

---

REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DO MUNICÍPIO DE  
**SORRISO - MT / PREVISÃO**

**RELATÓRIO MENSAL**  
**DE**  
**INVESTIMENTOS**

**JANEIRO**  
**2023**

14 de fevereiro de 2023

## ÍNDICE

<b>1 – INTRODUÇÃO .....</b>	<b>2</b>
<b>2 – MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA e POLÍTICA DE INVESTIMENTOS .....</b>	<b>4</b>
2.1 - Movimentação Financeira da Carteira .....	4
2.2 - PAI - Limite de Segmento .....	5
2.3 - PAI - Limite de Benchmark .....	6
<b>3 – ENQUADRAMENTO: RESOLUÇÃO CMN 4.963/2021 .....</b>	<b>7</b>
3.1 - Enquadramento sobre Segmentos e Fundos de Investimento .....	7
3.1.1 - Disponibilidade Financeira e Total por Segmento .....	10
3.2 - Enquadramento sobre Patrimônio Líquido dos Fundos de Investimento .....	11
3.3 - Enquadramento dos Fundos de Investimento que recebem cotas .....	12
3.4 - Movimentação das Cotas Aplicadas nos Fundos de Investimento .....	13
3.5 - Enquadramento sobre os recursos de terceiros dos Gestores .....	14
<b>4 – SEPARAÇÃO DOS RECURSOS - PROVISÃO DE CAIXA .....</b>	<b>15</b>
<b>5 – PLANEJAMENTO FINANCEIRO .....</b>	<b>16</b>
<b>6 – DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA .....</b>	<b>17</b>
6.1 - Distribuição por Segmento (Renda Fixa e Renda Variável) .....	17
6.2 - Distribuição por índice (Benchmark) .....	18
6.3 - Distribuição por Instituição Financeira .....	19
6.4 - Distribuição dos Recursos Disponíveis e Imobilizado .....	20
6.4.1 - Distribuição da Disponibilidade dos Recursos nos próximos 25 anos .....	21
<b>7 – RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTO .....</b>	<b>23</b>
<b>8 – RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS .....</b>	<b>27</b>
<b>9 – RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO .....</b>	<b>38</b>
9.1 - Rentabilidade Mensal da Carteira de Investimentos .....	38
9.2 - Rentabilidade Acumulada da Carteira de Investimentos .....	39
9.3 - Rentabilidade da Carteira de Investimentos .....	41
9.4 - Meta Atuarial .....	41
<b>10 – ANÁLISE DO MERCADO .....</b>	<b>42</b>
<b>11 – ANÁLISE MACROECONÔMICA .....</b>	<b>46</b>
<b>12 – PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA .....</b>	<b>49</b>

## 1 - INTRODUÇÃO

Atendendo a necessidade do Instituto Previdenciário quanto a Política anual de Investimentos e a Meta Atuarial, enviamos o parecer econômico referente ao mês de JANEIRO, sobre o desempenho mensal das rentabilidades das atuais aplicações financeiras do PREVISÓ.

Este Relatório contém uma análise do enquadramento de suas aplicações frente à Resolução CMN 4.963/2021, um resumo do Regulamento dos fundos de investimento, uma análise sobre o comportamento mensal das rentabilidades ao longo do ano, uma análise do retorno da carteira de investimento quanto a Meta Atuarial e uma projeção sobre o cumprimento da Meta.

Este relatório vem atender o **Inciso II, do Art. 3º da Portaria MPS 519/2011**, que exige a elaboração de **Relatórios Mensais**, para acompanhamento do desempenho das aplicações financeiras.

*Art. 3. II – Exigir da entidade credenciada, mediante contrato, no mínimo mensalmente, relatório detalhado contendo informações sobre a rentabilidade e risco das aplicações.*

## 2.1-MOVIMENTAÇÃO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2022 - PREVISO

Nº	MESES	SALDO INICIAL	APORTES (Aplicação)	RESGATES	VARIÇÃO PU - TÍTULOS PÚBLICOS	RENTABILIDADE			SALDO FINAL
						Positiva (a)	Negativa (b)	Consolidado c = (a) - (b)	
1	JANEIRO	282.940.001,91	-	-	-	3.050.644,29	(11.115,34)	3.039.528,95	285.979.530,86
2	FEVEREIRO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
3	MARÇO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
4	ABRIL	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
5	MAIO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
6	JUNHO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
7	JULHO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
8	AGOSTO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
9	SETEMBRO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
10	OUTUBRO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
11	NOVEMBRO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
12	DEZEMBRO	285.979.530,86	-	-	-	-	-	-	285.979.530,86
13	ANO	282.940.001,91	-	-	-	3.050.644,29	(11.115,34)	3.039.528,95	285.979.530,86

\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).

## 2.2-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023 - LIMITE DE SEGMENTO - PREVISO

Nº	Segmentos da Resolução CMN 4.963/2021	Dispositivo Legal Resolução CMN 4.963/2021	Limites do PAI			Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
			Mínimo	Estratégia Alvo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
<b>RENDA FIXA</b>								
1	Títulos Públicos Federal	Art. 7, I, a (100%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
2	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas	Art. 7, I, b (100%)	0,0%	82,7%	100,0%	80,8%	232.793.075,68	-
3	F.I. Índice de Renda Fixa 100% T.P.F. e/ou Operação	Art. 7, I, c (100%)	0,0%	0,0%	100,0%	0,0%	-	-
4	Operações Compromissadas	Art. 7, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
5	F.I. de Renda Fixa	Art. 7, III, a (60%)	0,0%	13,0%	40,0%	15,1%	43.483.684,66	-
6	F.I. de Índice de Renda Fixa	Art. 7, III, b (60%)	0,0%	0,0%	40,0%	0,0%	-	-
7	Ativos Financeiros de Renda Fixa de I.F.	Art. 7, IV (20%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
8	FIDC - Classe Sênior	Art. 7, V, a (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
9	F.I. Renda Fixa de 'Crédito Privado'	Art. 7, V, b (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
10	F.I. em 85% de Debêntures	Art. 7, V, c (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
11	<b>TOTAL - RENDA FIXA</b>					<b>95,9%</b>	<b>276.276.760,34</b>	
<b>RENDA VARIÁVEL</b>								
12	F.I. Ações	Art. 8, I (30%)	0,0%	2,5%	12,0%	2,2%	6.308.825,20	-
13	F.I. Ações em Índices de Renda Variável	Art. 8, II (30%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
14	<b>TOTAL - RENDA VARIÁVEL</b>	Art. 8º (30%)				<b>2,2%</b>	<b>6.308.825,20</b>	
<b>INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>								
15	F.I. e F.I.C FI Multimercados	Art. 10, I (10%)	0,0%	0,8%	10,0%	0,8%	2.414.823,34	-
16	F.I. em Participações	Art. 10, II (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
17	F.I. Ações - Mercado de Acesso	Art. 10, III (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
18	<b>TOTAL - INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS</b>	Art. 10 (15%)				<b>0,8%</b>	<b>2.414.823,34</b>	
<b>FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>								
19	F.I. Imobiliário	Art. 11 (5%)	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	-	-
20	<b>TOTAL - FUNDOS IMOBILIÁRIOS</b>	Art. 11 (5%)				<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
<b>INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>								
21	FIC e FIC FI - Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9º, I (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
22	FIC - Aberto - Investimento no Exterior	Art. 9º, II (10%)	0,0%	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
23	Fundos de Ações - BDR Nível I	Art. 9º, III (10%)	0,0%	0,3%	10,0%	0,3%	979.121,98	-
24	<b>TOTAL - INVESTIMENTO NO EXTERIOR</b>	Art. 9º (10%)				<b>0,3%</b>	<b>979.121,98</b>	
<b>EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>								
25	Empréstimo Consignado	Art. 12 (5%)	0,0%	0,0%	5,0%	0,0%	-	-
26	<b>TOTAL - EMPRÉSTIMO CONSIGNADO</b>	Art. 12 (5%)				<b>0,0%</b>	<b>-</b>	
27	DESENQUADRADO	-		100,0%		0,0%	-	-
28	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	-				0,8%	2.247.517,22	
29	<b>PATRIMÔNIO TOTAL</b>					<b>100,0%</b>	<b>288.227.048,08</b>	

## 2.3-POLÍTICA DE INVESTIMENTOS 2023 - LIMITE DE BENCHMARK - PREVISÃO

Nº	ÍNDICES DE BENCHMARK	Limites do PAI		Carteira de Investimentos		ORIENTAÇÃO EM CASO DE DESENQUADRAMENTO DA CARTEIRA JUNTO A POLÍTICA DE INVESTIMENTO
		Mínimo	Máximo	Atualmente (%)	Atualmente (R\$)	
<b>RENDA FIXA</b>						
1	DI	0,0%	100,0%	14,8%	42.587.586,04	-
2	IRF - M 1	0,0%	100,0%	4,2%	12.215.959,53	-
3	IRF - M	0,0%	50,0%	16,4%	47.374.224,08	-
4	IRF - M 1+	0,0%	8,0%	0,0%	-	-
5	IMA - B 5	0,0%	60,0%	16,8%	48.290.130,25	-
6	IMA - B	0,0%	50,0%	18,0%	51.852.777,72	-
7	IMA - B 5+	0,0%	8,0%	0,0%	-	-
8	IMA - GERAL e IMA - GERAL ex-C	0,0%	20,0%	0,0%	-	-
9	IDKA 2, IDKA 3	0,0%	50,0%	25,7%	73.956.082,72	-
10	IPCA + TAXA DE JUROS	0,0%	70,0%	0,0%	-	-
<b>RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>						
11	MULTIMERCADO	0,0%	10,0%	0,0%	-	-
12	ÍNDICES DE RENDA VARIÁVEL	0,0%	30,0%	2,2%	6.308.825,20	-
13	ÍNDICES DE INVESTIMENTO NO EXTERIOR	0,0%	10,0%	1,2%	3.393.945,32	-
14	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	0,0%	0,0%	0,8%	2.247.517,22	-

Os demais índices (Benchmark) não listados acima, e que por ventura o RPPS venha aplicar, não possuem limitação de aplicação conforme PAI em vigor.

### 3.1-ENQUADRAMENTO SOBRE SEGMENTOS E FUNDOS DE INVESTIMENTOS

#### RENDA FIXA

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
1	10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	23.925.477,30	8,30%	SIM	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	80,77%	SIM
2	14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	23.398.562,85	8,12%	SIM			
3	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	48.290.130,25	16,75%	SIM			
4	14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	21.362.462,85	7,41%	SIM			
5	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	27.031.201,80	9,38%	SIM			
6	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	23.975.661,23	8,32%	SIM			
7	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	52.593.619,87	18,25%	SIM			
8	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	12.215.959,53	4,24%	SIM			
9	03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	10.013.452,89	3,47%	SIM	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	15,1%	SIM
10	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	896.098,62	0,31%	SIM			
11	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.574.133,15	11,30%	SIM			
<b>(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA</b>			<b>276.276.760,34</b>	<b>95,85%</b>				

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

**RENDA VARIÁVEL**

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
12	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.453.603,08	0,50%	SIM	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	2,2%	SIM
13	40.209.029/0001-00	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	1.870.596,20	0,65%	SIM			
14	13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.984.625,92	1,04%	SIM			
15	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2.414.823,34	0,84%	SIM	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	0,8%	SIM
<b>(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL</b>			<b>8.723.648,54</b>	<b>3,03%</b>				

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

**INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Fundo Enquadrado?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO	Enquadrado?
16	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	979.121,98	0,34%	SIM	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	0,3%	SIM
<b>(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR</b>			<b>979.121,98</b>	<b>0,34%</b>				

\* PL - Patrimônio Líquido.

