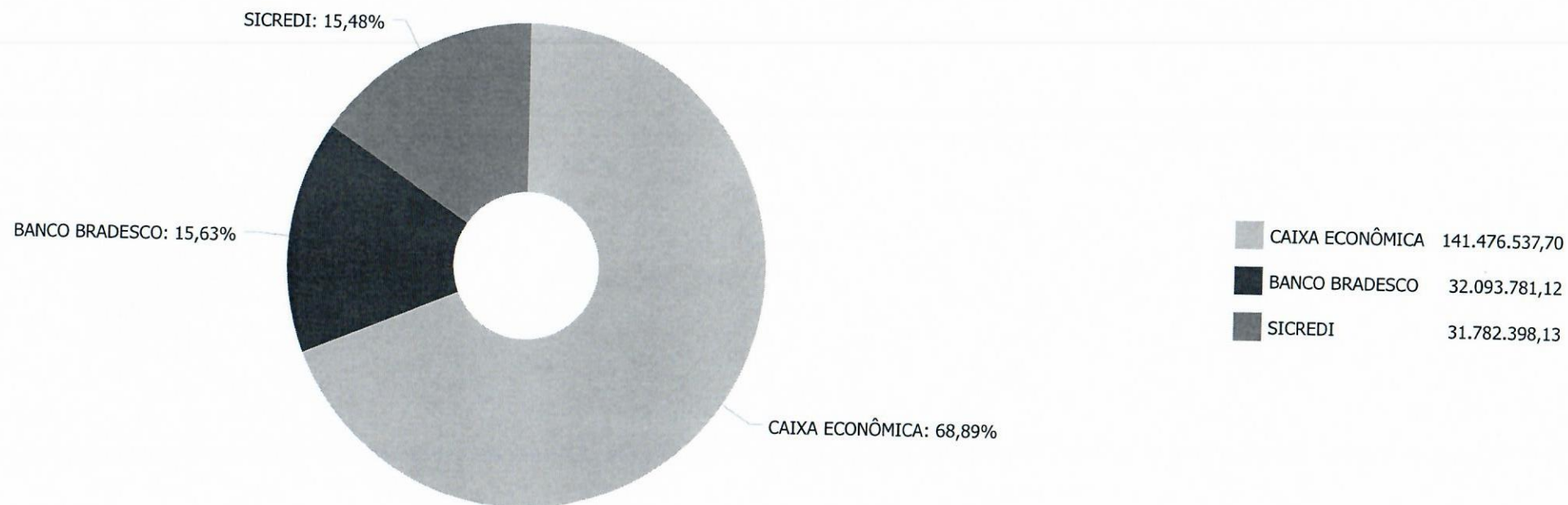
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,03%	-0,03%	-1,10%	2,78%	6,97%	5,46%	2,95%	0,04%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,09%	-0,09%	-1,23%	2,57%	6,74%	5,27%	3,00%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	0,84%	0,84%	1,65%	6,17%	9,82%	8,42%	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,89%	0,89%	1,53%	6,12%	10,20%	8,22%	1,76%	0,03%
Selic (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	1,10%	3,23%	6,59%	12,47%	17,97%	0,01%	0,00%
CDI (Benchmark)	1,12%	1,12%	3,30%	6,71%	12,81%	18,45%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	1,13%	3,39%	6,95%	13,39%	19,73%	0,02%	0,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	1,10%	1,10%	3,24%	6,58%	12,55%	17,82%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,96%	0,96%	2,84%	5,78%	10,97%	15,22%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,09%	1,09%	3,32%	6,79%	13,01%	18,95%	0,02%	0,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,12%	1,12%	3,22%	6,65%	12,79%	18,38%	0,02%	0,00%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	1,12%	3,26%	6,68%	12,73%	18,35%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,53%	0,53%	1,57%	1,50%	5,77%	16,75%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,28%	6,11%	11,10%	11,70%	0,39%	0,01%