*Referência: JANEIRO*

### 3.1.1-DISPONIBILIDADE FINANCEIRA E TOTAL POR SEGMENTO

Nº	DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)		
17	Banco do Brasil S.A.	2.202.034,89	0,76%
18	Caixa Econômica Federal	45.482,33	0,02%
<b>(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)</b>		<b>2.247.517,22</b>	<b>0,78%</b>

TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DO RPPS		
(1) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA FIXA	276.276.760,34	95,85%
(2) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - RENDA VARIÁVEL	8.723.648,54	3,03%
(3) TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS - INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	979.121,98	0,34%
(4) TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)	2.247.517,22	0,78%
<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO TOTAL ( 1 + 2 + 3 + 4 )</b>	<b>288.227.048,08</b>	<b>100,00%</b>

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

### 3.2-ENQUADRAMENTO SOBRE O PATRIMÔNIO LÍQUIDO DOS FUNDOS

Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	Nº	CNPJ	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	Patrimônio Líquido do Fundo de Investimento	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	Enquadrado?
Art. 19 - As aplicações deverão representar até 15% do patrimônio líquido do fundo.	1	13.077.418/0001-49	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.574.133,15	12.971.898.325,20	0,251%	SIM
	2	11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	12.215.959,53	6.562.900.517,46	0,186%	SIM
	3	13.322.205/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	52.593.619,87	7.184.164.479,15	0,732%	SIM
	4	07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	23.975.661,23	3.963.755.899,38	0,605%	SIM
	5	07.442.078/0001-05	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	27.031.201,80	5.926.967.108,44	0,456%	SIM
	6	07.861.554/0001-22	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	896.098,62	623.643.129,05	0,144%	SIM
	7	03.737.206/0001-97	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	10.013.452,89	15.285.936.736,43	0,066%	SIM
	8	14.386.926/0001-71	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	21.362.462,85	6.830.711.830,39	0,313%	SIM
	9	11.060.913/0001-10	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	48.290.130,25	7.844.346.137,20	0,616%	SIM
	10	14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	23.398.562,85	1.019.210.632,83	2,296%	SIM
	11	10.740.658/0001-93	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	23.925.477,30	3.356.845.685,28	0,713%	SIM
	12	13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.984.625,92	488.009.000,20	0,612%	SIM
	13	40.209.029/0001-00	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	1.870.596,20	21.684.162,85	8,627%	SIM
	14	15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.453.603,08	583.745.036,37	0,249%	SIM
	15	30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2.414.823,34	1.758.911.660,14	0,137%	SIM
	16	17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	979.121,98	1.979.769.025,50	0,049%	SIM
<b>TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO</b>				<b>285.979.530,86</b>			
<b>TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)</b>				<b>2.247.517,22</b>			
<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>				<b>288.227.048,08</b>			

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

### 3.3-ENQUADRAMENTO DOS FUNDOS DE INVESTIMENTOS QUE RECEBEM COTAS DE FI

FIC - Fundo de Investimento em Cotas	Distribuição das cotas do FIC	Valor Aplicado no Fundo (R\$)	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	Patrimônio Líquido do FI	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do FUNDO	ENQUADRADO?	Dispositivo da Resolução CMN 4.963/2021	(%) Recursos do RPPS sobre o SEGMENTO
FI - Fundo de Investimento								
<b>BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI</b>	<b>100,00%</b>	<b>12.215.959,53</b>	<b>4,24%</b>	<b>6.562.900.517,46</b>	<b>0,186%</b>	<b>SIM</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	<b>80,8%</b>
BB IRF-M 1 FI RF	100,00%	12.215.959,53	4,24%	6.562.965.655,15	0,19%	SIM		
<b>BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI</b>	<b>100,00%</b>	<b>32.574.133,15</b>	<b>11,30%</b>	<b>12.971.898.325,20</b>	<b>0,251%</b>	<b>SIM</b>	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60%)	<b>15,1%</b>
BB TOP DI RF REF DI LP FI	100,00%	32.574.133,15	11,30%	26.550.286.875,54	0,12%	SIM		
<b>FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO</b>	<b>0,69%</b>	<b>1.453.603,08</b>	<b>0,50%</b>	<b>583.745.036,37</b>	<b>0,249%</b>	<b>SIM</b>	F.I. Ações, Art. 8, I (30%)	<b>2,2%</b>
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REF DI LP	0,55%	7.965,74	0,00%	15.385.872.720,97	0,00%	SIM		
<b>CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES</b>	<b>2,08%</b>	<b>1.870.596,20</b>	<b>0,65%</b>	<b>21.684.162,85</b>	<b>8,627%</b>	<b>SIM</b>		
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REF DI LP	0,24%	4.508,14	0,00%	15.385.872.720,97	0,00%	SIM		
<b>CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES</b>	<b>0,64%</b>	<b>2.984.625,92</b>	<b>1,04%</b>	<b>488.009.000,20</b>	<b>0,612%</b>	<b>SIM</b>		
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REF DI LP	0,64%	19.071,76	0,01%	15.385.872.720,97	0,00%	SIM		
<b>FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I</b>	<b>0,92%</b>	<b>979.121,98</b>	<b>0,34%</b>	<b>1.979.769.025,50</b>	<b>0,049%</b>	<b>SIM</b>	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)	<b>0,3%</b>
FI CAIXA MASTER CONSERVADOR RF REF DI LP	0,97%	9.536,65	0,00%	15.385.872.720,97	0,00%	SIM		

### 3.4-MOVIMENTAÇÃO DAS COTAS APLICADAS NOS FUNDOS DE INVESTIMENTO

Nº	Agência	Conta	Fundo de Investimento	CNPJ	Valor da Cota		Quantidade de Cotas			
					Inicial *	Final **	Inicial *	Aplicação	Resgate	Final **
1	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	03.737.206/0001-97	4,4068090	4,4550290	2.247.674,007122	0,000000	0,000000	2.247.674,007122
2	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP	14.386.926/0001-71	2,7357400	2,7742830	7.700.174,370329	0,000000	0,000000	7.700.174,370329
3	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	11.060.913/0001-10	3,6937240	3,7445050	12.896.265,390795	0,000000	0,000000	12.896.265,390795
4	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	10.740.658/0001-93	3,8628570	3,8615880	4.703.377,703190	0,000000	0,000000	4.703.377,703190
5	2756	006.00000007-3	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	14.508.605/0001-00	2,5046720	2,5267120	9.260.478,772650	0,000000	0,000000	9.260.478,772650
6	2756	006.00000034-0	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	10.740.658/0001-93	3,8628570	3,8615880	1.492.383,547873	0,000000	0,000000	1.492.383,547873
7	1917-8	12598-9	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	3,3076264	3,3551315	5.941.074,284644	0,000000	0,000000	5.941.074,284644
8	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	07.861.554/0001-22	6,0623487	6,0595673	147.881,618696	0,000000	0,000000	147.881,618696
9	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	07.111.384/0001-69	6,5231819	6,5764636	3.645.676,862787	0,000000	0,000000	3.645.676,862787
10	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	07.442.078/0001-05	6,8348623	6,8341439	3.955.316,453380	0,000000	0,000000	3.955.316,453380
11	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	11.328.882/0001-35	3,1252129	3,1582454	3.867.957,662819	0,000000	0,000000	3.867.957,662819
12	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	13.322.205/0001-35	3,3076264	3,3551315	9.734.501,963260	0,000000	0,000000	9.734.501,963260
13	1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	13.077.418/0001-49	2,7113190	2,7417883	11.880.615,555183	0,000000	0,000000	11.880.615,555183
14	2756	006.00000007-3	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	30.036.235/0001-02	1,5576730	1,6593250	1.455.304,618409	0,000000	0,000000	1.455.304,618409
15	2756	006.00000007-3	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	40.209.029/0001-00	871,1669838	884,2383226	2.115,488723	0,000000	0,000000	2.115,488723
16	2756	006.00000007-3	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	13.058.816/0001-18	2,4866800	2,5686170	1.161.958,329357	0,000000	0,000000	1.161.958,329357
17	2756	006.00000007-3	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	15.154.220/0001-47	1,3646470	1,4097340	1.031.118,693478	0,000000	0,000000	1.031.118,693478
18	2756	006.00000007-3	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	17.502.937/0001-68	4,8953213	5,1066721	191.733,865029	0,000000	0,000000	191.733,865029

\* Informação baseada no último dia útil do mês anterior (30/12/2022).

\*\* Informação baseada no último dia útil do mês (31/01/2023).

### 3.5-ENQUADRAMENTO SOBRE OS RECURSOS DE TERCEIROS DOS GESTORES

Nº	Gestor de Recursos	Recursos do RPPS aplicado no Gestor	Total de Recursos de Terceiros geridos pelo GESTOR	(%) Recursos do RPPS sobre o PL* do GESTOR	Enquadrado?
1	BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	149.286.674,20	1.401.527.113.346,63	0,0107%	SIM
2	CAIXA ASSET DTVM	136.692.856,66	481.650.462.530,98	0,0284%	SIM
<b>TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTO</b>		<b>285.979.530,86</b>			
<b>TOTAL DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (Conta Corrente)</b>		<b>2.247.517,22</b>			
<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO</b>		<b>288.227.048,08</b>			

\* PL - Patrimônio Líquido.

Referência: JANEIRO

#### 4-SEPARAÇÃO DOS RECURSOS - PROVISÃO DE CAIXA

##### PROVISÃO DE CAIXA DEFINIDA NO PAI/2023?

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido *
PROVISÃO DE CAIXA CONTIDA NO PAI/2023?	23.650.000,00	8,6%

*\*POSIÇÃO DA CARTEIRA (R\$) EM 31/10/2022.*

##### ATUALIZAÇÃO DOS VALORES EM PROVISÃO DE CAIXA

SEPARAÇÃO DOS RECURSOS	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido *
Valor Atualizado em Fundos para Provisão de Caixa (Curto Prazo)	42.587.586,04	14,9%

*Referência: JANEIRO*

NECESSIDADE ATUAL DAS OBRIGAÇÕES PREVIDENCIÁRIAS ATÉ O FIM DO ANO	VALOR (em R\$)	% dos Recursos em Fundos para Provisão de Caixa
	21.830.769,23	7,6%

*Referência: JANEIRO*

A Política de Investimento determina que parte dos recursos acumulados sejam separados por **PROVISÃO DE CAIXA**. Essa separação tem o intuito de amenizar os efeitos da volatilidade do mercado, sobre os recursos utilizados no curto prazo, em casos de interrupção no Fluxo de caixa (repasse e outras receitas).

## 5-PLANEJAMENTO FINANCEIRO

### PLANEJAMENTO FINANCEIRO (ORGANIZAÇÃO DOS RECURSOS)

Nº	FINALIDADE		AGÊNCIA	CONTA	Fundo de Investimento	Valor Aplicado	(%) Recursos do RPPS sobre o FUNDO	(R\$) Total dos Recursos do RPPS	(%) Total dos Recursos do RPPS
1	PLANO DE BENEFÍCIO	RECURSOS A LONGO PRAZO	2756	006.00000007-	FI CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2 A TP RF LP	21.362.462,85	7,47%	243.391.944,82	85,11%
2			2756	006.00000007-	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	48.290.130,25	16,89%		
3			2756	006.00000007-	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	18.162.506,90	6,35%		
4			2756	006.00000007-	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	23.398.562,85	8,18%		
5			2756	006.00000034-	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	5.762.970,40	2,02%		
6			1917-8	12598-9	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	19.933.085,56	6,97%		
7			1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	896.098,62	0,31%		
8			1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	23.975.661,23	8,38%		
9			1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	27.031.201,80	9,45%		
			1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	12.215.959,53	4,27%		
			1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 TP FI	32.660.534,31	11,42%		
			2756	006.00000007-	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	2.414.823,34	0,84%		
			2756	006.00000007-	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	1.870.596,20	0,65%		
			2756	006.00000007-	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	2.984.625,92	1,04%		
			2756	006.00000007-	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	1.453.603,08	0,51%		
			2756	006.00000007-	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	979.121,98	0,34%		
16	PROVISÃO DE CAIXA		2756	006.00000007-	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	10.013.452,89	3,50%	42.587.586,04	14,89%
17			1917-8	17002-X	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	32.574.133,15	11,39%		
<b>TOTAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS</b>						<b>285.979.530,86</b>	<b>100%</b>	<b>285.979.530,86</b>	<b>100%</b>

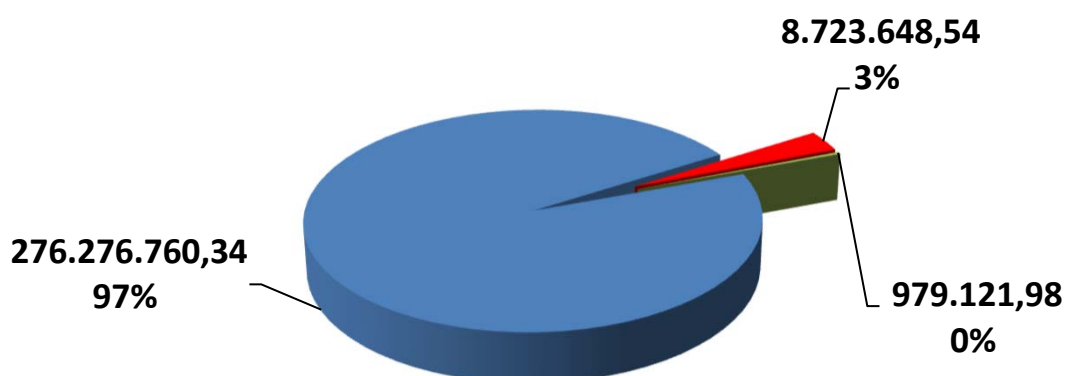
## 6. - DISTRIBUIÇÃO ESTATÍSTICA DA CARTEIRA

### 6.1-DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO (RENDA FIXA e RENDA VARIÁVEL)

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RENDA FIXA	276.276.760,34	96,6%
RENDA VARIÁVEL	8.723.648,54	3,1%
INVESTIMENTO NO EXTERIOR	979.121,98	0,3%
<b>TOTAL</b>	<b>285.979.530,86</b>	<b>100,0%</b>

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / SEGMENTO

■ RENDA FIXA ■ RENDA VARIÁVEL ■ INVESTIMENTO NO EXTERIOR

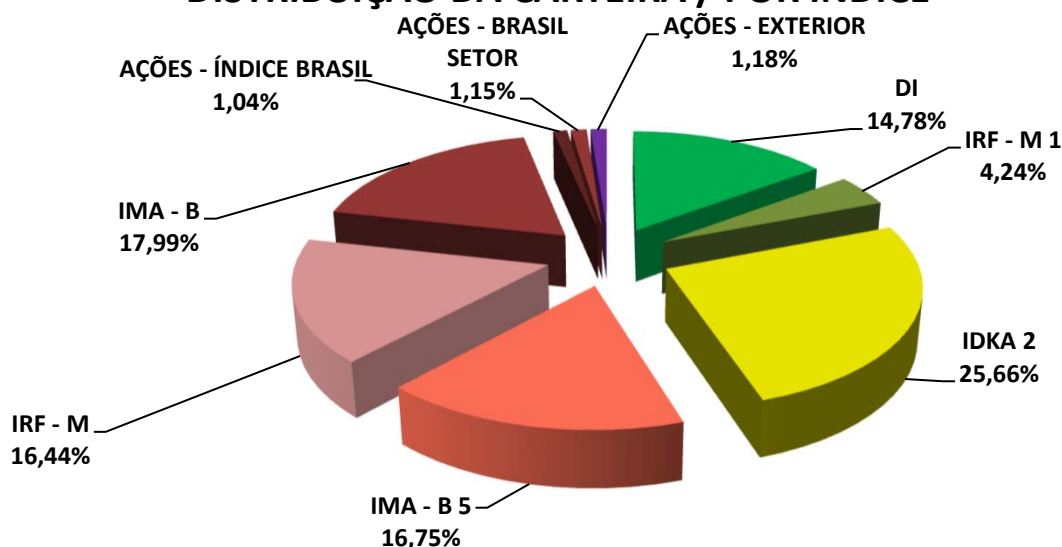


*\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).*

## 6.2-DISTRIBUIÇÃO POR ÍNDICE (Benchmark)

ÍNDICE (BENCHMARK)	VALOR APLICADO (em R\$)	(%) sobre PL RPPS	ÍNDICES AGRUPADOS	VALOR TOTAL (R\$)	(%) TOTAL sobre PL RPPS
DI	42.587.586,04	14,78%	RENDA FIXA - CURTO PRAZO	54.803.545,57	19,01%
IRF - M 1	12.215.959,53	4,24%			
IDKA 2	73.956.082,72	25,66%	RENDA FIXA - MÉDIO PRAZO	122.246.212,97	42,41%
IDKA 3	-	0,00%			
IMA - B 5	48.290.130,25	16,75%			
IMA - GERAL / IMA-GERAL EX - C	-	0,00%	RENDA FIXA - LONGO PRAZO	99.227.001,80	34,43%
IRF - M	47.374.224,08	16,44%			
IMA - B	51.852.777,72	17,99%			
IRF - M 1+	-	0,00%	RENDA FIXA - LONGUÍ. PRAZO	-	0,00%
IMA - B 5+	-	0,00%			
IPCA	-	0,00%	IPCA + TAXAS DE JUROS	-	0,00%
IPCA + 5,00% a.a.	-	0,00%			
IPCA + 6,00% a.a.	-	0,00%			
IPCA + 7,50% a.a.	-	0,00%			
IPCA + 8,00% a.a.	-	0,00%			
MULTIMERCADO	-	0,00%	MULTIMERCADO	-	0,00%
IBOVESPA	2.984.625,92	1,04%	AÇÕES - ÍNDICE BRASIL	2.984.625,92	1,04%
IBR - X	-	0,00%			
IGC	-	0,00%			
STANDARD & POOR'S 500 (BR)	-	0,00%			
PETROBRÁS	-	0,00%	AÇÕES - BRASIL SETOR	3.324.199,28	1,15%
VALE	-	0,00%			
CONSUMO (ICON)	-	0,00%			
SMALL CAPS	1.453.603,08	0,50%			
SETOR FINANCEIRO	1.870.596,20	0,65%			
CONSTRUÇÃO CIVIL	-	0,00%			
IMOBILIÁRIO - IMOB	-	0,00%	SETOR IMOBILIÁRIO	-	0,00%
IMOBILIÁRIO - IFIX	-	0,00%	AÇÕES - EXTERIOR	3.393.945,32	1,18%
BDR - NÍVEL I	979.121,98	0,34%			
S&P 500 (BOLSA EUA)	2.414.823,34	0,84%			
<b>TOTAL</b>	<b>285.979.530,86</b>	<b>99,22%</b>		<b>285.979.530,86</b>	<b>99,22%</b>

### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR ÍNDICE



### 6.3-DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
BB Gestão de Recursos DTVM S.A.	149.286.674,20	51,79%
Caixa Econômica Federal	136.692.856,66	47,43%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.247.517,22	0,78%
<b>TOTAL</b>	<b>288.227.048,08</b>	<b>100,00%</b>

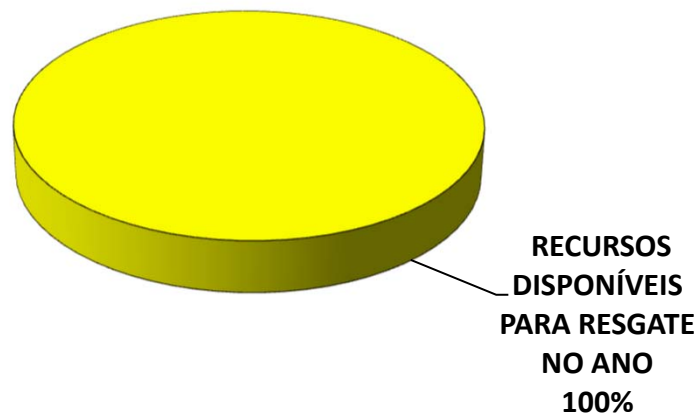
#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA / POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA



#### 6.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS POR LIQUIDEZ

SEGMENTO	VALOR APLICADO (em R\$)	Percentual sobre Patrimônio Líquido RPPS
RECURSOS DISPONÍVEIS PARA RESGATE NO ANO	288.227.048,08	100,00%
<b>TOTAL</b>	<b>288.227.048,08</b>	<b>100,00%</b>

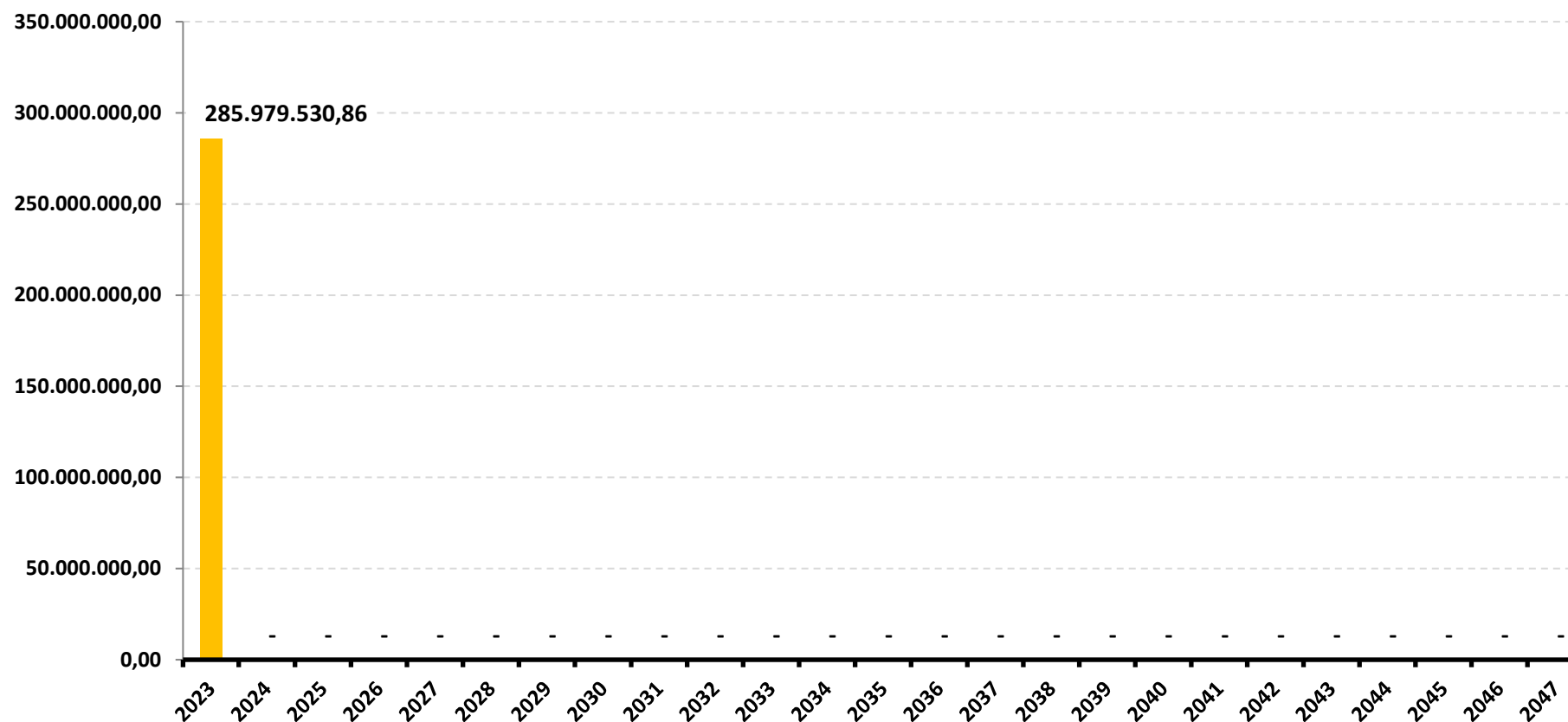
#### DISTRIBUIÇÃO DA CARTEIRA /POR LIQUIDEZ