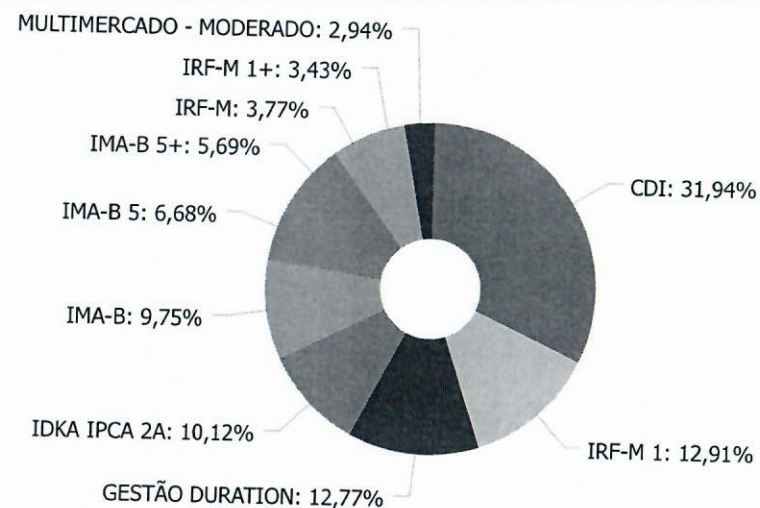
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2023 - RENDA VARIÁVEL

	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 BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1,12%	1,12%	1,54%	9,19%	13,41%	17,46%	2,15%	0,04%

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



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



■ CDI	65.593.789,84	■ IRF-M 1	26.520.143,87	■ GESTÃO DURATION	26.218.364,82	■ IDKA IPCA 2A	20.774.583,83
■ IMA-B	20.022.720,78	■ IMA-B 5	13.707.711,16	■ IMA-B 5+	11.677.238,80	■ IRF-M	7.742.720,34
■ IRF-M 1+	7.053.254,17	■ MULTIMERCADO - MODERADO	6.042.189,34				



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
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ ATENÇÃO! Meta de Rentabilidade de **2023** não está cadastrada !!!

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...	20.485.963,38	0,00	0,00	20.774.583,83	288.620,45	1,41%	1,41%	1,19%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.326.546,59	0,00	0,00	5.400.377,52	73.830,93	1,39%	1,39%	0,93%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.191.016,62	0,00	0,00	3.235.195,34	44.178,72	1,38%	1,38%	0,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	13.521.814,42	0,00	0,00	13.707.711,16	185.896,74	1,37%	1,37%	1,14%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	23.656.439,03	0,00	0,00	23.923.180,11	266.741,08	1,13%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.223.325,99	0,00	0,00	18.427.649,61	204.323,62	1,12%	1,12%	0,24%
SICREDI LIQUIDEZ EMPRESARIAL FI RENDA FIXA REFEREN...	15.771.049,59	0,00	0,00	15.947.183,53	176.133,94	1,12%	1,12%	0,01%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA CURTO...	2.924.641,79	0,00	0,00	2.956.903,80	32.262,01	1,10%	1,10%	0,00%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	8.004.452,34	0,00	0,00	8.092.494,26	88.041,92	1,10%	1,10%	0,23%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI RENDA FIXA REFERENCIADO ...	8.081.731,03	0,00	0,00	8.170.601,01	88.869,98	1,10%	1,10%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.374.975,35	0,00	0,00	4.422.847,02	47.871,67	1,09%	1,09%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	25.949.566,91	0,00	0,00	26.218.364,82	268.797,91	1,04%	1,04%	0,39%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.005.473,61	5.700.000,00	0,00	8.790.608,31	85.134,70	0,98%	1,12%	0,02%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	7.674.685,25	0,00	0,00	7.742.720,34	68.035,09	0,89%	0,89%	1,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.002.023,12	0,00	0,00	7.053.254,17	51.231,05	0,73%	0,73%	2,82%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	9.618.761,16	0,00	0,00	9.645.446,40	26.685,24	0,28%	0,28%	3,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	6.149.356,16	1.310.987,58	6.092.554,93	1.382.466,06	14.677,25	0,20%	0,96%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.978.662,42	0,00	0,00	8.975.712,80	-2.949,62	-0,03%	-0,03%	2,95%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	2.413.624,20	0,00	0,00	2.411.435,12	-2.189,08	-0,09%	-0,09%	3,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.391.623,52	0,00	2.300.000,00	2.031.792,40	-59.831,12	-1,36%	-1,28%	4,62%



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
Total Renda Fixa	198.745.732,48	7.010.987,58	8.392.554,93	199.310.527,61	1.946.362,48	0,98%		0,86%



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
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	5.975.028,39	0,00	0,00	6.042.189,34	67.160,95	1,12%	1,12%	2,15%
Total Renda Variável	5.975.028,39	0,00	0,00	6.042.189,34	67.160,95	1,12%		2,15%

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.