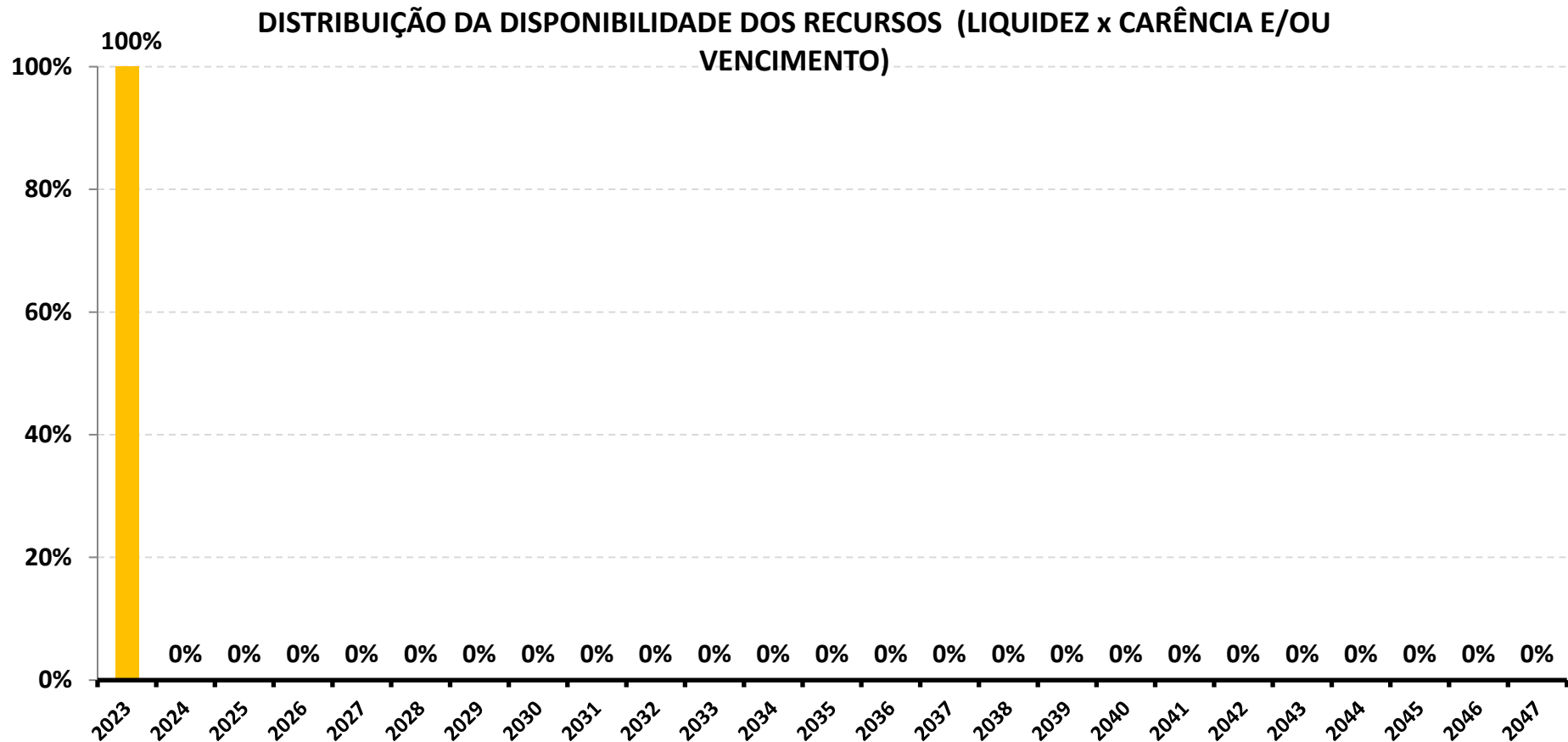
## 6.4-DISTRIBUIÇÃO DOS RECURSOS DISPONÍVEIS POR LIQUIDEZ

### 6.4.1-DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS NOS PRÓXIMOS 25 ANOS

DISTRIBUIÇÃO DA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS (LIQUIDEZ x CARÊNCIA E/OU VENCIMENTO)



\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).



*\*OS VALORES ACIMA NÃO CONSIDERAM DISPONIBILIDADE FINANCEIRA (CONTA CORRENTE).*

## 7-RESUMO DO REGULAMENTO DOS INVESTIMENTOS

1

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF REF DI LP PERFIL FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI
CNPJ	13.077.418/0001-49	11.328.882/0001-35	13.322.205/0001-35	07.111.384/0001-69
SEGMENTO	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa	Renda Fixa
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
ÍNDICE	CDI	IRF-M 1	IDKA IPCA 2A	IRF-M
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
DATA DE INÍCIO	28/04/2011	08/12/2009	28/04/2011	08/12/2004
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,2% a.a.	0,3% a.a.	0,2% a.a.	0,2% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	Não há.	Não há.	Não há.	Não há.
APLICAÇÃO INICIAL	1000	1000	10000	10000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	0,01	0,01	0	0,01
RESGATE MÍNIMO	0,01	0,01	0	0,01
SALDO MÍNIMO	0,01	0,01	0	0,01
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	<b>2 - Baixo</b>	<b>2 - Baixo</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>3 - Médio</b>
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	12.971.898.325,20	6.562.900.517,46	7.184.164.479,15	3.963.755.899,38
NÚMERO DE COTISTAS **	1070	1116	977	481
VALOR DA COTA **	2,741788336	3,158245409	3,355131514	6,576463613
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	06/08/2018	05/02/2020	05/02/2020	09/10/2017
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

\*\* Informações posicionadas no último dia útil do mês.

2

INFORMAÇÕES	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B TP FI	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA - B FI	FI CAIXA BRASIL RF REF DI LONGO PRAZO	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2 A TP RF LP
<b>CNPJ</b>	07.442.078/0001-05	07.861.554/0001-22	03.737.206/0001-97	14.386.926/0001-71
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa
<b>ÍNDICE</b>	IMA-B	IMA-B	CDI	IDKA 2
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
<b>DATA DE INÍCIO</b>	24/07/2005	09/03/2006	05/07/2006	16/08/2012
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,2% a.a.	0,3% a.a.	0,2% a.a.	0,2% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não há.	Não há.	Não há.	Não há.
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	10000	10000	1000	1000
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	0,01	0,01	0	0
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0,01	0,01	0	0
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0,01	0,01	0	0
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO *</b>	<b>4 - Alto</b>	<b>4 - Alto</b>	<b>1 - Muito Baixo</b>	<b>3 - Médio</b>
<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO **</b>	5.926.967.108,44	623.643.129,05	15.285.936.736,43	6.830.711.830,39
<b>NÚMERO DE COTISTAS **</b>	547	212	1000	948
<b>VALOR DA COTA **</b>	6,834143898	6,059567274	4,455029	2,774283
<b>DATA DO REGULAMENTO VIGENTE</b>	11/10/2017	23/05/2016	06/05/2019	26/09/2018
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. de Renda Fixa, Art. 7, III, a (60% e 20% por Fundo)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

\*\* Informações posicionadas no último dia útil do mês.

3

INFORMAÇÕES	FI CAIXA BRASIL IMA - B 5 TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	FI CAIXA BRASIL IMA - B TP RF LP	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES
<b>CNPJ</b>	11.060.913/0001-10	14.508.605/0001-00	10.740.658/0001-93	13.058.816/0001-18
<b>SEGMENTO</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Fixa</b>	<b>Renda Variável</b>
<b>CLASSIFICAÇÃO</b>	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Renda Fixa	Fundo de Ações
<b>ÍNDICE</b>	IMA - B 5	IRF-M	IMA-B	IBOVESPA
<b>PÚBLICO ALVO</b>	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
<b>DATA DE INÍCIO</b>	09/07/2010	16/08/2012	08/03/2010	29/07/2011
<b>TAXA DE ADMINISTRAÇÃO</b>	0,2% a.a.	0,2% a.a.	0,2% a.a.	0,5% a.a.
<b>TAXA DE PERFORMANCE</b>	Não há.	Não há.	Não há.	Não há.
<b>APLICAÇÃO INICIAL</b>	1000	1000	1000	1000
<b>APLICAÇÕES ADICIONAIS</b>	0	0	0	100
<b>RESGATE MÍNIMO</b>	0	0	0	100
<b>SALDO MÍNIMO</b>	0	0	0	500
<b>CARÊNCIA</b>	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
<b>CRÉDITO DO RESGATE</b>	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+0 (No mesmo dia da solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
<b>RISCO DE MERCADO *</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>3 - Médio</b>	<b>4 - Alto</b>
<b>PATRIMÔNIO LÍQUIDO **</b>	7.844.346.137,20	1.019.210.632,83	3.356.845.685,28	488.009.000,20
<b>NÚMERO DE COTISTAS **</b>	928	294	732	96
<b>VALOR DA COTA **</b>	3,744505	2,526712	3,861588	2,568617
<b>DATA DO REGULAMENTO VIGENTE</b>	17/10/2019	26/09/2018	17/10/2019	19/02/2021
<b>ENQUADRAMENTO LEGAL</b>	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. 100% T.P.F. e/ou Operações Compromissadas, Art. 7, I, b (100%)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

\*\* Informações posicionadas no último dia útil do mês.

4

INFORMAÇÕES	CAIXA INDEXA SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I
CNPJ	40.209.029/0001-00	15.154.220/0001-47	30.036.235/0001-02	17.502.937/0001-68
SEGMENTO	Renda Variável	Renda Variável	Investimentos Estruturados	Investimento no Exterior
CLASSIFICAÇÃO	Fundo de Ações	Fundo de Ações	Fundo Multimercado	Fundo de Ações
ÍNDICE	IFNC	SMLL	S&P500	BDR
PÚBLICO ALVO	Público Geral	Público Geral	Público Geral	Público Geral
DATA DE INÍCIO	26/01/2021	01/11/2012	16/10/2018	24/06/2013
TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	0,8% a.a.	1,5% a.a.	0,8% a.a.	0,7% a.a.
TAXA DE PERFORMANCE	NÃO HÁ	Não há.	Não há.	Não há.
APLICAÇÃO INICIAL	100	1000	100	1000
APLICAÇÕES ADICIONAIS	100	100	100	100
RESGATE MÍNIMO	100	100	100	100
SALDO MÍNIMO	50	500	50	500
CARÊNCIA	Não possui	Não possui	Não possui	Não possui
CRÉDITO DO RESGATE	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)	D+1 (No dia seguinte a solicitação)	D+3 (Três dias úteis após a solicitação)
RISCO DE MERCADO *	<b>4 - Alto</b>	<b>5 - Muito Alto</b>	<b>4 - Alto</b>	<b>4 - Alto</b>
PATRIMÔNIO LÍQUIDO **	21.684.162,85	583.745.036,37	1.758.911.660,14	1.979.769.025,50
NÚMERO DE COTISTAS **	344	6737	8463	505
VALOR DA COTA **	884,2383201	1,409734	1,659325	5,10667212
DATA DO REGULAMENTO VIGENTE	17/11/2020	17/12/2020	04/01/2021	03/11/2020
ENQUADRAMENTO LEGAL	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. Ações, Art. 8, I (30% e 20% por Fundo)	F.I. e F.I.C FI Multimercados, Art. 10, I (10%)	Fundos de Ações - BDR Nível I, Art. 9º, III (10%)

\* Definição da Instituição financeira. Quanto mais próximo do 5, maior o risco de mercado.

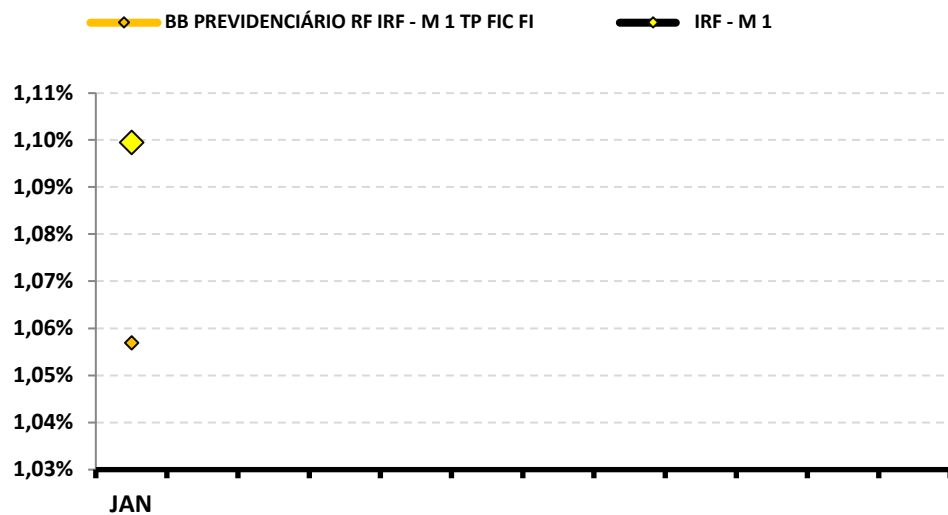
\*\* Informações posicionadas no último dia útil do mês.



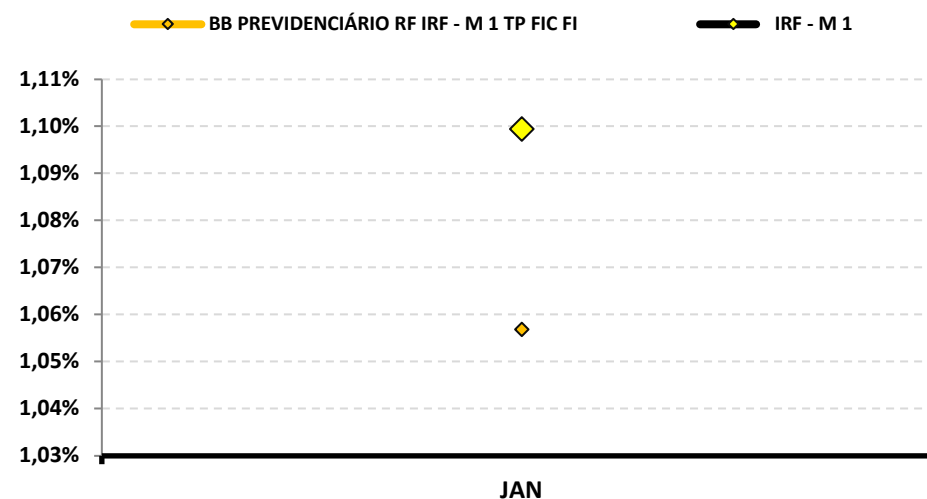
**RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2023 - Fundos atrelados ao IRF - M 1**

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN												ACUMULADO
11.328.882/0001-35	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M 1 TP FIC FI	1,06%												1,06%
	<b>IRF - M 1</b>	<b>1,10%</b>												<b>1,10%</b>

**Rentabilidade Mensal**



**Rentabilidade Acumulada**



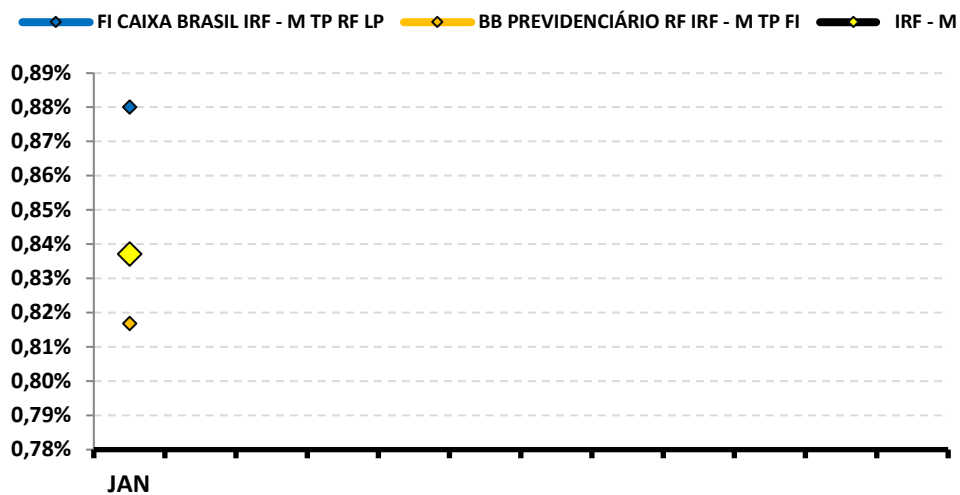




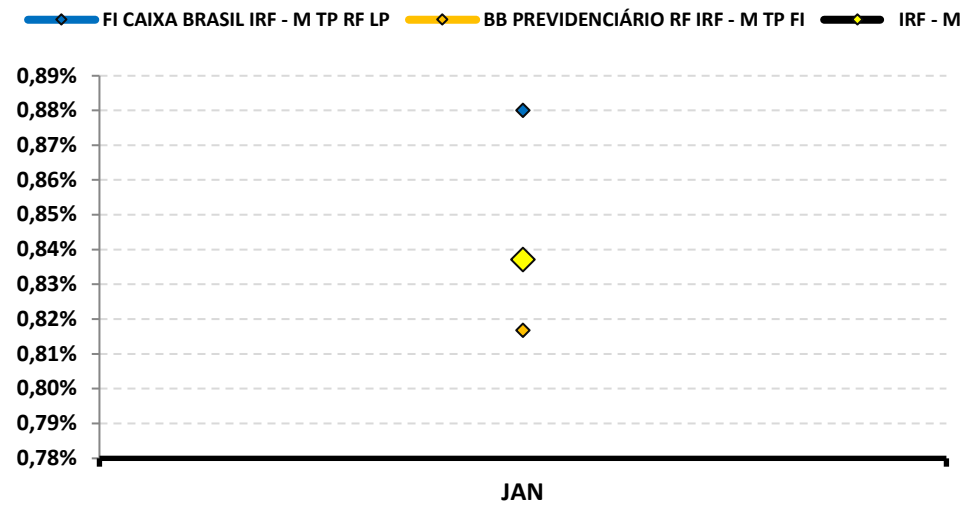
**RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2023 - Fundos atrelados ao IRF - M**

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN												ACUMULADO
14.508.605/0001-00	FI CAIXA BRASIL IRF - M TP RF LP	0,88%												0,88%
07.111.384/0001-69	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF - M TP FI	0,82%												0,82%
	<b>IRF - M</b>	<b>0,84%</b>												<b>0,84%</b>

**Rentabilidade Mensal**



**Rentabilidade Acumulada**

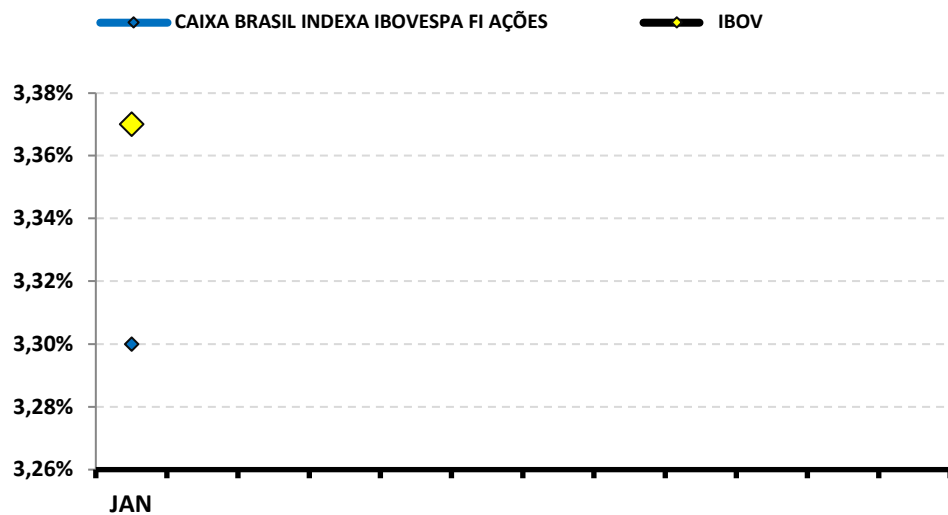




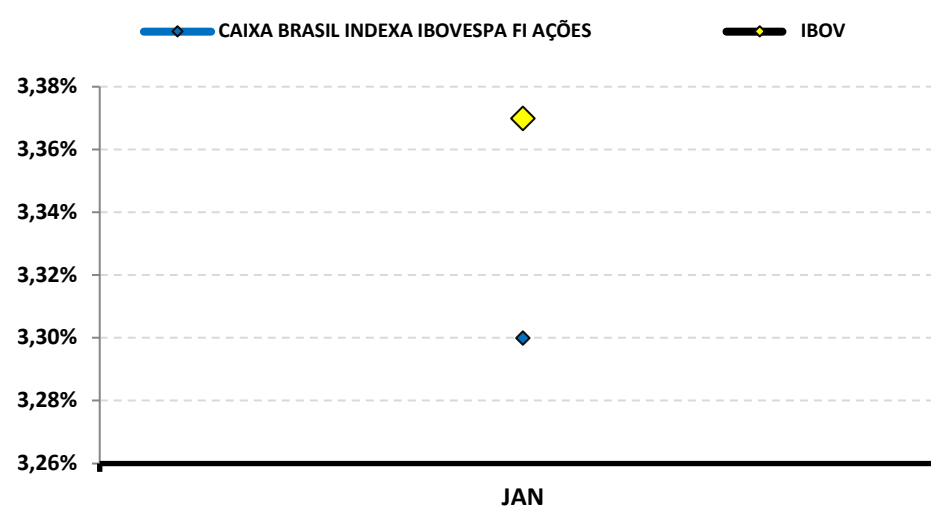
**RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2023 - Fundos atrelados ao IBOV**

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN												ACUMULADO
13.058.816/0001-18	CAIXA BRASIL INDEXA IBOVESPA FI AÇÕES	3,30%												3,30%
	<b>IBOV</b>	<b>3,37%</b>												<b>3,37%</b>

**Rentabilidade Mensal**



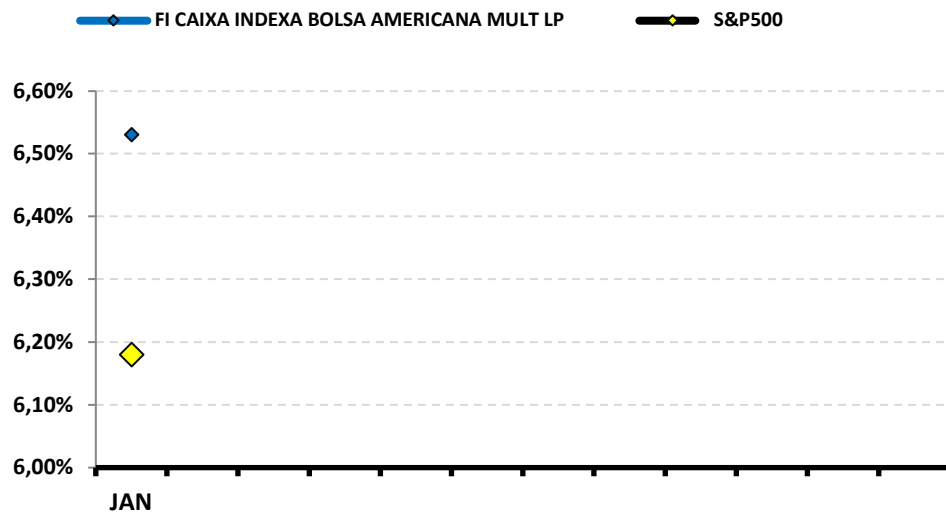
**Rentabilidade Acumulada**



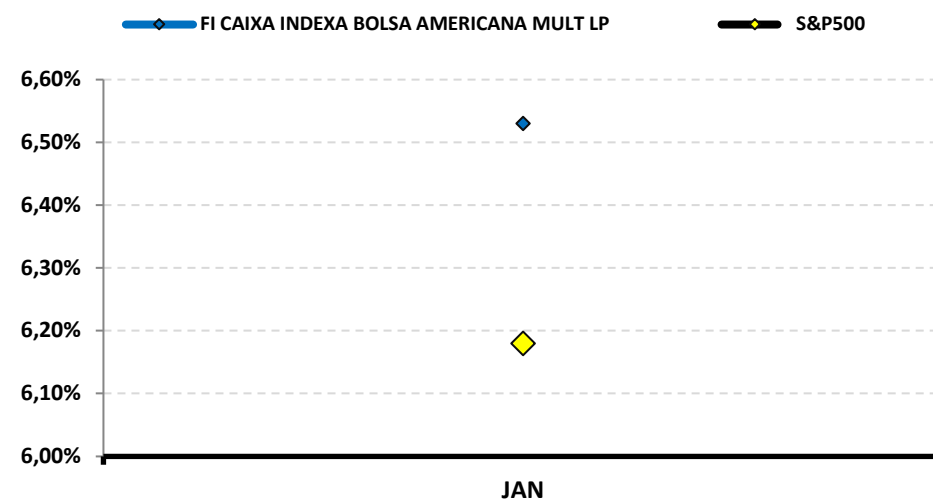
**RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2023 - Fundos atrelados ao S&P500**

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN												ACUMULADO
30.036.235/0001-02	FI CAIXA INDEXA BOLSA AMERICANA MULT LP	6,53%												6,53%
	<b>S&amp;P500</b>	<b>6,18%</b>												<b>6,18%</b>

**Rentabilidade Mensal**



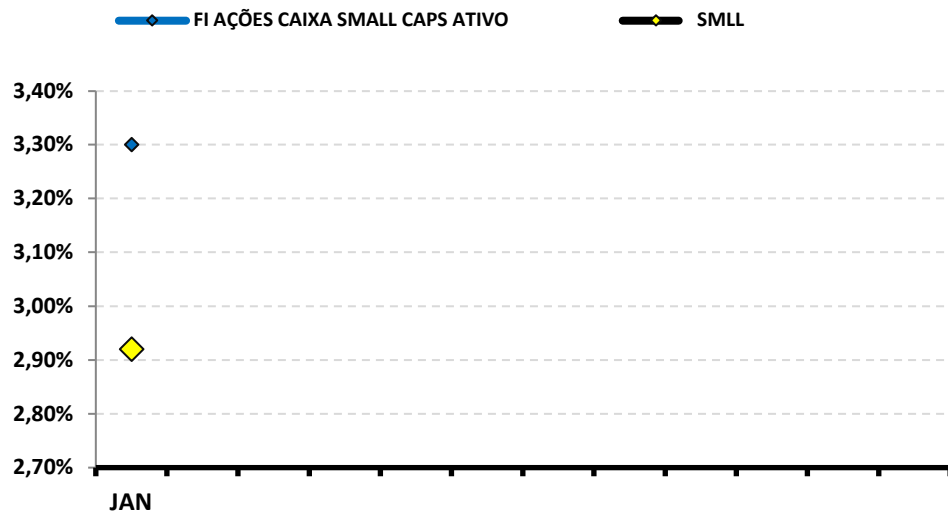
**Rentabilidade Acumulada**



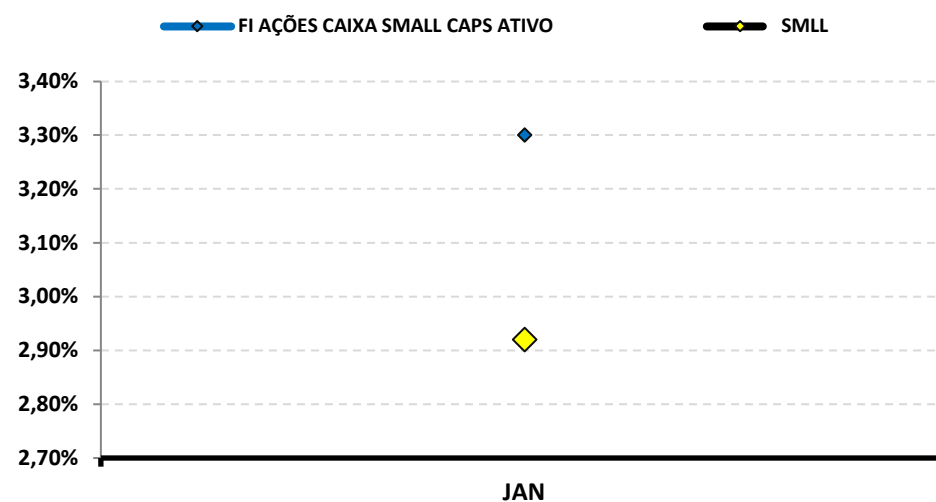
**RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2023 - Fundos atrelados ao SMLL**

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN												ACUMULADO
15.154.220/0001-47	FI AÇÕES CAIXA SMALL CAPS ATIVO	3,30%												<b>3,30%</b>
	<b>SMLL</b>	<b>2,92%</b>												<b>2,92%</b>

**Rentabilidade Mensal**



**Rentabilidade Acumulada**

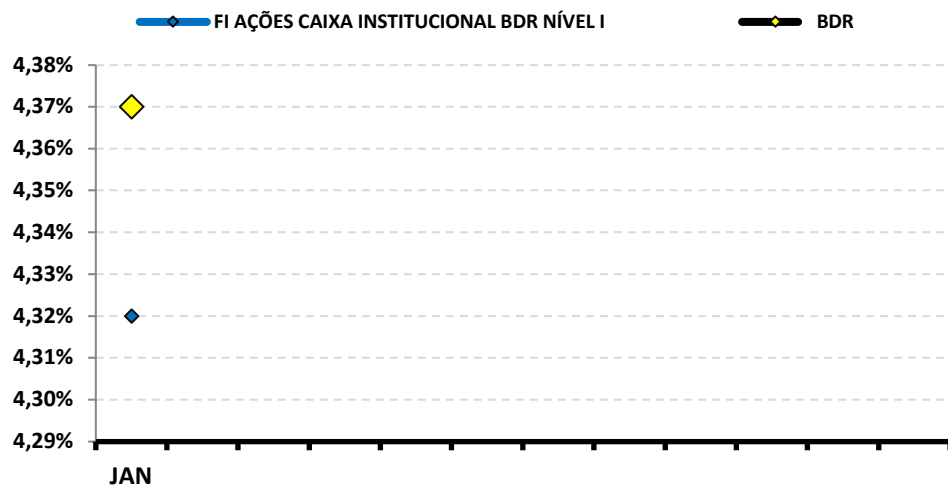




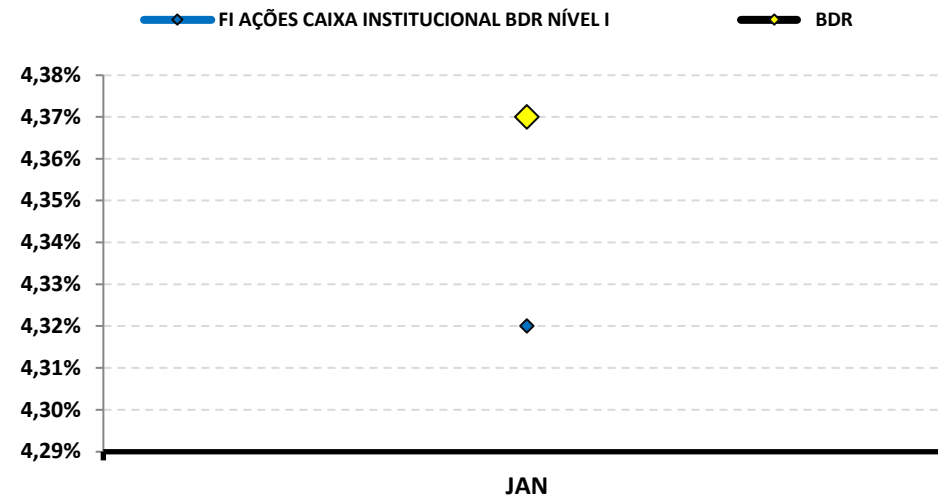
**RENTABILIDADE DOS INVESTIMENTOS - 2023 - Fundos atrelados ao BDR**

CNPJ	Fundos de Investimento	JAN												ACUMULADO
17.502.937/0001-68	FI AÇÕES CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	4,32%												4,32%
	<b>BDR</b>	<b>4,37%</b>												<b>4,37%</b>

**Rentabilidade Mensal**



**Rentabilidade Acumulada**



## 9-RENTABILIDADE DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

### 9.1-RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - PREVISO

	JAN											
RENTABILIDADE MENSAL DA CARTEIRA	1,07%											
CDI	1,12%											
IBOVESPA	3,37%											
META ATUARIAL	0,94%											

A RENTABILIDADE DA CARTEIRA DO PREVISO NO MÊS DE JANEIRO FOI DE:

R\$ 3.039.528,95

A META ATUARIAL NO MÊS DE JANEIRO FOI DE:

R\$ 2.665.839,28

## 9.2-RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS 2023 - PREVISÃO

	JAN											
<b>RENTABILIDADE ACUMULADA DA CARTEIRA</b>	<b>1,07%</b>											
<b>CDI</b>	<b>1,12%</b>											
<b>IBOVESPA</b>	<b>3,37%</b>											
<b>META ATUARIAL</b>	<b>0,94%</b>											

**RENTABILIDADE ACUMULADA DO PREVISÃO: R\$ 3.039.528,95**

**META ATUARIAL ACUMULADA: R\$ 2.665.839,28**

**GANHO SOBRE A META ATUARIAL R\$ 373.689,67**



### **9.3.-RENTABILIDADE DA CARTEIRA**

A Carteira de Investimentos do PREVISÓ, apresenta-se com uma rentabilidade acumulada de 1,07% a.a., enquanto o indicador de desempenho do mercado (CDI), obteve um rendimento acumulado de 1,12% a.a., ou seja, uma carteira que alcançou até o momento, uma rentabilidade de 95,92% sobre o índice de referência do mercado.

### **9.4-META ATUARIAL**

Enquanto a rentabilidade acumulada do PREVISÓ é de 1,07% a.a., a Meta Atuarial acumulada no mesmo período é de 0,94%, ou seja, até o momento, a carteira alcançou uma rentabilidade de 114,02% sobre a Meta Atuarial.

---

## 10-ANÁLISE DE MERCADO

### 10.1-TAXA SELIC

Na reunião no dia 31 de janeiro e 01 de fevereiro de 2023, o COPOM decidiu manter a Taxa SELIC em 13,75% a.a.. A decisão reflete as incertezas e oscilações do cenário econômico por conta da perspectiva de baixo crescimento global, volatilidade sobre ativos financeiros e questão inflacionária ainda pressionada. O Comitê informa que será avaliado se a manutenção da taxa de juros por período mais prolongado do que o esperado será capaz de assegurar a convergência da inflação e dá enfoque em continuar com suas estratégias não somente sobre o processo de desinflação como também a ancoragem das expectativas de acordo com suas metas, podendo voltar ao ciclo de ajustes caso o processo de desinflação não ocorra como esperado.

O COPOM tira como base a conjuntura macroeconômica nacional e internacional. No mercado interno o cenário é de desaceleração sobre o crescimento esperado, observando-se queda dos indicadores de confiança e enfraquecimento sobre produção industrial, comércio e serviços. Quanto ao consumidor, a inflação segue elevada.

Em relação ao cenário internacional, a economia mantém indicando um crescimento global abaixo do esperado. O cenário inflacionário segue acentuada, mas, recentemente apresentam uma margem moderada comparada ao já visto anteriormente. No mesmo período, é possível observar uma estabilização nas cadeias de suprimento e preços das principais commodities, assim, reduzindo pressões inflacionárias sobre bens. A política monetária nos países avançados ainda caminha em direção a taxas restritivas de forma sincronizada entre eles, causando um aperto nas condições financeiras e um impacto sobre as expectativas de crescimento econômico

A principal mensagem que traz a ata da reunião é que o COPOM decidiu que continuará com a Taxa SELIC em 13,75% a.a. após avaliar as incertezas ao redor dos cenários dentro da economia e o balanço de riscos que se encontra maior que a variância usual para a inflação prospectiva, além de que é compatível com a estratégia de assegurar a convergência da inflação em torno da meta no horizonte relevante, que inclui os anos de 2023 e 2024. Essa decisão também indica uma suavização nas flutuações do nível da atividade econômica e de fomento do emprego.

A previsão do Boletim Focus, emitido pelo Banco Central no final de dezembro/2022, projetava a taxa de juros finalizando 2023 em 11,75% a.a.. Atualmente, a projeção é de 12,50% a.a..

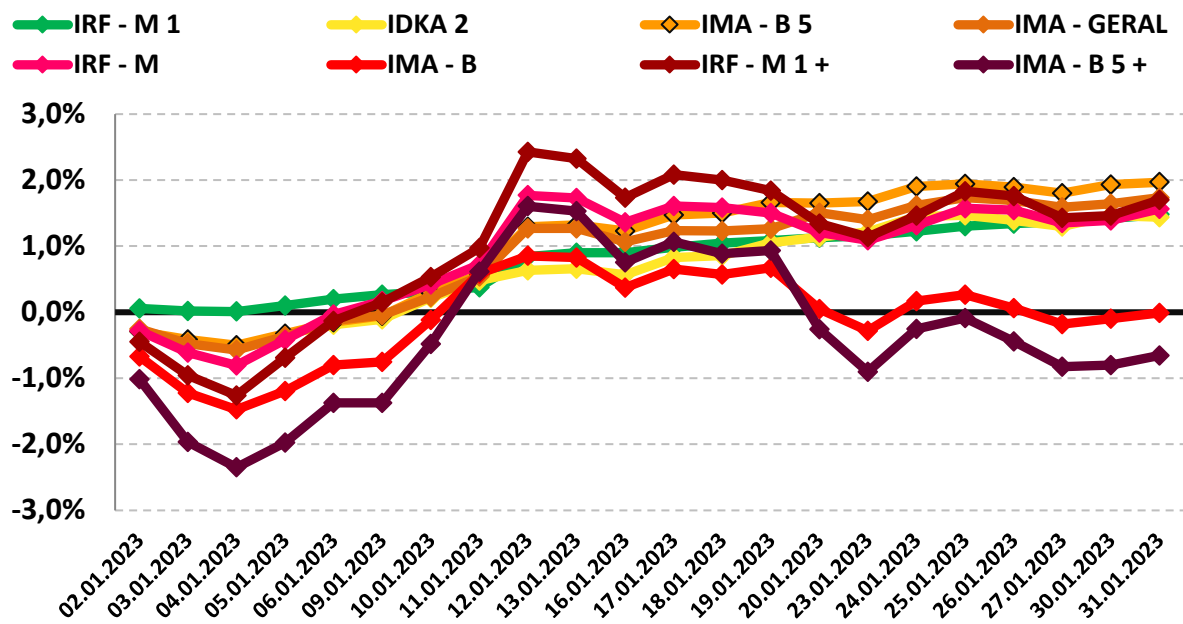
## 10.2-RENDA FIXA

Os Subíndices IMA iniciaram o mês de janeiro com desvalorização, se recuperando na 2ª semana, “andando de lado” ao longo do mês, conseguindo com que os índices Moderados e parte dos índices Arrojados (IRF – M e IRF – M 1+) finalizassem com rentabilidade positiva.

O destaque fica por conta dos Ativos de Longo Prazo (IMA - B e IMA - B 5+) que fecharam o mês com rentabilidade negativa. Somente os índices IMA – B e IMA – B 5+ chegaram a rentabilizar -2,35% e -1,47% na 1ª semana do mês, respectivamente, conseguindo se recuperar, mas, ainda finalizando o mês com retorno negativo de -0,001% e -1,26%. Dentre os índices que apresentaram recuperação durante o mês, destacam-se o IRF – M e IRF – M 1+ que chegaram a rentabilizar -0,81% e -1,26% na 1ª semana de janeiro e fecharam o mês com rentabilidade positiva de 0,84% e 0,72%, respectivamente.

PERFIL	Conservad.	Moderado			(do menos) Arrojado (para o mais)			
ÍNDICE	IRF – M 1	IDKA 2	IMA – B 5	IMA – GERAL	IRF – M	IMA – B	IRF – M 1+	IMA – B 5+
JANEIRO	1,10%	1,44%	1,40%	0,70%	0,84%	0,00%	0,72%	-1,26%
Acumulado/2023	1,10%	1,44%	1,40%	0,70%	0,84%	0,00%	0,72%	-1,26%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



### 10.3-RENDA VARIÁVEL - AÇÕES BRASILEIRAS

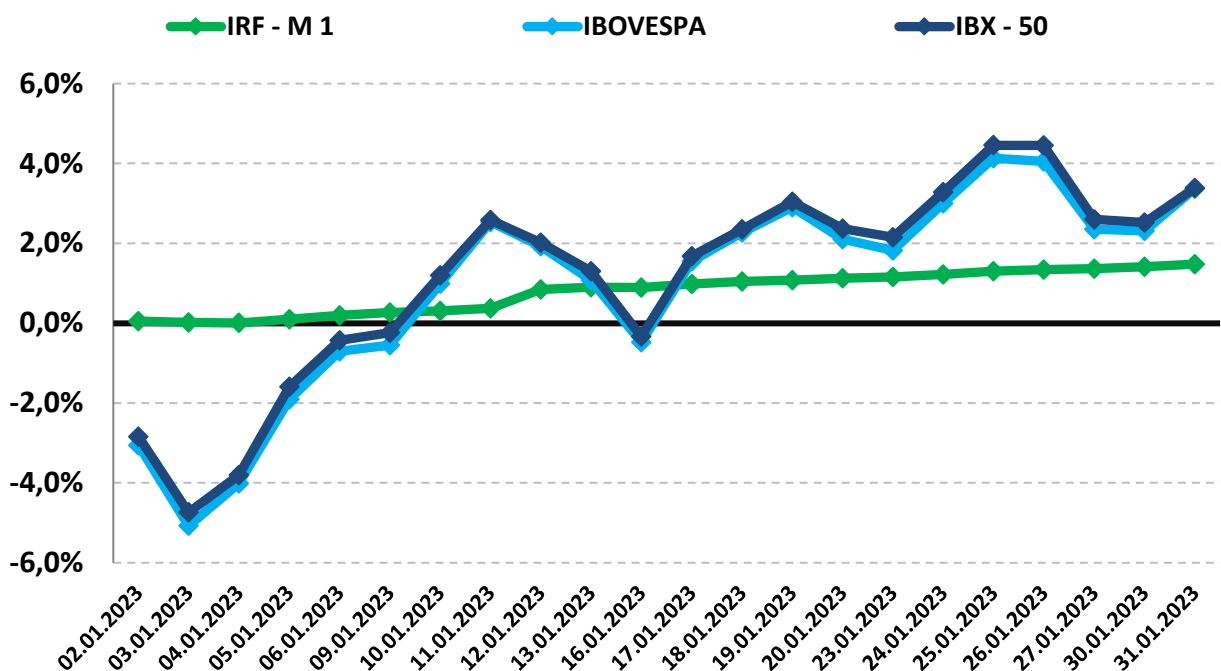
O segmento de Renda Variável apresentou forte valorização durante o mês de janeiro apesar de iniciar o mês com desvalorização, conseguindo fechar positivamente. A maior flexibilização dos meios de contenção da COVID-19 na China e a expectativa sobre o reaquecimento de sua economia fizeram com que houvesse uma alta nos preços das commodities, ao mesmo tempo em que houve uma redução moderada da inflação de modo global.

O índice IBOVESPA, principal indicador de ações negociadas na Bolsa brasileira fechou o mês com variação positiva de 3,37% aos 113.430,54 pontos. O índice acumula a variação positiva de 1,14% nos últimos 12 meses. O índice IBRX-50 que representa as 50 maiores empresas negociadas na Bolsa, finalizou o mês com uma variação positiva de 3,38% aos 19.130,38 pontos. O índice acumula uma variação positiva de 1,53% nos últimos 12 meses.

Analisando por setor, os principais responsáveis pela valorização do IBOVESPA foram as ações de empresas ligadas aos setores de Siderurgia e Seguridades com valorização de 12,58% e 11,87%, respectivamente.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)		
ÍNDICE	IRF – M 1	IBOVESPA	MAIORES DESEMPENHOS	
			SIDERURGIA	SEGURIDADES
JANEIRO	1,10%	3,37%	12,58%	11,87%
Acumulado/2023	1,10%	3,37%	12,58%	11,87%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



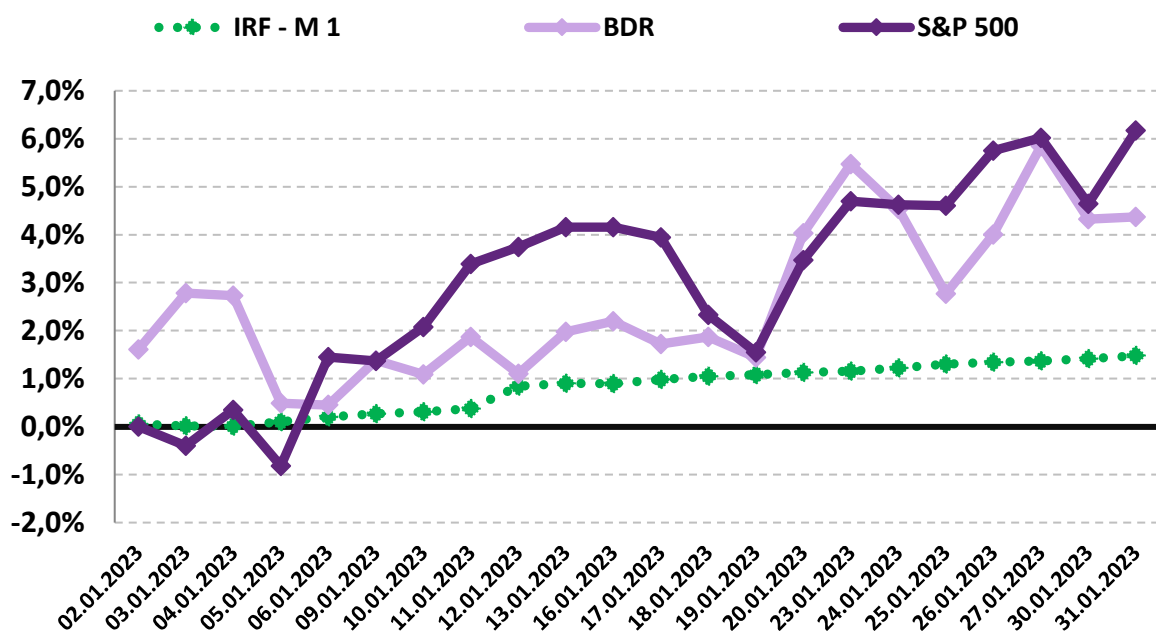
## 10.4-INVESTIMENTO NO EXTERIOR

O segmento de Investimento no Exterior apresentou forte oscilação no mês de janeiro, iniciando com pequena valorização, mas, logo depois, apresentando queda na 1ª semana, voltando a apresentar valorização e fechando o mês com rentabilidade positiva.

O índice BDR, principal indicador de ações negociadas no Brasil de empresas do exterior fechou o mês com variação positiva de 4,37% com cotação de R\$ 11.550,14. O índice acumula uma variação negativa de -16,73% nos últimos 12 meses. O índice S&P 500 que representa as 500 maiores empresas negociadas na Bolsa mundialmente, finalizou o mês com uma variação positiva de 6,18% com cotação de R\$ 4.076,6. O índice acumula uma variação negativa de -9,71% nos últimos 12 meses.

PERFIL	Conservad.	(do menos) Arrojado (para o mais)	
ÍNDICE	IRF – M 1	BDR	S&P 500
JANEIRO	1,10%	4,37%	6,18%
Acumulado/2023	1,10%	4,37%	6,18%

Rentabilidade Acumulada (Mês)



## **11-ANÁLISE MACROECONÔMICA**

### **11.1-IPCA**

O IPCA de janeiro/2023 (0,53%), apresentou redução em relação ao mês anterior (dezembro/2022 = 0,62%).

Nos últimos 12 meses, o IPCA registra acumulação de 5,77%, apresentando 0,02% abaixo dos 5,79% registrados em 2022.

Em janeiro de 2022, o IPCA havia ficado em 0,54%.

#### ***11.1.1-MAIOR ALTA DE PREÇOS***

O grupo que apresentou o maior impacto de alta no IPCA, foi o grupo de ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS cujo índice apresentou inflação de 0,13%, influenciado pela alta de alimentação fora de domicílio.

#### ***11.1.2-MENOR ALTA DE PREÇOS***

O grupo que apresentou impacto negativo no IPCA foi o grupo VESTUÁRIO, cujo índice apresentou deflação de -0,01% do IPCA, influenciado pelo vestuário de roupas femininas.

### *11.1.3-ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS <sup>1</sup>*

No mês de janeiro, o grupo ALIMENTAÇÃO E BEBIDAS apresentou inflação de 0,13%, uma ligeira redução em relação ao mês anterior (dezembro/2022 = 0,14%). Os três produtos do grupo, com a maior alta de preços foram a Cenoura (17,55% a.m. e -5,59% a.a.), a Tangerina (15,51% a.m. e 49,76% a.a.) e a Batata-inglesa (14,14% a.m. e 58,13% a.a.). Os três produtos do grupo, com a maior queda de preços foram o Limão (-36,45% a.m. e -8,33% a.a.), a Cebola (-22,68% a.m. e 58,27% a.a.) e o Acém (-1,93% a.m. e -2,11% a.a.).

### *11.1.4-INFLAÇÃO POR REGIÃO*

No mês, Salvador - BA foi a capital que apresentou a maior inflação 1,09%, enquanto Curitiba - PA apresentou deflação de -0,05%. No mesmo período, o IPCA registra inflação de 0,53%.

Nos últimos 12 meses, São Paulo - SP é a capital que apresenta a maior inflação 6,67%, enquanto Goiânia - GO apresenta inflação de 4,24%. No mesmo período, o IPCA registra alta de 5,77%.

---

<sup>1</sup> O grupo Alimentação e Bebidas, que representa 25,84% do IPCA, é o maior peso entre os 9 grupos pesquisados pelo IBGE. 1% de alta dos preços deste grupo, tem uma representatividade maior do que o grupo Comunicação, por exemplo, que representa 3,74% do IPCA. Por isso, este grupo merece uma análise especial sobre o aumento de preços.

---

## 11.2-CENÁRIO ECONÔMICO EXTERNO E INTERNO

### INTERNACIONAL

O mês de janeiro foi marcado pela expectativa de diminuição do ritmo de aumento do indicadores de inflação, níveis de crescimento moderados e a reabertura da economia da China após maiores flexibilizações sobre a contenção da COVID-19. O PIB dos EUA apresentou crescimento no fechamento de 2022 e teve indícios de moderação sobre a inflação, assim, havendo redução do risco de novos aumentos inflacionários que poderiam fazer o Banco Central Americano (FED) aprovar altas mais expressivas sobre os juros. A zona do Euro apresentou melhoras após conseguirem novos meios de abastecimento de gás natural, no entanto, tais esforços para balancear a crise energética pode gerar efeitos negativos a economia. Apesar da diminuição das incertezas sobre a situação energética da região, a inflação ainda se encontra elevada e não apresentam sinais de redução enquanto o Banco Central Europeu reforça a estratégia de convergência da inflação de acordo com suas metas. Na China, o país passou por um processo de reabertura mais acentuada da economia após as flexibilizações das políticas sanitárias contra a COVID-19, e que gerou um aumento sobre as expectativas de crescimento durante 2023. Com o reaquecimento de sua economia, a demanda interna pode apresentar estímulo diante da inflação moderada, enquanto isso, o setor imobiliário segue com desafios, apresentando uma desaceleração que impacta a indústria e os investimentos.

### BRASIL

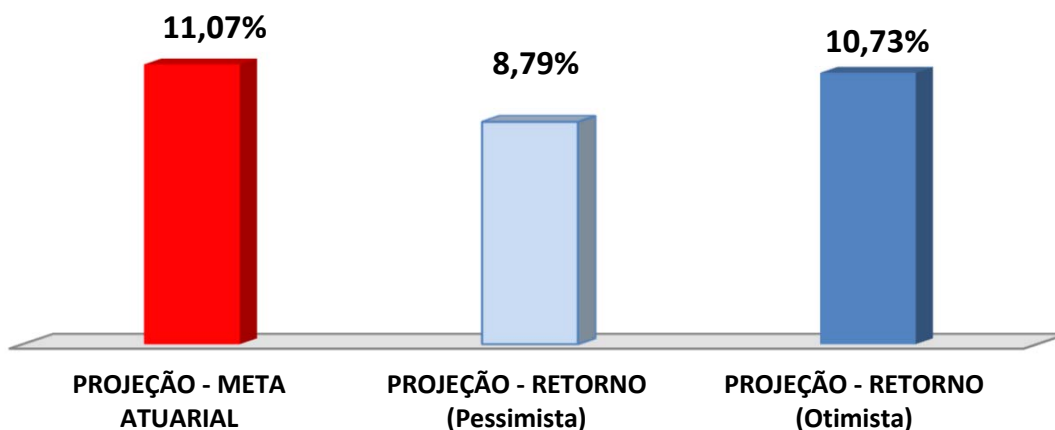
No Brasil, o cenário econômico ainda apresenta incertezas no médio prazo. A política monetária mais restritiva pode continuar, podendo afetar as expectativas sobre a retomada do crescimento. As incertezas sobre a política fiscal levando em conta as decisões sobre a economia e a política de transição, ainda é um ponto relevante dentro do cenário econômico atual e que impacta sobre as altas da expectativa da inflação, como foi discutido dentre os temas abordados na primeira reunião de 2023 da COPOM onde o tema sobre as expectativas sobre a inflação foi enfatizado. A inflação segue em um caminho de desaceleração apesar dos desafios encontrados sobre a convergência do IPCA para a meta. Assim, a definição de um arcabouço fiscal para que se possa garantir a sustentabilidade das contas públicas enquanto é buscado um crescimento e maior eficiência será de grande importância para que possa haver a convergência da taxa de juros a patamares neutros e as expectativas futuras para o crescimento do PIB do país.

## 12-PROJEÇÃO DA META ATUARIAL E RENTABILIDADE DA CARTEIRA

Conforme o último Boletim FOCUS, emitido pelo Banco Central em 20/01/2023, a inflação projetada para o final do ano deverá ficar em 5,48% e a Meta Atuarial aproximadamente em 11,07%.

Se não tivermos grandes oscilações no mercado e a distribuição permanecer nos mesmos índices, conforme demonstra a página 18, a carteira deverá rentabilizar entre 8,79% a 10,73% no final do ano, podendo encontrar dificuldades para alcançar a Meta Atuarial.

### Projeção da Carteira



As recomendações e as análises efetuadas seguem as disposições estabelecidas na **Resolução CMN 4.963/2021**, tendo presente as condições de segurança, rentabilidade, solvência, liquidez, motivação, adequação as obrigações previdenciárias e transparência.

É o Parecer.